

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年9月10日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (6)【申込単位】

1円以上1円単位

### (7)【申込期間】

2021年9月11日から2022年3月11日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

#### 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式				
一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株				
中小型株	年2回	日本		
債券				
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
公債		欧州		
社債	年6回 (隔月)	アジア		
その他債券		オセアニア		
クレジット属性 ( )				
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米		
その他資産 (投資信託証券) (資産複合 資産配分変更型) (株式、債券、不動産投信)	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産配分固定型		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、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

**1** 内外の株式、債券、リートおよび短期金融資産に投資し、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

#### < 2021年6月時点の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	34%	19%	7%	7%	19%	14%

#### < 当初設定時の基本配分比率 >

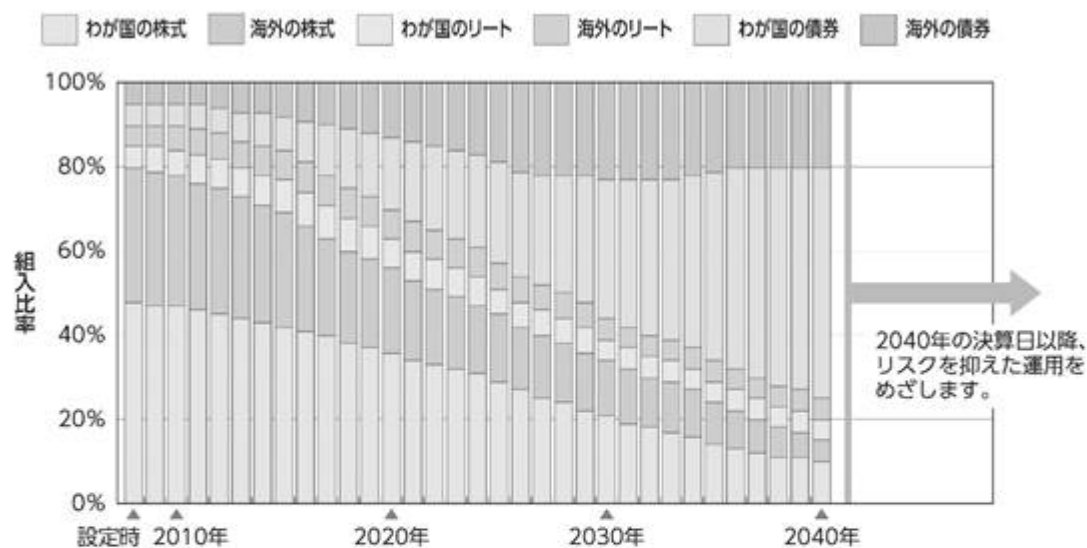
	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	48%	32%	5%	5%	5%	5%

※上記基本配分比率における「わが国の債券」の比率には、「わが国の短期債券および短期金融資産」の比率を含みます。

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。



## ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2021年6月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2020年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。
- (注4) 投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

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

- 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
  - (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
  - (b) ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
  - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

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

#### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるMSC I コクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

#### MSC I コクサイ指数とは

MSC I コクサイ指数は、MSC I 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、MSC I コクサイ指数（円ベース）は、MSC I コクサイ指数（米ドルベース）をもとに、MSC I 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、MSC I Inc. に帰属します。また、MSC I Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

## 4

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

## 運用プロセス



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

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

## 東証REIT指数とは

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

## 【算出方法の概要】

指数：算出時の時価総額<sup>(注1)</sup> ÷ 基準時の時価総額<sup>(注2)</sup> × 1,000

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

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

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

## 5

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

## 運用プロセス



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

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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

## 【特徴】

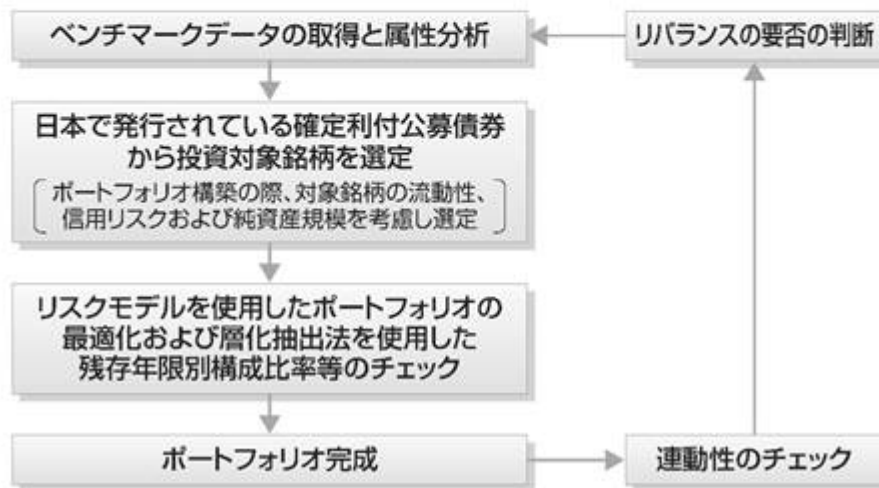
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

## 6

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

## 運用プロセス



ポートフォリオの構築にあたっては、金利リスクや信用リスクなどのリスク特性がベンチマークであるNOMURA－BPI総合指数と同程度となるように、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法<sup>(注2)</sup>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で、同指数との連動をめざします。また、ベンチマークの構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

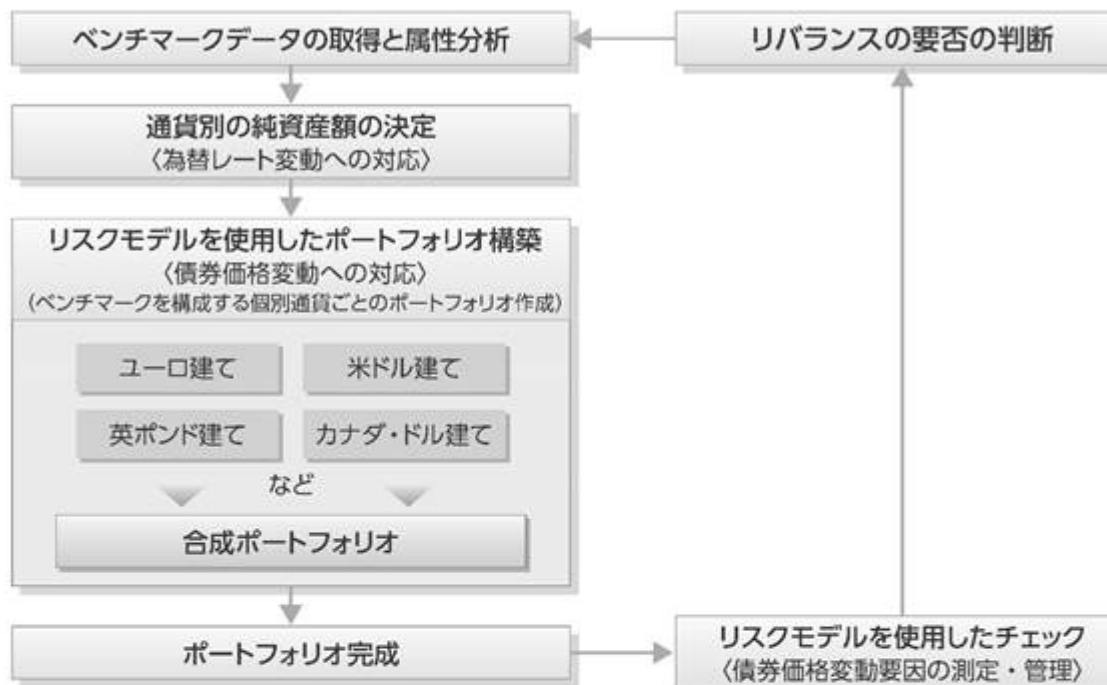
## NOMURA－BPI総合指数とは

NOMURA－BPIは、野村証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、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

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

## 運用プロセス



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

### ①為替レート変動への対応

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

### ②債券価格変動への対応

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

### ③債券価格変動要因の測定・管理

リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

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

## FTSE世界国債インデックスとは

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



## 8

2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

#### NOMURA－BPI総合短期指数とは

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

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

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



## ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

〈2040年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈2040年の決算日から〉



・為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～8.の運用が行なわれないことがあります。

9

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

10

毎年12月18日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。

#### 〈分配方針〉

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

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

#### (2) 【ファンドの沿革】

2008年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など	お申込金（ 3）
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など	お申込金（ 3）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）( 2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図	2	損益 信託金( 3)
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十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。 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 など
		損益 投資
投資対象	内外の株式・債券・リート（REIT）および短期金融資産 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から收受します。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	株 2,608,525	% 100.00

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

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

ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

#### 当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の48%

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 .....信託財産の純資産総額の32%

ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券 .....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券

.....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券

.....信託財産の純資産総額の 5%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 .....信託財産の純資産総額の 5%

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．2040年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

## (2)【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

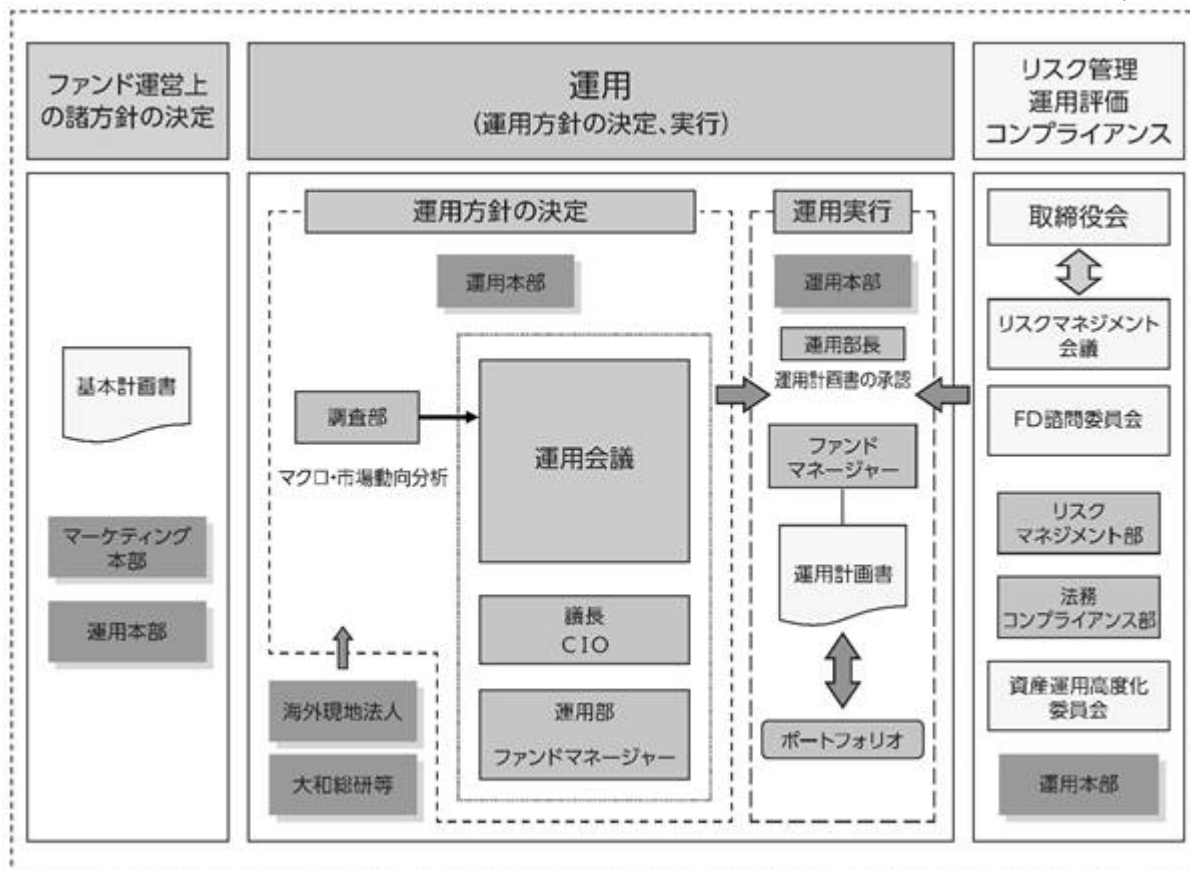
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

## (3)【運用体制】

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。



#### 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。

#### 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。

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。

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】**

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

**(5)【投資制限】**

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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。

外国為替予約取引（信託約款）

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

#### 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。

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

### <参考> 各マザーファンドの概要

#### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 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。

###### 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いません。

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

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



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

1. 株券または新株引受権証書
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

(注) 東証株価指数(TOPIX)とは

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

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

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

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式(預託証券を含みます。)を主要投資対象とします。

投資態度

イ. 主として外国の株式(預託証券を含みます。)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

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

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

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

委託会社は、信託金を、前 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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

## 3. ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下、「<参考>各マザーファンドの概要」において同じ。

投資態度

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

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

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

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

## (2) 投資対象

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)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

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

4．新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

#### 先物取引

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

#### (注) 東証REIT指数とは

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

#### [算出方法の概要]

指数：算出時の時価総額(注1) ÷ 基準時の時価総額(注2) × 1,000

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

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

## 4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

#### 投資態度

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

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

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

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

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)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

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引

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

（注）S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）とは

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

#### 〔特徴〕

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

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®および S&P®は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

## 5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

### (1) 投資方針

#### 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。

#### 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 - B P I 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

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)、および に定めるものに限りま。

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

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。)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券

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。)

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

委託会社は、信託金を、前 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

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せん。）の行使等により取得したものに限りません。

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。

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。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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。

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るときは、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。

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るときは、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 - B P I 総合指数とは

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

## 6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 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 - B P I 総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

### (2) 投資対象

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)、および 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

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

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

委託会社は、信託金を、前 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

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します。

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。

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。

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### 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るときは、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。

#### 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るときは、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 - B P I 総合短期指数とは

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

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

## 7. 外国債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### 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

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

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

委託会社は、信託金を、前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

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。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。

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

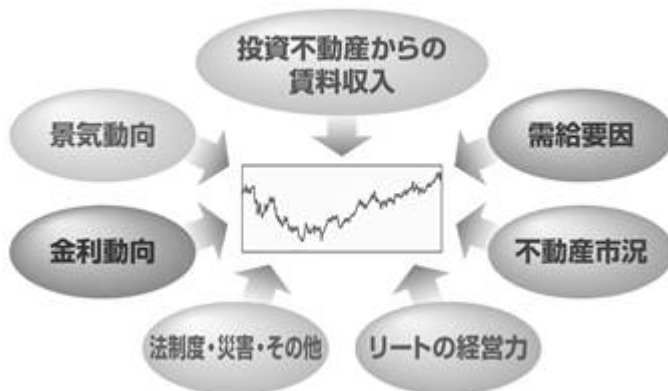
株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

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。

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

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



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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カンントリー・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。

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。

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

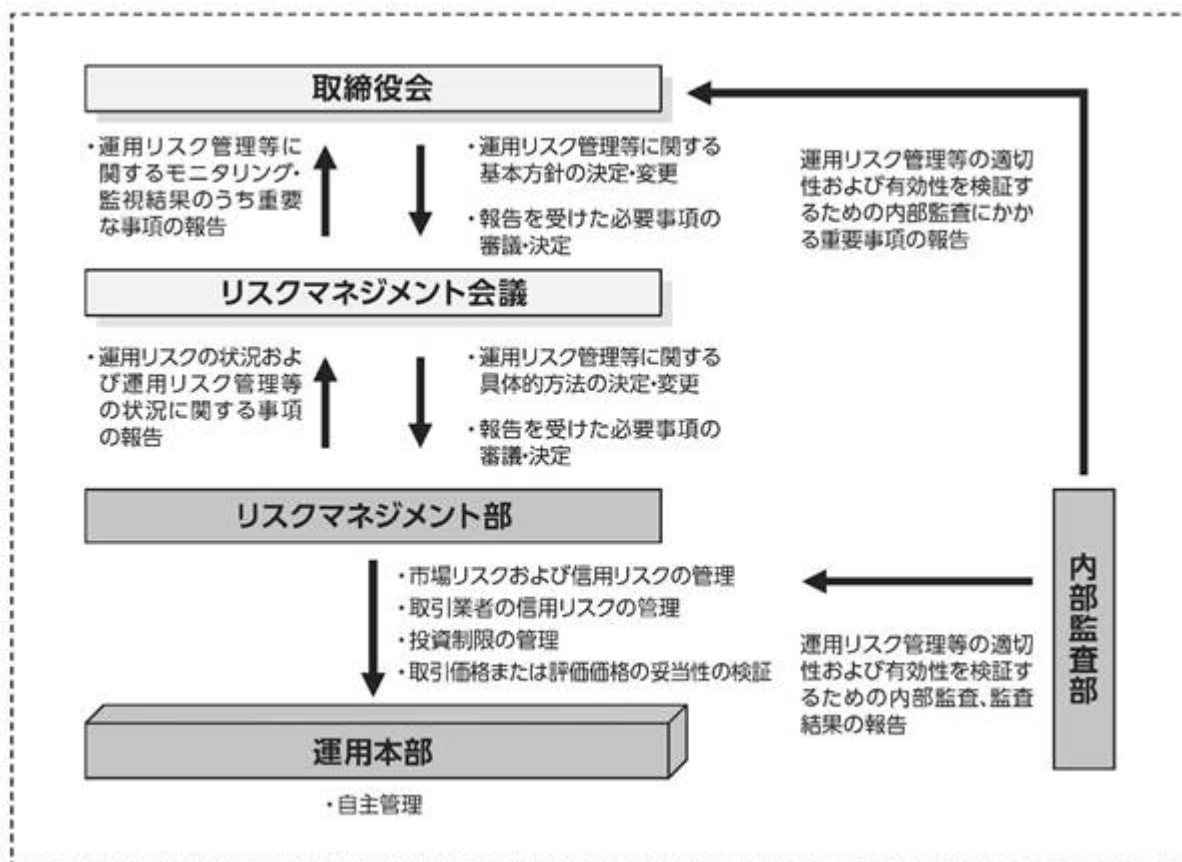
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

### (3)その他の留意点

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

### (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



### 流動性リスクに対する管理体制

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

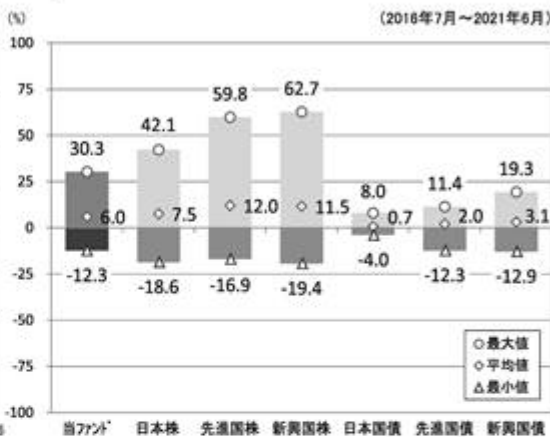
## 参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

### ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット 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。●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・インデックスー エマージング・マーケット 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。

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】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

	信託報酬率
第1計算期間から2016年3月11日まで	年率0.715%（税抜0.65%）
2016年3月12日から第18計算期間まで	年率0.396%（税抜0.36%）
第19計算期間から第28計算期間まで	年率0.374%（税抜0.34%）
第29計算期間から第33計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第34計算期間以降	年率0.242%（税抜0.22%）

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。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から2016年3月11日まで >

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

< 2016年3月12日から第18計算期間まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.165% （税抜）	年率0.165% （税抜）	年率0.03% （税抜）

< 第19計算期間から第28計算期間まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.155% （税抜）	年率0.155% （税抜）	年率0.03% （税抜）

< 第29計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 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】

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。

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

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。

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

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

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

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

##### イ．収益分配金に対する課税

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

得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

#### <注1> 個別元本について

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。

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。

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。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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。

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、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	174,888,712	99.80
内 日本	174,888,712	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	345,524	0.20
純資産総額	175,234,236	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)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	45,106,492	1.2275 55,371,200	1.3123 59,193,249	33.78
2 ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	31,899,644	1.0468 33,393,637	1.0460 33,367,027	19.04
3 外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	8,809,295	3.1719 27,942,755	3.7865 33,356,395	19.04
4 外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	7,869,325	3.0403 23,925,843	3.1058 24,440,549	13.95
5 ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	3,517,963	2.8683 10,090,717	3.5087 12,343,476	7.04
6 ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	4,281,605	2.3164 9,918,262	2.8466 12,188,016	6.96

(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。

## □．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【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】

## 【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4計算期間末 (2011年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
第5計算期間末 (2012年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
第6計算期間末 (2013年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (2014年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
第8計算期間末 (2015年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
第9計算期間末 (2016年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
第10計算期間末 (2017年12月18日)	37,746,883	37,746,883	1.5802	1.5802
第11計算期間末 (2018年12月18日)	45,018,917	45,018,917	1.4875	1.4875



第12計算期間末 (2019年12月18日)	77,674,021	77,674,021	1.6805	1.6805
2020年6月末日	95,430,156	-	1.5628	-
7月末日	104,559,459	-	1.5556	-
8月末日	106,112,858	-	1.6317	-
9月末日	106,486,936	-	1.6221	-
10月末日	107,715,342	-	1.5830	-
11月末日	113,025,336	-	1.7019	-
第13計算期間末 (2020年12月18日)	119,539,263	119,539,263	1.7292	1.7292
12月末日	120,422,481	-	1.7399	-
2021年1月末日	123,817,584	-	1.7556	-
2月末日	134,338,401	-	1.7979	-
3月末日	155,463,391	-	1.8785	-
4月末日	160,178,733	-	1.8860	-
5月末日	159,973,815	-	1.9068	-
6月末日	175,234,236	-	1.9318	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2020年12月19日～ 2021年6月18日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	14.0
第5計算期間	21.5
第6計算期間	43.9
第7計算期間	17.9

第8計算期間	6.5
第9計算期間	2.3
第10計算期間	11.7
第11計算期間	5.9
第12計算期間	13.0
第13計算期間	2.9
2020年12月19日～ 2021年6月18日	11.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4計算期間	974,376	122,837
第5計算期間	4,521,213	2,261,666
第6計算期間	4,772,167	334,316
第7計算期間	2,261,839	449,310
第8計算期間	6,366,392	910,747
第9計算期間	5,468,224	1,102,640
第10計算期間	7,259,647	3,856,478
第11計算期間	9,247,574	2,870,316
第12計算期間	21,843,305	5,886,469
第13計算期間	45,072,340	22,164,723
2020年12月19日～ 2021年6月18日	34,626,381	14,494,499

(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)

### 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。

□．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。

#### 八．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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### 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 030 9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。

#### 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 ニューゼaland	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)

## 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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### 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。

## ダイワJ-REIT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(%)
投資証券	481,367,717,370	97.57
内 日本	481,367,717,370	97.57

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,994,851,699	2.43
純資産総額	493,362,569,069	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	11,942,000,000	2.42
内 日本	11,942,000,000	2.42

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

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

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

## (2) 投資資産 (2021年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	46,667	674,655.44 31,484,145,516	693,000.00 32,340,231,000	6.56
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	41,466	674,736.19 27,978,611,015	683,000.00 28,321,278,000	5.74
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	206,537	108,572.15 22,424,168,101	120,400.00 24,867,054,800	5.04
4	GLP投資法人	日本	投資証券	129,570	164,336.07 21,293,025,023	191,600.00 24,825,612,000	5.03
5	野村不動産マスターF	日本	投資証券	134,090	172,126.55 23,080,450,121	178,100.00 23,881,429,000	4.84
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	65,554	317,993.09 20,845,719,369	353,500.00 23,173,339,000	4.70
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	59,163	288,865.45 17,090,147,010	327,500.00 19,375,882,500	3.93
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	82,619	184,732.08 15,262,380,108	213,800.00 17,663,942,200	3.58
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,386	326,242.54 12,849,388,688	370,000.00 14,572,820,000	2.95
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	88,679	147,604.75 13,089,442,436	160,700.00 14,250,715,300	2.89

11	産業ファンド	日本	投資証券	58,613	178,963.37 10,489,580,039	211,900.00 12,420,094,700	2.52
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	25,816	396,019.78 10,223,646,861	435,000.00 11,229,960,000	2.28
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	121,960	86,422.00 10,540,027,135	92,000.00 11,220,320,000	2.27
14	API投資法人	日本	投資証券	20,778	474,099.29 9,850,835,132	526,000.00 10,929,228,000	2.22
15	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,827	755,872.60 9,695,577,962	783,000.00 10,043,541,000	2.04
16	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	50,158	161,720.73 8,111,588,769	187,600.00 9,409,640,800	1.91
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	14,290	609,532.61 8,710,221,014	641,000.00 9,159,890,000	1.86
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	27,093	303,135.90 8,212,861,103	334,000.00 9,049,062,000	1.83
19	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	133,584	60,895.70 8,134,692,469	66,600.00 8,896,694,400	1.80
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,472	514,211.12 7,441,663,370	592,000.00 8,567,424,000	1.74
21	森ヒルズリート	日本	投資証券	48,708	151,305.32 7,369,779,872	166,600.00 8,114,752,800	1.64
22	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	173,381	40,409.53 7,006,246,168	42,800.00 7,420,706,800	1.50
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,761	466,620.48 6,421,164,489	519,000.00 7,141,959,000	1.45
24	イオンリート投資	日本	投資証券	42,058	146,894.63 6,178,094,395	164,500.00 6,918,541,000	1.40
25	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,822	735,999.66 6,492,989,077	773,000.00 6,819,406,000	1.38
26	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	28,261	198,552.41 5,611,289,903	240,100.00 6,785,466,100	1.38
27	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	54,146	106,994.75 5,793,337,849	120,800.00 6,540,836,800	1.33
28	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	18,643	320,013.34 5,966,008,833	350,000.00 6,525,050,000	1.32
29	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	34,374	171,453.39 5,893,538,927	187,100.00 6,431,375,400	1.30
30	日本リート投資法人	日本	投資証券	13,468	395,446.67 5,325,875,762	456,500.00 6,148,142,000	1.25

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.57%
合計	97.57%

(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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 030 9月	買建	5,600	11,723,096,000	11,942,000,000	2.42%

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

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

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

##### (1) 投資状況 (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(%)
投資信託受益証券	339,469,542	0.79
内 アメリカ	339,469,542	0.79
投資証券	41,679,926,962	97.59
内 ガーンジー	103,475,524	0.24
内 韓国	74,492,363	0.17
内 香港	662,739,284	1.55

内 シンガポール	1,573,332,913	3.68
内 イスラエル	16,984,407	0.04
内 イギリス	2,232,619,108	5.23
内 アイルランド	46,574,307	0.11
内 オランダ	75,117,277	0.18
内 ベルギー	541,593,978	1.27
内 フランス	906,454,461	2.12
内 ドイツ	108,161,707	0.25
内 スペイン	170,149,553	0.40
内 イタリア	7,238,505	0.02
内 カナダ	831,454,329	1.95
内 アメリカ	31,189,675,672	73.03
内 オーストラリア	2,974,661,624	6.96
内 ニュージーランド	165,201,950	0.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	691,185,782	1.62
純資産総額	42,710,582,286	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	713,484,087	1.67
内 ドイツ	183,098,175	0.43
内 アメリカ	530,385,912	1.24
為替予約取引(買建)	307,840,505	0.72
内 日本	307,840,505	0.72

(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)

## 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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	186,519	11,194.34 2,087,978,460	13,429.94 2,504,939,165	5.86
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	22,600	77,505.41 1,751,623,902	88,721.65 2,005,109,322	4.69

3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	38,500	24,755.10 953,074,645	33,558.81 1,292,014,508	3.03
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	83,047	9,777.37 811,987,364	14,484.87 1,202,925,348	2.82
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	71,178	15,158.74 1,078,976,260	16,853.49 1,199,598,266	2.81
6	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	105,500	7,204.50 760,079,570	9,223.47 973,076,908	2.28
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	35,300	18,737.22 661,425,247	23,256.07 820,939,617	1.92
8	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	432,950	1,547.02 669,817,899	1,767.13 765,079,453	1.79
9	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	86,900	6,669.85 579,619,733	8,576.58 745,305,219	1.75
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	94,517	6,841.58 646,649,368	7,513.91 710,192,326	1.66
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	34,700	18,312.71 635,454,892	20,238.35 702,270,801	1.64
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	33,800	12,534.90 423,680,104	18,204.78 615,321,747	1.44
13	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	94,879	5,361.58 508,703,397	6,399.26 607,155,826	1.42
14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	143,597	3,225.72 463,210,123	4,148.96 595,778,439	1.39
15	LINK REIT	香港	投資証券	537,200	982.41 527,761,550	1,081.52 580,996,842	1.36
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	16,467	27,847.58 458,566,709	33,409.53 550,154,819	1.29
17	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	28,928	13,951.76 403,598,157	18,782.01 543,326,072	1.27
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,300	15,680.13 443,747,864	19,075.05 539,823,915	1.26
19	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	302,800	1,400.18 423,988,350	1,693.18 512,696,055	1.20
20	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	136,300	3,322.37 452,842,439	3,724.33 507,626,779	1.19
21	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	94,900	4,304.21 408,476,504	5,290.14 502,034,969	1.18
22	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	135,800	2,879.94 391,097,243	3,432.40 466,120,355	1.09



23	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	35,900	11,312.77 406,131,987	12,587.32 451,884,838	1.06
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	75,100	4,383.72 329,217,626	5,470.39 410,826,484	0.96
25	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	45,000	7,755.52 349,003,053	8,329.99 374,849,613	0.88
26	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	24,500	10,950.84 268,298,352	14,812.19 362,898,680	0.85
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	42,900	6,588.02 282,629,608	8,321.14 356,977,121	0.84
28	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	73,000	3,078.98 224,771,123	4,679.74 341,621,429	0.80
29	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	30,000	11,353.69 340,612,939	11,315.65 339,469,542	0.79
30	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	178,600	1,633.70 291,789,459	1,871.01 334,163,029	0.78

(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。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.79%
投資証券	97.59%
合計	98.38%

(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。

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DJ US REAL ESTATE 202109	買建	120	542,766,449	530,385,912	1.24%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202109	買建	153	188,178,420	183,098,175	0.43%

為替予約取引	日本	ニュージーランド・ドル 買/円売 2021年7月	買建	70,000	5,571,377	5,409,439	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2021年7月	買建	90,000	8,163,810	8,023,077	0.02%
		米ドル買/円売 2021年7 月	買建	1,770,000	195,769,913	195,717,739	0.46%
		ユーロ買/円売 2021年7 月	買建	750,000	99,776,680	98,690,250	0.23%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### ダイワ短期日本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	278,221,620	97.98
内 日本	278,221,620	97.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,732,081	2.02
純資産総額	283,953,701	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)

##### 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 (%)
1 134 5年国債	日本	国債証 券	47,000,000	100.48 47,226,456	100.32 47,152,280	0.100000 2022/12/20	16.61
2 136 5年国債	日本	国債証 券	40,000,000	100.58 40,235,600	100.43 40,173,600	0.100000 2023/06/20	14.15
3 135 5年国債	日本	国債証 券	40,000,000	100.54 40,216,000	100.37 40,151,200	0.100000 2023/03/20	14.14

4	416 2年国債	日本	国債証券	40,000,000	100.43 40,174,200	100.25 40,102,800	0.100000 2022/09/01	14.12
5	334 10年国債	日本	国債証券	39,000,000	102.23 39,873,130	102.17 39,848,640	0.600000 2024/06/20	14.03
6	137 5年国債	日本	国債証券	35,000,000	100.66 35,231,300	100.49 35,171,500	0.100000 2023/09/20	12.39
7	333 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	102.19 30,657,490	101.97 30,593,100	0.600000 2024/03/20	10.77
8	138 5年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.69 5,034,850	100.57 5,028,500	0.100000 2023/12/20	1.77

(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	97.98%
合計	97.98%

(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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資状況（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)

## 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	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 (%)
				また は 額面金額				
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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### 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・リングgit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

## ●DCダイワ・ターゲットイヤー 2040

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	19,318円
純資産総額	1.7億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.3%
3か月間	2.8%
6か月間	11.0%
1年間	23.6%
3年間	24.4%
5年間	59.0%
設定来	93.2%

※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2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期
	09年12月	10年12月	11年12月	12年12月	13年12月	14年12月	15年12月	16年12月	17年12月	18年12月	19年12月	20年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	2,133	33.8%	日本円	60.1%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.2%	
国内債券	8	18.7%	米ドル	25.2%	最終利回り(%)	S&P500 EMINI FUT 202109	アメリカ	0.9%	
外国株式・先物	1,233	18.6%	ユーロ	8.0%	修正デュレーション	ソニーグループ	日本	0.8%	
外国債券	834	13.7%	英ポンド	2.2%	残存年数	ソフトバンクグループ	日本	0.8%	
外国リート・先物	333	7.3%	豪ドル	1.2%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	0.8%	
国内リート・先物	62	7.0%	カナダ・ドル	1.1%	AAA	91.5%	日本ビルファンド	日本	0.5%
外国投資信託等	10	0.1%	スイス・フラン	0.6%	AA	3.7%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.4%
			シンガポール・ドル	0.4%	A	4.8%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			香港ドル	0.3%	BBB	-	日本都市ファンド投資法人	日本	0.4%
コール・ローン、その他	3.0%		その他	1.0%	BB	-	GLP投資法人	日本	0.4%
合計	4,613	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.5%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

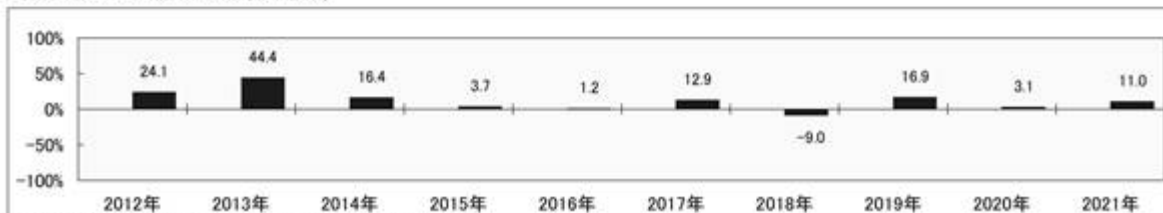
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI lineが提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2021年は6月30日までの騰落率を表示しています。

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】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

#### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または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、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・ わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・ 公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
  2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
  3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または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) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第34計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。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發します。
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、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。

#### 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っ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發します。
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っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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であっても、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。

#### 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。

#### 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)を毎計算期末に作成し、信託財産にかかる知っ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。

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。

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。

収益分配金にかかる請求権

受益者は、収益分配金(分配金額は、委託会社が決定します。)を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金にかかる請求権

受益者は、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)を持分に応じて請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

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13期計算期間(2019年12月19日から2020年12月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 2019年12月18日現在	第13期 2020年12月18日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	274,304	453,174
親投資信託受益証券	77,520,863	119,302,409
流動資産合計	77,795,167	119,755,583
資産合計	77,795,167	119,755,583
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	9,853	17,627
未払委託者報酬	108,862	194,374
その他未払費用	2,431	4,319
流動負債合計	121,146	216,320
負債合計	121,146	216,320
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 46,221,439	1 69,129,056
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,452,582	50,410,207
(分配準備積立金)	10,672,012	13,209,830
元本等合計	77,674,021	119,539,263
純資産合計	77,674,021	119,539,263
負債純資産合計	77,795,167	119,755,583



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	2018年12月19日 至 2019年12月18日	自	2019年12月19日 至 2020年12月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		7,310,809		5,234,546
営業収益合計		7,310,809		5,234,546
営業費用				
支払利息		-		15
受託者報酬		17,637		31,856
委託者報酬		195,184		351,311
その他費用		4,309		7,794
営業費用合計		217,130		390,976
営業利益		7,093,679		4,843,570
経常利益		7,093,679		4,843,570
当期純利益		7,093,679		4,843,570
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（ ）		412,995		954,549
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		14,754,314		31,452,582
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,950,416		27,671,844
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,950,416		27,671,844
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,932,832		14,512,338
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,932,832		14,512,338
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		31,452,582		50,410,207

## (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13期 自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第12期 2019年12月18日現在	第13期 2020年12月18日現在
1. 1 期首元本額	30,264,603円	46,221,439円
期中追加設定元本額	21,843,305円	45,072,340円
期中一部解約元本額	5,886,469円	22,164,723円
2. 計算期間末日における受益権の総数	46,221,439口	69,129,056口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	自 2018年12月19日 至 2019年12月18日	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1 分配金の計算過程	<p>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(4,486,187円)、投資信託約款に規定される収益調整金(26,022,932円)及び分配準備積立金(6,185,825円)より分配可能額は36,694,944円(1万口当たり7,938.94円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>	<p>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(5,798,134円)、投資信託約款に規定される収益調整金(47,469,599円)及び分配準備積立金(7,411,696円)より分配可能額は60,679,429円(1万口当たり8,777.70円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第13期 自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第13期 2020年12月18日現在
-----	-----------------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第12期 2019年12月18日現在	第13期 2020年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	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	6,872,918	5,992,154
合計	6,872,918	5,992,154

## (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12期 2019年12月18日現在	第13期 2020年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第13期</p> <p>自 2019年12月19日</p> <p>至 2020年12月18日</p>
<p>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。</p>

（1口当たり情報）

	第12期 2019年12月18日現在	第13期 2020年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6805円 (16,805円)	1.7292円 (17,292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	35,945,672	42,973,050	
	外国株式インデックスマザーファンド	7,806,988	23,986,189	
	外国債券インデックスマザーファンド	5,077,197	15,364,105	
	ダイワJ - R E I Tマザーファンド	3,047,039	8,347,058	
	ダイワ・グローバルR E I Tインデッ クス・マザーファンド	3,760,732	8,474,433	

	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド（ＢＰＩ）	15,586,155	20,157,574	
親投資信託受益証券	合計		119,302,409	
合計			119,302,409	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

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

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

### 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,454,495,771	19,997,284,612
株式	2 3 159,283,041,130	157,993,811,340
派生商品評価勘定	7,155,750	32,496,150
未収入金	3,473,900	81,864,989
未収配当金	16,030,170	30,357,584
未収利息	590,417	522,106
その他未収収益	4 4,758,152	14,127,141
差入委託証拠金	9,120,000	-
流動資産合計	171,778,665,290	178,150,463,922
資産合計	171,778,665,290	178,150,463,922
負債の部		
流動負債		
前受金	12,060,000	28,224,000
未払解約金	343,821,540	10,075,447,935
受入担保金	11,536,217,070	8,455,151,145
流動負債合計	11,892,098,610	18,558,823,080
負債合計	11,892,098,610	18,558,823,080
純資産の部		
元本等		
元本	1 141,422,704,097	133,497,261,446
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,463,862,583	26,094,379,396



元本等合計	159,886,566,680	159,591,640,842
純資産合計	159,886,566,680	159,591,640,842
負債純資産合計	171,778,665,290	178,150,463,922

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>受取配当金</p> <p>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。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日	2019年12月19日
期首元本額	134,974,559,390円	141,422,704,097円
期中追加設定元本額	33,367,159,925円	28,240,870,154円
期中一部解約元本額	26,919,015,218円	36,166,312,805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	3,719,414,431円	3,168,441,511円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	7,472,340,169円	6,643,901,616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V A 2	5,762,559円	930,510円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,609,321円	30,535,580円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	755,697,182円	623,575,767円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	46,148,600円	33,892,315円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,115,043,907円	874,355,172円
日本株式インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	51,012,739円	131,839,212円
D-I's TOPIXイン デックス	54,294,452円	32,837,839円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	15,656,840円	9,520,635円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	8,197,584円	24,968,635円

iFree TOPIXイン デックス	1,316,972,376円	2,220,877,385円
iFree 8資産バランス	2,037,018,533円	2,611,434,527円
iFree 年金バランス	65,777,526円	149,162,339円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,855,332,336円	64,990,219,547円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,833,642,415円	2,947,069,676円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,207,500,578円	3,732,560,786円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,977,185,378円	3,318,474,811円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,811,890,255円	5,179,124,291円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	13,334,541円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	55,271,798円	46,810,118円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	25,479,310円	35,945,672円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	307,233,273円	839,698,602円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,704,936円	10,903,922円
ダイワつみたてインデックス バランス50	442,340円	7,976,371円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,320,710円	11,919,728円

ダイワ世界バランスファンド 40VA	147,492,253円	129,490,275円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	156,190,807円	139,591,744円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,482,950,539円	7,527,954,251円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	719,627,452円	637,068,308円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	111,646,037円	99,902,437円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	215,465,757円	178,714,272円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	146,213,096円	143,373,446円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,009,316,770円	10,039,033,330円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	7,734,871,439円	830,852,621円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,552,426,398円	2,194,547,687円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,308,512,347円	1,231,058,118円
ダイワライフスタイル25	177,904,636円	171,113,439円
ダイワライフスタイル50	657,000,114円	649,847,886円

	ダイワライフスタイル7 5	529,188,026円	515,941,191円
	DC・ダイワ・トピックス・	12,659,614,337円	11,331,795,874円
	インデックス（確定拠出年金		
	専用ファンド）		
計		141,422,704,097円	133,497,261,446円
2.	期末日における受益権の総数	141,422,704,097口	133,497,261,446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 11,000,632,750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 8,062,258,000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 579,220,000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 798,510,000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3,445,420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13,252,105円が含まれております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
-----	--------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年12月18日現在
-----	---------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	10,882,388,969	12,743,260,123
合計	10,882,388,969	12,743,260,123

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年9月20日から2019年12月18日まで、及び2020年9月24日から2020年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引



## 株式関連

種 類	2019年12月18日 現在				2020年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	598,850,000	-	606,025,000	7,175,000	1,529,106,000	-	1,561,650,000	32,544,000
合計	598,850,000	-	606,025,000	7,175,000	1,529,106,000	-	1,561,650,000	32,544,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.1306円	1.1955円
(1万口当たり純資産額)	(11,306円)	(11,955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	3,000	2,937.00	8,811,000	
日本水産	86,600	428.00	37,064,800	
マルハニチロ	12,500	2,215.00	27,687,500	
ハウスイ	400	1,021.00	408,400	
カネコ種苗	2,600	1,568.00	4,076,800	貸付株式数 100株
サカタのタネ	10,400	3,515.00	36,556,000	貸付株式数 300株
ホクト	7,000	2,119.00	14,833,000	貸付株式数 2,800株
ホクリヨウ	1,600	714.00	1,142,400	
ヒノキヤグループ	2,300	2,223.00	5,112,900	
ショーボンドHD	13,500	5,010.00	67,635,000	貸付株式数 1,700株
ミライト・ホールディングス	25,600	1,692.00	43,315,200	
タマホーム	4,800	1,449.00	6,955,200	
サンヨーホームズ	500	723.00	361,500	貸付株式数 300株
日本アクア	3,800	643.00	2,443,400	貸付株式数 1,400株
ファーストコーポレーション	2,700	722.00	1,949,400	貸付株式数 1,100株
ベステラ	1,600	1,535.00	2,456,000	貸付株式数 600株
キャンディル	1,400	508.00	711,200	

スペースバリューHD	10,900	661.00	7,204,900		
住石ホールディングス	18,400	112.00	2,060,800		
日鉄鉱業	2,000	5,680.00	11,360,000		
三井松島HLDGS	3,400	715.00	2,431,000		
国際石油開発帝石	318,400	586.00	186,582,400		
石油資源開発	11,400	1,945.00	22,173,000	貸付株式数	500株
K&Oエナジーグループ	4,200	1,493.00	6,270,600		
ダイセキ環境ソリューション	1,700	681.00	1,157,700		
第一カッター興業	1,100	2,575.00	2,832,500		
明豊ファシリティワークス	2,700	682.00	1,841,400		
安藤・間	51,500	713.00	36,719,500		
東急建設	24,900	507.00	12,624,300		
コムシスホールディングス	30,800	3,115.00	95,942,000		
ビーアールホールディングス	9,800	688.00	6,742,400		
高松コンストラクションGP	5,300	2,070.00	10,971,000	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,700	7,930.00	21,411,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	900	867.00	780,300		
ヤマウラ	3,800	943.00	3,583,400	貸付株式数	1,500株
大成建設	66,500	3,570.00	237,405,000		
大林組	199,000	898.00	178,702,000		
清水建設	201,800	780.00	157,404,000		
飛島建設	5,200	1,098.00	5,709,600		
長谷工コーポレーション	77,100	1,186.00	91,440,600		
松井建設	7,700	766.00	5,898,200		

銭高組	900	4,640.00	4,176,000	
鹿島建設	156,600	1,388.00	217,360,800	
不動テトラ	5,300	1,711.00	9,068,300	
大末建設	2,100	871.00	1,829,100	
鉄建建設	4,300	1,827.00	7,856,100	貸付株式数 700株
西松建設	15,700	2,032.00	31,902,400	貸付株式数 6,500株
三井住友建設	46,700	425.00	19,847,500	貸付株式数 11,500株
大豊建設	4,700	3,535.00	16,614,500	貸付株式数 1,900株
前田建設	49,900	938.00	46,806,200	貸付株式数 19,900株
佐田建設	4,300	455.00	1,956,500	貸付株式数 800株
ナカノフドー建設	5,100	416.00	2,121,600	貸付株式数 2,200株
奥村組	9,500	2,486.00	23,617,000	貸付株式数 300株
東鉄工業	8,500	2,746.00	23,341,000	
イチケン	1,500	1,844.00	2,766,000	
富士ピー・エス	2,900	631.00	1,829,900	貸付株式数 1,100株
浅沼組	2,200	3,950.00	8,690,000	貸付株式数 500株
戸田建設	82,500	667.00	55,027,500	貸付株式数 35,000株
熊谷組	9,100	2,507.00	22,813,700	
北野建設	1,200	2,497.00	2,996,400	
植木組	900	2,814.00	2,532,600	貸付株式数 300株
矢作建設	8,900	864.00	7,689,600	
ピーエス三菱	6,100	600.00	3,660,000	貸付株式数 2,800株
日本ハウスHLDGS	13,600	280.00	3,808,000	貸付株式数 1,400株
大東建託	21,800	9,380.00	204,484,000	
新日本建設	8,100	828.00	6,706,800	
NIPPO	16,500	2,730.00	45,045,000	貸付株式数 3,600株
東亜道路	1,200	3,815.00	4,578,000	

前田道路	17,800	1,719.00	30,598,200	貸付株式数	1,300株
日本道路	1,900	7,620.00	14,478,000		
東亜建設	6,200	1,911.00	11,848,200	貸付株式数	2,600株
日本国土開発	19,100	557.00	10,638,700		
若築建設	3,400	1,188.00	4,039,200		
東洋建設	22,200	416.00	9,235,200		
五洋建設	79,200	862.00	68,270,400		
世紀東急	9,200	838.00	7,709,600		
福 田 組	2,300	5,480.00	12,604,000	貸付株式数	900株
日本ドライケミカル	1,600	1,522.00	2,435,200	貸付株式数	500株
住友林業	50,600	2,069.00	104,691,400		
日本基礎技術	7,200	501.00	3,607,200		
巴コーポレーション	8,600	407.00	3,500,200		
大和ハウス	197,300	3,042.00	600,186,600		
ライト工業	11,400	1,793.00	20,440,200		
積水ハウス	216,400	1,995.50	431,826,200		
日特建設	5,200	792.00	4,118,400		
北陸電気工事	3,400	1,254.00	4,263,600		
ユアテック	11,100	725.00	8,047,500		
日本リーテック	4,200	2,305.00	9,681,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
四電工	1,000	2,893.00	2,893,000		
中電工	8,200	2,148.00	17,613,600		
関 電 工	27,900	801.00	22,347,900		
きんでん	47,300	1,657.00	78,376,100		
東京エネシス	6,500	892.00	5,798,000	貸付株式数	2,500株
トーエネック	1,900	3,925.00	7,457,500		

住友電設	5,500	2,507.00	13,788,500	貸付株式数	400株
日本電設工業	11,000	2,101.00	23,111,000		
協和エクシオ	30,300	2,858.00	86,597,400		
新日本空調	5,400	2,176.00	11,750,400	貸付株式数	2,200株
日本工営	4,100	2,702.00	11,078,200	貸付株式数	400株
九電工	13,900	3,210.00	44,619,000	貸付株式数	400株
三機工業	14,400	1,185.00	17,064,000		
日揮ホールディングス	61,300	983.00	60,257,900		
中外炉工業	2,300	1,643.00	3,778,900		
ヤマト	6,200	720.00	4,464,000		
太平電業	4,900	2,374.00	11,632,600	貸付株式数	100株
高砂熱学	15,100	1,517.00	22,906,700		
三晃金属	800	2,720.00	2,176,000		
N E C ネットズエスアイ	17,800	1,841.00	32,769,800	貸付株式数	7,500株
朝日工業社	1,300	3,125.00	4,062,500		
明星工業	12,900	771.00	9,945,900		
大 気 社	9,700	2,765.00	26,820,500	貸付株式数	4,100株
ダイダン	4,800	2,820.00	13,536,000		
日比谷総合設備	6,600	1,888.00	12,460,800	貸付株式数	900株
日本製粉	18,800	1,639.00	30,813,200	貸付株式数	7,900株
日清製粉G本社	72,300	1,633.00	118,065,900		
日東富士製粉	400	6,600.00	2,640,000		
昭和産業	6,000	3,060.00	18,360,000	貸付株式数	2,400株
鳥越製粉	5,700	1,025.00	5,842,500	貸付株式数	2,400株
中部飼料	7,800	1,420.00	11,076,000		
フィード・ワン	8,800	876.00	7,708,800		
東洋精糖	900	1,222.00	1,099,800	貸付株式数	100株

日本甜菜糖	3,500	1,608.00	5,628,000	貸付株式数	700株
三井製糖	5,800	1,790.00	10,382,000	貸付株式数	2,200株
塩水港精糖	6,900	221.00	1,524,900	貸付株式数	2,100株
日新製糖	2,700	1,853.00	5,003,100	貸付株式数	1,100株
L I F U L L	22,200	383.00	8,502,600	貸付株式数	7,700株
ミクシィ	11,900	2,568.00	30,559,200		
ジェイエイシーリクルート メント	4,200	1,876.00	7,879,200		
日本M&Aセンター	46,600	6,760.00	315,016,000		
メンバーズ	1,900	2,216.00	4,210,400	貸付株式数	700株
中広	600	325.00	195,000	貸付株式数	200株
U T グループ	9,600	3,230.00	31,008,000	貸付株式数	4,000株
アイティメディア	2,600	2,328.00	6,052,800	貸付株式数	1,000株
タケエイ	6,200	1,269.00	7,867,800	貸付株式数	2,400株
E・Jホールディングス	2,400	1,023.00	2,455,200	貸付株式数	800株
ビーネックスグループ	7,800	1,127.00	8,790,600		
コシダカホールディングス	15,200	439.00	6,672,800	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,500	928.00	1,392,000		
パソナグループ	6,700	2,214.00	14,833,800	貸付株式数	2,800株
C D S	1,500	1,400.00	2,100,000	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーショ ン	11,500	594.00	6,831,000	貸付株式数	5,600株
G C A	7,800	746.00	5,818,800	貸付株式数	3,100株
エス・エム・エス	19,000	3,790.00	72,010,000		
サニーサイドアップG	2,100	647.00	1,358,700	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	60,800	2,045.00	124,336,000		
リニカル	2,900	729.00	2,114,100		

クックパッド	21,000	324.00	6,804,000	貸付株式数	8,600株
エスクリ	2,000	329.00	658,000	貸付株式数	200株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	635.00	1,968,500		
森永製菓	15,100	3,860.00	58,286,000	貸付株式数	1,500株
中村屋	1,700	4,020.00	6,834,000		
江崎グリコ	17,700	4,640.00	82,128,000		
名糖産業	3,100	1,510.00	4,681,000	貸付株式数	1,300株
井村屋グループ	3,700	2,627.00	9,719,900		
不二家	3,800	2,462.00	9,355,600	貸付株式数	1,500株
山崎製パン	48,200	1,765.00	85,073,000	貸付株式数	19,800株
第一屋製パン	1,300	1,005.00	1,306,500	貸付株式数	500株
モロゾフ	1,100	5,940.00	6,534,000		
亀田製菓	3,600	4,825.00	17,370,000	貸付株式数	1,000株
寿スピリッツ	6,200	5,160.00	31,992,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	29,400	3,060.00	89,964,000		
森永乳業	11,900	5,050.00	60,095,000		
六甲バター	4,400	1,907.00	8,390,800	貸付株式数	1,400株
ヤクルト	44,000	5,260.00	231,440,000		
明治ホールディングス	42,300	7,180.00	303,714,000		
雪印メグミルク	15,600	2,196.00	34,257,600	貸付株式数	4,900株
プリマハム	10,100	3,210.00	32,421,000	貸付株式数	3,800株
日本ハム	24,400	4,660.00	113,704,000		
林兼産業	1,600	599.00	958,400		
丸大食品	7,000	1,719.00	12,033,000	貸付株式数	1,500株
S Foods	5,200	3,345.00	17,394,000		
柿安本店	2,200	2,567.00	5,647,400	貸付株式数	900株 (400株)



伊藤ハム米久HLDGS	41,500	695.00	28,842,500		
学情	2,300	1,394.00	3,206,200		
スタジオアリス	3,200	1,998.00	6,393,600	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,800	1,220.00	2,196,000	貸付株式数	700株
シミックホールディングス	3,200	1,341.00	4,291,200	貸付株式数	1,200株
エプコ	1,300	1,008.00	1,310,400		
システナ	22,300	2,153.00	48,011,900	貸付株式数	3,400株
NJS	1,400	2,076.00	2,906,400	貸付株式数	400株
デジタルアーツ	3,100	9,050.00	28,055,000	貸付株式数	1,100株
日鉄ソリューションズ	9,300	2,948.00	27,416,400		
総合警備保障	24,200	5,250.00	127,050,000		
キューブシステム	3,500	1,295.00	4,532,500	貸付株式数	1,400株
いちご	79,700	309.00	24,627,300		
エイジア	1,300	1,970.00	2,561,000	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	61,800	154.00	9,517,200		
コア	2,500	1,431.00	3,577,500		
カカコム	45,100	2,924.00	131,872,400	貸付株式数	2,300株
アイロムグループ	2,400	1,712.00	4,108,800	貸付株式数	900株 (100株)
セントケア・ホールディング	4,000	871.00	3,484,000	貸付株式数	1,600株
サイネックス	1,100	684.00	752,400		
ルネサンス	3,500	928.00	3,248,000	貸付株式数	1,400株
ディップ	8,500	2,831.00	24,063,500	貸付株式数	3,600株
SBSホールディングス	4,800	2,571.00	12,340,800		
デジタルホールディングス	3,800	1,821.00	6,919,800		
新日本科学	6,900	663.00	4,574,700	貸付株式数	2,700株

ツクイホールディングス	14,300	553.00	7,907,900		
キャリアデザインセンター	1,700	978.00	1,662,600		
ベネフィット・ワン	22,200	3,075.00	68,265,000		
エムスリー	134,200	9,345.00	1,254,099,000		
ツカダ・グローバルHOLD	4,000	265.00	1,060,000	貸付株式数	1,600株
プラス	700	565.00	395,500	貸付株式数	200株
アウトソーシング	34,900	1,450.00	50,605,000	貸付株式数	14,800株
ウェルネット	6,600	468.00	3,088,800	貸付株式数	2,600株
ワールドホールディングス	2,100	2,095.00	4,399,500	貸付株式数	100株 (100株)
ディー・エヌ・エー	26,000	1,901.00	49,426,000		
博報堂DYHLDGS	84,000	1,406.00	118,104,000		
ぐるなび	11,200	532.00	5,958,400	貸付株式数	100株
タカミヤ	6,400	517.00	3,308,800		
ジャパンベストレスキューS	4,800	894.00	4,291,200	貸付株式数	2,000株
ファンコミュニケーションズ	16,800	432.00	7,257,600	貸付株式数	5,200株
ライク	2,100	2,042.00	4,288,200	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	3,000	443.00	1,329,000		
エスプール	15,900	733.00	11,654,700	貸付株式数	6,600株
WDBホールディングス	2,800	2,834.00	7,935,200		
手間いらず	400	5,170.00	2,068,000	貸付株式数	100株
ティア	3,600	408.00	1,468,800		
CDG	600	1,575.00	945,000		
バリューコマース	4,100	3,320.00	13,612,000	貸付株式数	100株

インフォマート	61,700	926.00	57,134,200	貸付株式数	27,600株
サッポロホールディングス	21,600	2,079.00	44,906,400		
アサヒグループホールディングン	139,400	4,253.00	592,868,200	貸付株式数	55,400株
キリンHD	270,700	2,424.50	656,312,150		
宝ホールディングス	47,500	1,270.00	60,325,000	貸付株式数	3,500株
オエノンホールディングス	18,000	396.00	7,128,000	貸付株式数	7,200株
養命酒	2,000	1,900.00	3,800,000	貸付株式数	800株
コカ・コーラボトラーズJHD	49,100	1,626.00	79,836,600		
サントリー食品インター	42,800	3,800.00	162,640,000		
ダイドーグループHD	3,400	5,650.00	19,210,000	貸付株式数	1,300株
伊藤園	19,400	6,530.00	126,682,000	貸付株式数	8,200株
キーコーヒー	6,400	2,149.00	13,753,600	貸付株式数	2,600株
ユニカフェ	1,600	1,210.00	1,936,000	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	900	1,236.00	1,112,400		
日清オイリオグループ	8,400	3,040.00	25,536,000		
不二製油グループ	15,700	2,913.00	45,734,100	貸付株式数	3,600株
かどや製油	700	3,925.00	2,747,500		
J-オイルミルズ	3,400	3,500.00	11,900,000		
ローソン	15,800	4,690.00	74,102,000	貸付株式数	6,700株
サンエー	5,100	4,220.00	21,522,000	貸付株式数	2,200株
カワチ薬品	4,900	2,988.00	14,641,200	貸付株式数	1,100株
エービーシー・マート	9,700	5,440.00	52,768,000		
ハードオフコーポレーション	2,400	714.00	1,713,600		
高千穂交易	2,400	1,193.00	2,863,200	貸付株式数	800株

アスクル	6,600	3,940.00	26,004,000	貸付株式数	2,700株
ゲオホールディングス	11,600	1,249.00	14,488,400		
アダストリア	8,800	1,902.00	16,737,600		
ジーフット	3,200	411.00	1,315,200	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	402.00	402,000	貸付株式数	400株
カワニシホールディングス	700	1,460.00	1,022,000		
伊藤忠食品	1,600	5,500.00	8,800,000	貸付株式数	200株
くら寿司	3,700	6,400.00	23,680,000	貸付株式数	1,400株
キャンドゥ	3,100	1,894.00	5,871,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,600	1,016.00	5,689,600		
パルグループHLDGS	6,400	1,198.00	7,667,200		
JALUX	1,800	1,346.00	2,422,800	貸付株式数	700株
エディオン	28,500	1,006.00	28,671,000	貸付株式数	12,300株 (400株)
あらた	5,000	5,060.00	25,300,000		
サーラコーポレーション	12,300	573.00	7,047,900	貸付株式数	2,200株
ワッツ	2,800	821.00	2,298,800	貸付株式数	100株
トーマンデバイス	900	3,335.00	3,001,500		
ハローズ	2,300	3,620.00	8,326,000	貸付株式数	900株
J Pホールディングス	18,900	297.00	5,613,300	貸付株式数	8,000株
フジオフードG本社	5,100	1,357.00	6,920,700	貸付株式数	2,200株
あみやき亭	1,400	2,848.00	3,987,200	貸付株式数	500株
東京エレクトロニクスデバイス	2,300	3,115.00	7,164,500		
ひらまつ	11,800	168.00	1,982,400	貸付株式数	1,100株
フィールズ	4,900	494.00	2,420,600		
双日	344,300	235.00	80,910,500		

アルフレッサホールディングス	69,600	2,011.00	139,965,600	
大黒天物産	1,500	5,940.00	8,910,000	貸付株式数 600株
ハニーズホールディングス	5,600	968.00	5,420,800	貸付株式数 2,200株
ファーマライズHD	1,500	783.00	1,174,500	貸付株式数 600株
キッコーマン	46,000	6,530.00	300,380,000	
味の素	141,100	2,323.00	327,775,300	
キューピー	35,800	2,195.00	78,581,000	貸付株式数 14,900株
ハウス食品G本社	23,900	3,805.00	90,939,500	
カゴメ	26,200	3,725.00	97,595,000	
焼津水産化工	3,200	1,017.00	3,254,400	
アリアケジャパン	5,900	7,120.00	42,008,000	貸付株式数 1,000株
ピエトロ	700	1,715.00	1,200,500	貸付株式数 300株
エバラ食品工業	1,500	2,428.00	3,642,000	貸付株式数 500株
やまみ	600	2,156.00	1,293,600	
ニチレイ	30,600	2,794.00	85,496,400	
横浜冷凍	16,200	867.00	14,045,400	
東洋水産	33,100	4,980.00	164,838,000	貸付株式数 5,100株
イートアンドHLDGS	2,200	1,847.00	4,063,400	貸付株式数 800株
大冷	800	1,978.00	1,582,400	
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,800	809.00	3,074,200	貸付株式数 1,400株 (800株)
日清食品HD	27,200	8,580.00	233,376,000	
永谷園ホールディングス	3,200	2,292.00	7,334,400	
一正蒲鉾	2,600	1,210.00	3,146,000	
フジッコ	7,300	2,044.00	14,921,200	
ロックフィールド	7,300	1,625.00	11,862,500	貸付株式数 500株

日本たばこ産業	342,400	2,213.50	757,902,400	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	3,600	1,916.00	6,897,600	貸付株式数	1,500株
わらべや日洋HD	4,400	1,450.00	6,380,000		
なとり	3,600	1,916.00	6,897,600		
イフジ産業	1,000	839.00	839,000	貸付株式数	100株
ピックルスコーポレーション	1,500	3,200.00	4,800,000		
北の達人コーポ	22,600	484.00	10,938,400	貸付株式数	9,500株
ユーグレナ	27,800	807.00	22,434,600	貸付株式数	11,700株
スター・マイカ・HLDGS	3,200	1,394.00	4,460,800	貸付株式数	700株
ADワークスグループ	12,300	166.00	2,041,800		
片倉工業	8,200	1,373.00	11,258,600	貸付株式数	3,500株
グンゼ	4,600	3,500.00	16,100,000		
ヒューリック	132,700	1,092.00	144,908,400		
神栄	1,000	961.00	961,000	貸付株式数	300株
ラサ商事	3,300	925.00	3,052,500		
アルペン	5,100	2,460.00	12,546,000	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	564.00	1,071,600	貸付株式数	600株
ラクーンホールディングス	3,200	1,827.00	5,846,400	貸付株式数	1,200株
クオールホールディングス	9,300	1,136.00	10,564,800	貸付株式数	3,700株
アルコニックス	6,800	1,475.00	10,030,000		
神戸物産	43,300	3,235.00	140,075,500	貸付株式数	18,400株
ソリトンシステムズ	3,100	1,883.00	5,837,300	貸付株式数	400株
ジズホールディングス	3,300	6,900.00	22,770,000	貸付株式数	1,400株
ビックカメラ	37,000	1,122.00	41,514,000	貸付株式数	15,900株
DCMホールディングス	38,400	1,175.00	45,120,000		

ペッパーフードサービス	5,700	300.00	1,710,000	貸付株式数	2,200株 (300株)
ハイパー	900	598.00	538,200		
Monotaro	44,700	5,370.00	240,039,000		
東京一番フーズ	1,000	553.00	553,000	貸付株式数	600株 (600株)
DDホールディングス	2,700	557.00	1,503,900	貸付株式数	1,000株
あいホールディングス	9,000	2,101.00	18,909,000	貸付株式数	800株
ディーブイエックス	2,300	1,024.00	2,355,200		
きちりホールディングス	1,300	658.00	855,400	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,900	2,246.00	11,005,400	貸付株式数	1,900株
J. フロントリテイリング	74,900	852.00	63,814,800		
ドトール・日レスHD	9,100	1,533.00	13,950,300	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシHLDGS	25,900	4,550.00	117,845,000		
ブロンコビリー	3,300	2,417.00	7,976,100	貸付株式数	1,400株
ZOZO	43,200	2,539.00	109,684,800	貸付株式数	15,100株
トレジャー・ファクトリー	1,900	686.00	1,303,400	貸付株式数	400株
物語コーポレーション	1,700	12,760.00	21,692,000	貸付株式数	700株 (100株)
ココカラファイン	6,500	7,640.00	49,660,000		
三越伊勢丹HD	109,900	615.00	67,588,500	貸付株式数	42,000株
東洋紡	24,700	1,395.00	34,456,500		
ユニチカ	18,400	402.00	7,396,800	貸付株式数	7,900株
富士紡ホールディングス	3,000	3,715.00	11,145,000		
日清紡ホールディングス	38,600	783.00	30,223,800		
倉敷紡績	6,400	1,890.00	12,096,000	貸付株式数	1,200株

ダイワボウHD	5,400	8,600.00	46,440,000		
シキボウ	3,700	1,048.00	3,877,600	貸付株式数	500株
日東紡績	9,500	4,390.00	41,705,000	貸付株式数	4,000株
トヨタ紡織	18,500	1,723.00	31,875,500		
マクニカ・富士エレHLD GS	14,900	1,972.00	29,382,800		
Hamee	2,400	2,012.00	4,828,800	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	2,600	2,904.00	7,550,400	貸付株式数	1,000株
ウエルシアHD	37,300	3,880.00	144,724,000		
クリエイトSDH	10,500	3,735.00	39,217,500		
バイタルKSKHD	11,700	847.00	9,909,900		
八洲電機	4,300	974.00	4,188,200	貸付株式数	100株
メディアスホールディング ス	3,500	794.00	2,779,000		
レスターホールディングス	6,400	2,165.00	13,856,000		
ジューテックHD	1,200	1,006.00	1,207,200	貸付株式数	100株
丸善CHI HD	4,900	372.00	1,822,800	貸付株式数	2,800株
大光	2,800	670.00	1,876,000	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	1,900	1,303.00	2,475,700	貸付株式数	700株
TOKAIホールディング ス	32,500	1,003.00	32,597,500	貸付株式数	3,200株
黒谷	1,600	728.00	1,164,800		
ミサワ	1,500	650.00	975,000	貸付株式数	500株
ティーライフ	900	1,172.00	1,054,800		
Cominix	600	732.00	439,200	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディング ス	1,000	399.00	399,000	貸付株式数	400株



三洋貿易	6,500	976.00	6,344,000		
チムニー	2,000	1,203.00	2,406,000	貸付株式数	800株
シュッピン	4,500	851.00	3,829,500		
ビューティガレージ	1,100	2,818.00	3,099,800	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	6,300	3,155.00	19,876,500	貸付株式数	2,600株
ウイン・パートナーズ	4,400	1,240.00	5,456,000		
ネクステージ	10,500	1,327.00	13,933,500	貸付株式数	4,200株
ジョイフル本田	18,400	1,434.00	26,385,600	貸付株式数	7,700株
鳥貴族	2,000	1,440.00	2,880,000	貸付株式数	700株
キリン堂ホールディングス	1,300	3,480.00	4,524,000		
ホットランド	4,400	1,308.00	5,755,200	貸付株式数	1,800株
すかいらくHD	70,300	1,638.00	115,151,400	貸付株式数	29,700株 (2,800株)
SFPホールディングス	3,700	1,259.00	4,658,300	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	4,700	1,336.00	6,279,200	貸付株式数	300株
日本毛織	20,200	1,008.00	20,361,600		
ダイトウボウ	12,100	105.00	1,270,500	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,400	471.00	1,130,400	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテッド	8,900	188.00	1,673,200		
ヨシックス	1,000	1,886.00	1,886,000		
ユナイテッド・スーパー マーケ	18,200	1,124.00	20,456,800	貸付株式数	7,700株
三栄建築設計	2,500	1,745.00	4,362,500		
野村不動産HLDGS	37,800	2,277.00	86,070,600		
三重交通グループHD	13,100	468.00	6,130,800	貸付株式数	3,500株
サムティ	8,800	1,740.00	15,312,000	貸付株式数	3,700株
日本商業開発	4,000	1,736.00	6,944,000	貸付株式数	1,600株

プレサンスコーポレーション	11,000	1,748.00	19,228,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	1,986.00	2,383,200	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,341.00	1,206,900		
日本管理センター	3,500	1,215.00	4,252,500		
サンセイランディック	2,000	746.00	1,492,000		
エストラスト	500	714.00	357,000	貸付株式数	300株
フージャースHD	12,400	716.00	8,878,400	貸付株式数	5,200株
オープンハウス	19,700	3,775.00	74,367,500		
東急不動産HD	169,500	515.00	87,292,500		
飯田GHD	52,200	2,163.00	112,908,600		
イーグランド	800	800.00	640,000		
帝国繊維	7,000	2,539.00	17,773,000	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	56,000	72.00	4,032,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	922.00	2,673,800	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	1,400	609.00	852,600	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,000	2,838.00	8,514,000	貸付株式数	200株
あさひ	4,900	1,690.00	8,281,000	貸付株式数	1,200株
日本調剤	3,700	1,520.00	5,624,000		
コスモス薬品	5,600	16,870.00	94,472,000	貸付株式数	2,000株
シップヘルスケアHD	10,000	5,510.00	55,100,000	貸付株式数	4,200株
トーエル	2,800	822.00	2,301,600	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトHD	2,800	2,870.00	8,036,000	貸付株式数	1,100株
オンリー	1,100	445.00	489,500	貸付株式数	300株
セブン&アイ・HLDGS	245,000	3,595.00	880,775,000		
クリエイト・レストランツ・ホール	33,700	604.00	20,354,800	貸付株式数	14,400株 (800株)

明治電機工業	1,900	1,478.00	2,808,200	貸付株式数	800株
ツルハホールディングス	13,700	15,330.00	210,021,000		
デリカフーズHLDGS	2,200	670.00	1,474,000		
スターティアホールディングス	1,700	885.00	1,504,500	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,200	1,422.00	7,394,400		
フェリシモ	1,400	1,424.00	1,993,600	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	15,500	1,381.00	21,405,500	貸付株式数	6,100株 (4,500株)
帝人	50,700	1,936.00	98,155,200		
東レ	450,700	612.70	276,143,890		
クラレ	98,400	1,132.00	111,388,800		
旭化成	412,600	1,037.50	428,072,500	貸付株式数	5,600株
サカイオーベックス	1,600	2,121.00	3,393,600		
TOKYO BASE	6,000	513.00	3,078,000	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,200	1,413.00	4,521,600	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,000	2,491.00	4,982,000	貸付株式数	700株
トーカロ	17,500	1,386.00	24,255,000	貸付株式数	2,200株
アルファCO	2,200	1,009.00	2,219,800		
SUMCO	80,700	2,171.00	175,199,700	貸付株式数	30,700株
川田テクノロジーズ	1,300	4,245.00	5,518,500		
RS TECHNOLOGIES	1,900	5,000.00	9,500,000		
信和	3,600	693.00	2,494,800		
ビーロット	3,100	690.00	2,139,000	貸付株式数	1,200株
ファーストブラザーズ	1,100	937.00	1,030,700	貸付株式数	500株

ハウスドゥ	3,000	1,225.00	3,675,000	貸付株式数	1,200株
シーアールイー	1,500	1,247.00	1,870,500	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,000	1,443.00	1,443,000		
ケイアイスター不動産	2,100	2,592.00	5,443,200		
アグレ都市デザイン	1,400	650.00	910,000	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,200	3,225.00	3,870,000		
テンポイノベーション	1,600	824.00	1,318,400	貸付株式数	100株
グローバルリンクマネジメン ト	1,200	902.00	1,082,400	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	2,238.00	3,133,200	貸付株式数	400株
日本フェルト	3,200	452.00	1,446,400		
イチカワ	900	1,291.00	1,161,900		
エコナックホールディング ス	13,500	91.00	1,228,500		
日東製網	700	1,463.00	1,024,100	貸付株式数	200株
芦森工業	1,300	988.00	1,284,400	貸付株式数	500株
アツギ	5,300	540.00	2,862,000		
ウイルプラスHLDGS	800	703.00	562,400		
JMホールディングス	4,700	2,289.00	10,758,300	貸付株式数	1,300株
コメダホールディングス	13,600	1,845.00	25,092,000	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	800	2,030.00	1,624,000		
アレンザホールディングス	3,200	1,276.00	4,083,200	貸付株式数	300株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,300	1,521.00	1,977,300	貸付株式数	500株 (400株)
パロックジャパン	4,000	670.00	2,680,000		
クスリのアオキHLDGS	5,600	9,110.00	51,016,000	貸付株式数	2,300株

ダイニツク	2,200	881.00	1,938,200	貸付株式数	100株
共和レザー	3,300	677.00	2,234,100		
ピーバンドットコム	600	911.00	546,600		
力の源HD	2,800	554.00	1,551,200	貸付株式数	600株
スシログローバルHLDGS	34,400	3,650.00	125,560,000		
アセンテック	1,400	1,943.00	2,720,200	貸付株式数	200株
セーレン	15,400	1,639.00	25,240,600	貸付株式数	6,400株
ソトー	2,400	898.00	2,155,200		
東海染工	900	1,124.00	1,011,600	貸付株式数	200株
小松マテーレ	10,200	955.00	9,741,000	貸付株式数	1,100株
ワコールホールディングス	15,600	2,078.00	32,416,800	貸付株式数	500株
ホギメディカル	7,200	3,370.00	24,264,000		
クラウドディアHLDGS	1,700	289.00	491,300	貸付株式数	600株
T S Iホールディングス	20,700	212.00	4,388,400		
マツオカコーポレーション	1,800	2,326.00	4,186,800	貸付株式数	700株
ワールド	8,800	1,276.00	11,228,800		
T I S	62,200	2,023.00	125,830,600		
J N Sホールディングス	2,800	561.00	1,570,800	貸付株式数	1,000株
電算システム	2,400	3,225.00	7,740,000	貸付株式数	900株
グリー	40,400	589.00	23,795,600	貸付株式数	16,100株
コーエーテクモHD	12,800	6,460.00	82,688,000		
三菱総合研究所	2,600	4,185.00	10,881,000		
ボルテージ	1,900	552.00	1,048,800	貸付株式数	600株
電算	600	2,445.00	1,467,000	貸付株式数	200株
A G S	3,300	898.00	2,963,400		
ファインデックス	5,400	1,295.00	6,993,000	貸付株式数	2,100株

ブレインパッド	1,700	4,510.00	7,667,000	貸付株式数	600株
K L a b	11,500	988.00	11,362,000	貸付株式数	4,700株
ポルトゥウィン・ピット クル	7,800	1,120.00	8,736,000	貸付株式数	3,200株
イーブックイニシアティブ	900	2,693.00	2,423,700	貸付株式数	300株
ネクソン	157,600	3,420.00	538,992,000		
アイスタイル	18,400	401.00	7,378,400	貸付株式数	5,700株
エムアップホールディング ス	1,900	2,636.00	5,008,400		
エイチーム	4,500	1,141.00	5,134,500	貸付株式数	1,800株
エニグモ	6,100	1,332.00	8,125,200	貸付株式数	2,400株
テクノスジャパン	5,300	702.00	3,720,600		
e n i s h	3,500	468.00	1,638,000	貸付株式数	200株
コロプラ	20,400	983.00	20,053,200	貸付株式数	8,700株 (8,700株)
オルトプラス	4,000	420.00	1,680,000	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	31,200	718.00	22,401,600	貸付株式数	13,100株
クロス・マーケティングG	2,800	374.00	1,047,200		
デジタルハーツH L D G S	3,400	1,237.00	4,205,800	貸付株式数	1,400株
システム情報	4,900	1,092.00	5,350,800	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,100	7,360.00	15,456,000	貸付株式数	800株
じげん	16,000	377.00	6,032,000		
ブイキューブ	3,400	3,175.00	10,795,000	貸付株式数	1,400株
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	796.00	1,034,800	貸付株式数	500株
サイバーリンクス	1,100	5,620.00	6,182,000	貸付株式数	400株
ディー・エル・イー	4,300	311.00	1,337,300		
フィックスターズ	6,600	971.00	6,408,600	貸付株式数	2,800株

CARTA HOLDINGS	2,600	1,221.00	3,174,600	貸付株式数	1,200株
オプティム	3,400	2,853.00	9,700,200	貸付株式数	1,300株
セレス	2,200	2,878.00	6,331,600	貸付株式数	800株
SHIFT	2,700	14,110.00	38,097,000	貸付株式数	1,000株
特種東海製紙	3,800	5,170.00	19,646,000	貸付株式数	300株
ティーガイア	5,500	1,832.00	10,076,000		
セック	900	2,938.00	2,644,200		
日本アジアグループ	7,300	742.00	5,416,600	貸付株式数	2,900株
テクマトリックス	9,000	2,066.00	18,594,000	貸付株式数	500株
プロシップ	1,700	1,518.00	2,580,600	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	15,100	2,767.00	41,781,700	貸付株式数	1,300株
GMOペイメントゲートウェイ	13,200	13,600.00	179,520,000	貸付株式数	2,100株
ザッパラス	2,900	513.00	1,487,700	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,700	1,671.00	2,840,700	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	9,400	4,075.00	38,305,000		
さくらインターネット	7,000	702.00	4,914,000	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,900	1,213.00	2,304,700	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,400	9,230.00	12,922,000	貸付株式数	500株 (400株)
SRAホールディングス	3,200	2,534.00	8,108,800		
システムインテグレータ	2,200	655.00	1,441,000		
朝日ネット	4,700	870.00	4,089,000		
eBASE	7,600	1,016.00	7,721,600	貸付株式数	3,100株

アバント	6,100	1,153.00	7,033,300	貸付株式数	2,500株
アドソル日進	2,300	3,015.00	6,934,500		
フリービット	3,700	982.00	3,633,400	貸付株式数	1,300株
コムチュア	7,100	2,926.00	20,774,600	貸付株式数	400株
サイバーコム	1,100	1,730.00	1,903,000	貸付株式数	400株
アステリア	4,100	1,122.00	4,600,200	貸付株式数	1,600株
アイル	3,600	1,499.00	5,396,400	貸付株式数	1,200株
王子ホールディングス	260,300	592.00	154,097,600		
日本製紙	27,800	1,205.00	33,499,000	貸付株式数	11,700株
三菱製紙	6,200	327.00	2,027,400		
北越コーポレーション	37,900	388.00	14,705,200		
中越パルプ	2,600	1,330.00	3,458,000		
巴川製紙	2,100	806.00	1,692,600		
大王製紙	29,900	1,936.00	57,886,400	貸付株式数	200株
阿波製紙	1,700	490.00	833,000		
マークラインズ	2,800	2,653.00	7,428,400	貸付株式数	200株
メディカル・データ・ビジ	7,200	2,718.00	19,569,600	貸付株式数	2,900株
g u m i	8,300	865.00	7,179,500	貸付株式数	3,300株
ショーケース	1,600	989.00	1,582,400	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	1,002.00	1,603,200	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,300	4,200.00	9,660,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,600	1,551.00	4,032,600	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	2,500	1,682.00	4,205,000	貸付株式数	1,000株
パイプドHD	900	1,624.00	1,461,600	貸付株式数	200株 (200株)
アイビーシー	1,200	1,110.00	1,332,000	貸付株式数	400株



ネオジャパン	1,200	2,307.00	2,768,400	貸付株式数	400株
P R T I M E S	1,200	3,275.00	3,930,000	貸付株式数	400株
ランドコンピュータ	700	1,135.00	794,500	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,160.00	3,744,000	貸付株式数	300株
オープンドア	3,300	1,276.00	4,210,800	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	891.00	1,871,100	貸付株式数	800株
アカツキ	2,300	4,345.00	9,993,500		
ベネフィットジャパン	500	1,741.00	870,500		
UBICOMホールディングス	1,500	3,505.00	5,257,500		
カナミックネットワーク	6,000	759.00	4,554,000		
ノムラシステムコーポレーション	3,100	374.00	1,159,400	貸付株式数	1,100株
レンゴー	59,000	851.00	50,209,000		
トーモク	3,700	1,732.00	6,408,400	貸付株式数	1,600株
ザ・パック	4,700	2,825.00	13,277,500	貸付株式数	1,900株
チェンジ	4,400	7,960.00	35,024,000		
シンクロ・フード	2,700	307.00	828,900	貸付株式数	400株
オークネット	3,500	1,451.00	5,078,500	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	1,300	1,358.00	1,765,400		
エイトレッド	1,100	2,654.00	2,919,400	貸付株式数	100株
AOI TYO HOLDINGS	6,700	435.00	2,914,500	貸付株式数	2,500株
マクロミル	12,800	682.00	8,729,600	貸付株式数	5,200株
ビーグリー	1,300	1,873.00	2,434,900	貸付株式数	500株
オロ	1,900	4,480.00	8,512,000	貸付株式数	700株
ユーザーローカル	600	3,845.00	2,307,000		

テモナ	1,300	1,099.00	1,428,700	貸付株式数	300株
ニーズウェル	1,000	684.00	684,000		
サインポスト	1,300	878.00	1,141,400	貸付株式数	500株
昭和電工	47,400	2,242.00	106,270,800		
住友化学	457,100	405.00	185,125,500		
住友精化	2,800	3,985.00	11,158,000		
日産化学	34,400	6,130.00	210,872,000		
ラサ工業	2,300	2,258.00	5,193,400	貸付株式数	800株
クレハ	5,300	6,660.00	35,298,000	貸付株式数	100株
多木化学	2,400	6,660.00	15,984,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,500	1,546.00	6,957,000		
石原産業	11,300	639.00	7,220,700		
片倉コープアグリ	1,600	1,225.00	1,960,000		
日本曹達	9,200	3,030.00	27,876,000		
東ソー	96,300	1,659.00	159,761,700		
トクヤマ	17,900	2,302.00	41,205,800		
セントラル硝子	12,500	2,255.00	28,187,500	貸付株式数	400株
東亜合成	39,200	1,256.00	49,235,200	貸付株式数	400株
大阪ソーダ	6,200	2,669.00	16,547,800		
関東電化	14,800	793.00	11,736,400		
デンカ	22,800	3,945.00	89,946,000		
イビデン	39,000	4,995.00	194,805,000		
信越化学	107,000	17,090.00	1,828,630,000		
日本カ - バイド	2,100	1,285.00	2,698,500		
堺化学	4,000	2,003.00	8,012,000	貸付株式数	600株
第一稀元素化学工	7,000	779.00	5,453,000	貸付株式数	1,000株
エア・ウォーター	57,900	1,829.00	105,899,100		

日本酸素HLDGS	59,700	1,955.00	116,713,500		
日本化学工業	1,900	2,597.00	4,934,300		
東邦アセチレン	800	1,481.00	1,184,800		
日本パ - カライジング	31,200	1,113.00	34,725,600	貸付株式数	5,500株
高圧ガス	9,500	803.00	7,628,500		
チタン工業	900	2,083.00	1,874,700	貸付株式数	300株
四国化成	9,000	1,239.00	11,151,000		
戸田工業	1,500	2,293.00	3,439,500	貸付株式数	500株
ステラ ケミファ	3,500	3,305.00	11,567,500	貸付株式数	1,400株 (100株)
保土谷化学	2,400	4,520.00	10,848,000		
日本触媒	9,700	5,600.00	54,320,000		
大日精化	5,400	2,356.00	12,722,400		
カネカ	16,100	3,605.00	58,040,500		
協和キリン	63,900	2,638.00	168,568,200		
三菱瓦斯化学	58,100	2,329.00	135,314,900		
三井化学	57,800	2,966.00	171,434,800		
J S R	58,100	2,743.00	159,368,300		
東京応化工業	10,700	7,200.00	77,040,000	貸付株式数	4,500株 (100株)
大阪有機化学	5,900	3,110.00	18,349,000		
三菱ケミカルHLDGS	416,800	641.70	267,460,560		
KHネオケム	10,200	2,785.00	28,407,000		
ダイセル	78,400	742.00	58,172,800	貸付株式数	28,100株
住友ベ - クライト	9,800	3,500.00	34,300,000	貸付株式数	4,000株
積水化学	131,400	1,941.00	255,047,400		

日本ゼオン	56,100	1,415.00	79,381,500	貸付株式数 23,700株 (23,700株)
アイカ工業	18,700	3,545.00	66,291,500	
宇部興産	31,500	1,896.00	59,724,000	
積水樹脂	11,100	2,162.00	23,998,200	貸付株式数 2,200株
タキロンシーアイ	13,600	697.00	9,479,200	貸付株式数 400株
旭有機材	3,500	1,580.00	5,530,000	
ニチバン	3,300	1,654.00	5,458,200	貸付株式数 100株
リケンテクノス	15,500	472.00	7,316,000	
大倉工業	2,900	1,924.00	5,579,600	貸付株式数 1,200株
積水化成品	8,500	540.00	4,590,000	
群栄化学	1,400	2,427.00	3,397,800	
タイガース ポリマー	3,400	404.00	1,373,600	
ミライアル	2,200	1,145.00	2,519,000	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,400	1,164.00	2,793,600	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	13,100	843.00	11,043,300	貸付株式数 5,100株
竹本容器	2,200	997.00	2,193,400	貸付株式数 800株
森六ホールディングス	3,400	2,250.00	7,650,000	
日本化薬	38,600	966.00	37,287,600	
カーリットホールディングス	6,600	673.00	4,441,800	貸付株式数 2,700株
E P Sホールディングス	8,500	1,008.00	8,568,000	貸付株式数 3,000株
ソルクシーズ	2,600	1,018.00	2,646,800	貸付株式数 1,000株
レグス	1,600	1,897.00	3,035,200	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	22,900	903.00	20,678,700	
フェイス	2,300	790.00	1,817,000	
プロトコーポレーション	5,700	1,073.00	6,116,100	

ハイマックス	1,600	1,172.00	1,875,200	
アミューズ	3,300	2,660.00	8,778,000	
野村総合研究所	88,500	3,530.00	312,405,000	
ドリームインキュベータ	1,800	1,403.00	2,525,400	
サイバネットシステム	4,600	968.00	4,452,800	
クイック	3,800	1,121.00	4,259,800	
T A C	4,000	259.00	1,036,000	
C E ホールディングス	3,600	589.00	2,120,400	貸付株式数 1,300株
ケネディクス	55,800	748.00	41,738,400	
日本システム技術	1,100	1,523.00	1,675,300	
電通グループ	68,300	3,265.00	222,999,500	貸付株式数 25,200株
インテージホールディングス	7,900	1,105.00	8,729,500	貸付株式数 3,300株
テイクアンドギヴニーズ	2,400	600.00	1,440,000	貸付株式数 900株
東邦システムサイエンス	1,300	930.00	1,209,000	
ぴあ	1,800	2,659.00	4,786,200	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	2,400	2,394.00	5,745,600	貸付株式数 900株
ソースネクスト	30,000	290.00	8,700,000	貸付株式数 12,500株
シーティーエス	7,100	1,038.00	7,369,800	貸付株式数 2,900株
ネクシィーズグループ	2,000	896.00	1,792,000	貸付株式数 800株
インフォコム	6,900	3,265.00	22,528,500	貸付株式数 2,800株
メディカルシステムネットワーク	6,200	652.00	4,042,400	
日本精化	5,100	1,489.00	7,593,900	貸付株式数 200株
扶桑化学工業	6,400	3,715.00	23,776,000	
トリケミカル	1,400	14,950.00	20,930,000	

HEROZ	900	2,609.00	2,348,100	貸付株式数	300株 (300株)
ラクスル	5,100	4,320.00	22,032,000	貸付株式数	2,100株
FIG	6,000	295.00	1,770,000	貸付株式数	2,600株
システムサポート	1,400	1,704.00	2,385,600	貸付株式数	200株
ADEKA	28,600	1,796.00	51,365,600		
日油	23,400	5,110.00	119,574,000	貸付株式数	300株
ミヨシ油脂	2,300	1,288.00	2,962,400	貸付株式数	900株
新日本理化	10,700	262.00	2,803,400	貸付株式数	4,200株
ハリマ化成グループ	5,200	1,054.00	5,480,800	貸付株式数	1,000株
イーソル	3,100	1,298.00	4,023,800	貸付株式数	1,200株
アルテリア・ネットワークス	7,200	1,488.00	10,713,600		
東海ソフト	400	1,118.00	447,200	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,200	1,512.00	1,814,400		
トビラシステムズ	800	1,369.00	1,095,200	貸付株式数	200株
花王	152,200	7,804.00	1,187,768,800		
第一工業製薬	2,300	4,375.00	10,062,500	貸付株式数	900株
石原ケミカル	1,700	2,243.00	3,813,100	貸付株式数	700株
日華化学	2,000	966.00	1,932,000	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	3,135.00	4,389,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,700	5,030.00	18,611,000		
武田薬品	529,200	3,877.00	2,051,708,400		
アステラス製薬	551,300	1,539.50	848,726,350		
大日本住友製薬	47,000	1,326.00	62,322,000		
塩野義製薬	80,000	5,654.00	452,320,000		

わかもと製薬	7,600	267.00	2,029,200	
あすか製薬	7,300	1,761.00	12,855,300	貸付株式数 2,900株
日本新薬	16,700	6,980.00	116,566,000	
ピオフェルミン製薬	1,100	2,467.00	2,713,700	
中外製薬	199,000	4,908.00	976,692,000	
科研製薬	10,900	3,880.00	42,292,000	
エーザイ	76,200	7,420.00	565,404,000	
理研ビタミン	6,500	1,399.00	9,093,500	
ロート製薬	32,700	3,110.00	101,697,000	
小野薬品	146,100	3,165.00	462,406,500	
久光製薬	16,800	6,300.00	105,840,000	貸付株式数 700株
有機合成薬品	5,400	321.00	1,733,400	貸付株式数 2,000株
持田製薬	8,800	3,950.00	34,760,000	
参天製薬	118,800	1,681.00	199,702,800	
扶桑薬品	2,300	2,900.00	6,670,000	
日本ケミファ	900	2,331.00	2,097,900	
ツムラ	19,700	3,235.00	63,729,500	
日医工	18,200	1,000.00	18,200,000	貸付株式数 7,600株
テルモ	179,900	4,114.00	740,108,600	
HUグループHD	17,100	2,915.00	49,846,500	
キッセイ薬品工業	11,300	2,218.00	25,063,400	貸付株式数 800株
生化学工業	12,300	1,043.00	12,828,900	
栄研化学	11,300	2,115.00	23,899,500	
日水製薬	2,800	986.00	2,760,800	
鳥居薬品	4,000	3,350.00	13,400,000	
JCRファーマ	18,000	2,452.00	44,136,000	
東和薬品	8,000	1,869.00	14,952,000	貸付株式数 600株

富士製薬工業	4,600	1,244.00	5,722,400	貸付株式数	900株
沢井製薬	13,100	4,740.00	62,094,000		
ゼリア新薬工業	11,400	1,914.00	21,819,600	貸付株式数	4,900株
第一三共	546,100	3,333.00	1,820,151,300		
キョーリン製薬HD	14,200	1,915.00	27,193,000	貸付株式数	100株
大幸薬品	8,000	1,612.00	12,896,000	貸付株式数	3,300株
ダイト	4,100	3,765.00	15,436,500		
大塚ホールディングス	132,000	4,479.00	591,228,000	貸付株式数	3,000株
大正製薬HD	13,400	6,850.00	91,790,000		
ペプチドリーム	32,400	5,420.00	175,608,000	貸付株式数	13,800株
大日本塗料	7,000	956.00	6,692,000		
日本ペイントHOLD	51,400	11,620.00	597,268,000		
関西ペイント	70,000	3,070.00	214,900,000	貸付株式数	29,600株
神東塗料	5,800	219.00	1,270,200	貸付株式数	2,100株
中国塗料	17,800	1,012.00	18,013,600		
日本特殊塗料	4,800	1,321.00	6,340,800		
藤倉化成	8,200	549.00	4,501,800		
太陽ホールディングス	4,600	6,200.00	28,520,000		
D I C	26,200	2,625.00	68,775,000		
サカタインクス	13,300	1,197.00	15,920,100	貸付株式数	1,400株
東洋インキSCホールディングン	12,900	2,004.00	25,851,600		
T & K T O K A	4,900	907.00	4,444,300	貸付株式数	1,900株
アルプス技研	5,500	2,162.00	11,891,000		
サニックス	11,100	273.00	3,030,300	貸付株式数	4,500株
ダイオーズ	1,200	968.00	1,161,600	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,400	781.00	4,998,400		



オリエンタルランド	64,600	17,030.00	1,100,138,000	貸付株式数	4,900株
フォーカスシステムズ	3,800	927.00	3,522,600	貸付株式数	1,600株
ダスキン	15,200	2,929.00	44,520,800	貸付株式数	2,600株
パーク24	33,900	1,766.00	59,867,400	貸付株式数	14,200株
明光ネットワークジャパン	8,100	580.00	4,698,000	貸付株式数	3,200株
ファルコホールディングス	3,400	1,661.00	5,647,400		
クレスコ	3,700	1,334.00	4,935,800		
フジ・メディア・HD	59,400	1,112.00	66,052,800		
秀英予備校	1,400	425.00	595,000	貸付株式数	500株
田谷	1,200	549.00	658,800	貸付株式数	400株
ラウンドワン	17,400	940.00	16,356,000		
リゾートトラスト	27,800	1,591.00	44,229,800		
オービック	21,600	21,010.00	453,816,000		
ジャストシステム	10,200	7,290.00	74,358,000		
TDCソフト	5,400	1,031.00	5,567,400		
Zホールディングス	858,700	610.50	524,236,350		
ビー・エム・エル	7,800	3,410.00	26,598,000		
ワタベウェディング	1,000	281.00	281,000	貸付株式数	300株
トレンドマイクロ	33,400	5,750.00	192,050,000		
りらいあコミュニケーション	10,700	1,350.00	14,445,000	貸付株式数	4,200株
IDホールディングス	2,400	1,267.00	3,040,800		
リソー教育	28,100	308.00	8,654,800		
日本オラクル	12,600	12,170.00	153,342,000	貸付株式数	5,300株
早稲田アカデミー	2,800	1,005.00	2,814,000		
アルファシステムズ	1,900	3,520.00	6,688,000	貸付株式数	800株
フューチャー	7,600	1,806.00	13,725,600	貸付株式数	500株
CAC HOLDINGS	3,900	1,472.00	5,740,800	貸付株式数	1,700株

S Bテクノロジー	2,400	3,570.00	8,568,000		
トーセ	1,800	861.00	1,549,800	貸付株式数	300株
ユー・エス・エス	68,100	2,078.00	141,511,800		
オービックビジネスC	6,400	7,030.00	44,992,000		
伊藤忠テクノソリュー	28,400	3,720.00	105,648,000		
アイティフォー	7,600	950.00	7,220,000	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	2,300	649.00	1,492,700		
東計電算	900	4,465.00	4,018,500	貸付株式数	400株
サイバーエージェント	37,600	6,970.00	262,072,000		
楽天	284,000	1,013.00	287,692,000		
エックスネット	900	970.00	873,000		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,091.00	3,709,400	貸付株式数	1,300株
テー・オー・ダブリュー	10,300	274.00	2,822,200		
大塚商会	33,800	5,200.00	175,760,000		
サイボウズ	7,400	2,575.00	19,055,000	貸付株式数	100株
山田コンサルティングG P	4,100	993.00	4,071,300		
セントラルスポーツ	2,200	2,210.00	4,862,000	貸付株式数	800株
パラカ	1,400	1,600.00	2,240,000	貸付株式数	600株
電通国際情報S	3,900	6,710.00	26,169,000		
A C C E S S	6,100	762.00	4,648,200		
デジタルガレージ	11,200	4,405.00	49,336,000	貸付株式数	4,700株
イーエムシステムズ	8,800	864.00	7,603,200	貸付株式数	3,600株
ウェザーニューズ	2,200	5,670.00	12,474,000	貸付株式数	800株
C I J	4,200	927.00	3,893,400		
ビジネスエンジニアリング	700	3,285.00	2,299,500	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	7,300	214.00	1,562,200	貸付株式数	2,800株

WOWOW	3,100	2,878.00	8,921,800	貸付株式数	800株
スカラ	4,500	844.00	3,798,000	貸付株式数	1,700株
インテリジェント ウェイブ	3,700	692.00	2,560,400		
フルキャストホールディングス	5,400	1,758.00	9,493,200	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	10,900	3,290.00	35,861,000	貸付株式数	4,600株
富士フイルムHLDGS	122,000	5,584.00	681,248,000		
コニカミノルタ	140,500	406.00	57,043,000		
資生堂	126,400	7,167.00	905,908,800		
ライオン	82,800	2,493.00	206,420,400		
高砂香料	4,000	2,530.00	10,120,000		
マンダム	14,300	1,663.00	23,780,900		
ミルボン	8,500	6,470.00	54,995,000		
ファンケル	25,800	4,275.00	110,295,000	貸付株式数	10,400株
コーセー	12,000	17,390.00	208,680,000	貸付株式数	2,600株
コタ	3,500	1,364.00	4,774,000		
シーボン	800	1,968.00	1,574,400		
ポーラ・オルビスHD	27,300	2,088.00	57,002,400	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,400	4,345.00	23,463,000		
アジュバンコスメジャパン	1,400	1,014.00	1,419,600		
エステー	4,200	2,001.00	8,404,200		
アグロカネショウ	2,500	1,704.00	4,260,000	貸付株式数	1,000株
コニシ	10,200	1,602.00	16,340,400	貸付株式数	700株
長谷川香料	11,000	2,123.00	23,353,000	貸付株式数	4,000株
星光PMC	3,700	736.00	2,723,200	貸付株式数	700株
小林製薬	17,800	12,530.00	223,034,000		

荒川化学工業	5,500	1,161.00	6,385,500	貸付株式数	2,400株
メック	4,500	2,273.00	10,228,500	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,657.00	4,782,600	貸付株式数	300株
タカラバイオ	16,800	2,858.00	48,014,400	貸付株式数	7,100株
J C U	7,700	3,800.00	29,260,000		
新田ゼラチン	4,000	689.00	2,756,000	貸付株式数	200株
O A T アグリオ	1,200	1,465.00	1,758,000	貸付株式数	400株
デクセリアルズ	16,600	1,309.00	21,729,400		
アース製薬	4,800	5,920.00	28,416,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,100	1,106.00	6,746,600	貸付株式数	2,600株
大成ラミック	2,000	3,100.00	6,200,000		
クミアイ化学	26,300	958.00	25,195,400	貸付株式数	11,200株
日本農薬	11,100	521.00	5,783,100	貸付株式数	1,900株
富士興産	2,100	955.00	2,005,500	貸付株式数	400株
ニチレキ	7,700	1,630.00	12,551,000		
ユシロ化学	3,500	1,168.00	4,088,000	貸付株式数	900株
ビーピー・カストロール	2,000	1,285.00	2,570,000	貸付株式数	900株
富士石油	17,600	183.00	3,220,800		
M O R E S C O	2,300	1,019.00	2,343,700	貸付株式数	900株
出光興産	70,700	2,295.00	162,256,500		
E N E O Sホールディングス	957,900	370.80	355,189,320		
コスモエネルギーH L D G S	18,200	1,850.00	33,670,000	貸付株式数	2,300株
横浜ゴム	36,900	1,571.00	57,969,900		
T O Y O T I R E	33,500	1,594.00	53,399,000		

ブリヂストン	169,200	3,443.00	582,555,600	貸付株式数	800株
住友ゴム	57,500	929.00	53,417,500	貸付株式数	3,900株
藤倉コンポジット	6,000	390.00	2,340,000		
オカモト	3,900	3,985.00	15,541,500		
アキレス	4,500	1,454.00	6,543,000		
フコク	3,000	700.00	2,100,000	貸付株式数	1,100株
ニッタ	7,100	2,376.00	16,869,600		
クリエートメディック	2,000	1,024.00	2,048,000		
住友理工	12,000	609.00	7,308,000		
三ツ星ベルト	8,200	1,719.00	14,095,800		
バンドー化学	10,900	626.00	6,823,400		
A G C	58,400	3,755.00	219,292,000	貸付株式数	12,500株
日本板硝子	30,900	481.00	14,862,900	貸付株式数	12,900株
石塚硝子	1,100	2,017.00	2,218,700	貸付株式数	100株
有沢製作所	10,100	973.00	9,827,300	貸付株式数	4,000株
日本山村硝子	2,800	901.00	2,522,800		
日本電気硝子	23,900	2,366.00	56,547,400		
オハラ	2,700	1,590.00	4,293,000	貸付株式数	100株
住友大阪セメント	12,100	3,130.00	37,873,000		
太平洋セメント	40,200	2,672.00	107,414,400		
リソルホールディングス	500	3,885.00	1,942,500	貸付株式数	200株
日本ヒュ - ム	6,300	807.00	5,084,100	貸付株式数	2,400株
日本コンクリ - ト	14,600	322.00	4,701,200	貸付株式数	3,300株
三谷セキサン	3,000	4,160.00	12,480,000		
アジアパイルHD	8,600	468.00	4,024,800		
東海カーボン	62,600	1,243.00	77,811,800	貸付株式数	20,900株
日本カーボン	3,500	4,025.00	14,087,500	貸付株式数	1,100株

東洋炭素	3,600	1,992.00	7,171,200	貸付株式数	100株
ノリタケ	3,400	3,125.00	10,625,000		
TOTO	45,500	5,910.00	268,905,000		
日本碍子	76,100	1,624.00	123,586,400		
日本特殊陶業	48,500	1,844.00	89,434,000		
ダントーホールディングス	5,200	480.00	2,496,000	貸付株式数	2,000株
MARUWA	2,500	11,830.00	29,575,000	貸付株式数	1,000株
品川リフラクトリーズ	1,700	2,484.00	4,222,800		
黒崎播磨	1,300	4,245.00	5,518,500		
ヨータイ	4,900	854.00	4,184,600	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,000	477.00	1,431,000		
東京窯業	8,000	371.00	2,968,000	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	2,900	800.00	2,320,000		
フジミインコーポレーテッド	5,700	3,820.00	21,774,000		
クニミネ工業	2,600	1,083.00	2,815,800		
エーアンドエーマテリアル	700	1,023.00	716,100		
ニチアス	17,300	2,404.00	41,589,200		
日本製鉄	282,000	1,330.00	375,060,000		
神戸製鋼所	116,200	559.00	64,955,800		
中山製鋼所	8,100	397.00	3,215,700		
合同製鐵	3,500	2,012.00	7,042,000	貸付株式数	300株
JFEホールディングス	170,200	1,045.00	177,859,000		
東京製鐵	30,900	638.00	19,714,200	貸付株式数	10,000株
共英製鋼	7,200	1,503.00	10,821,600		
大和工業	13,400	2,799.00	37,506,600		
東京鐵鋼	2,700	2,121.00	5,726,700		

大阪製鐵	3,300	1,350.00	4,455,000		
淀川製鋼所	8,400	2,038.00	17,119,200		
丸一鋼管	20,600	2,275.00	46,865,000		
モリ工業	1,900	2,547.00	4,839,300		
大同特殊鋼	10,200	4,455.00	45,441,000		
日本高周波	2,300	345.00	793,500	貸付株式数	400株
日本冶金工	5,100	1,833.00	9,348,300		
山陽特殊製鋼	4,500	1,292.00	5,814,000		
愛知製鋼	3,600	2,910.00	10,476,000		
日立金属	67,900	1,532.00	104,022,800		
日本金属	1,600	1,143.00	1,828,800	貸付株式数	500株
大平洋金属	4,400	2,326.00	10,234,400		
新日本電工	41,400	299.00	12,378,600		
栗本鉄工所	3,300	1,734.00	5,722,200		
虹 技	900	1,170.00	1,053,000		
日本鑄鉄管	700	1,308.00	915,600		
日本製鋼所	19,100	3,000.00	57,300,000		
三菱製鋼	4,900	709.00	3,474,100		
日亜鋼業	8,900	313.00	2,785,700	貸付株式数	2,600株
日本精線	1,100	3,730.00	4,103,000	貸付株式数	100株
エンビプロHD	2,800	640.00	1,792,000	貸付株式数	1,000株
大紀アルミニウム	10,400	797.00	8,288,800		
日本軽金属HD	16,000	1,928.00	30,848,000		
三井金属	17,000	3,825.00	65,025,000		
東邦亜鉛	3,400	2,462.00	8,370,800	貸付株式数	1,300株
三菱マテリアル	41,600	2,251.00	93,641,600		
住友鉱山	80,300	4,538.00	364,401,400		

DOWAホールディングス	15,800	3,710.00	58,618,000		
古河機金	10,900	1,238.00	13,494,200		
エス・サイエンス	31,500	42.00	1,323,000	貸付株式数	11,500株
大阪チタニウム	6,600	944.00	6,230,400	貸付株式数	2,700株
東邦チタニウム	11,000	853.00	9,383,000	貸付株式数	4,600株
UACJ	9,500	1,987.00	18,876,500	貸付株式数	4,000株
CKサンエツ	1,300	3,765.00	4,894,500	貸付株式数	500株
古河電工	19,700	2,878.00	56,696,600		
住友電工	234,800	1,301.50	305,592,200		
フジクラ	77,000	479.00	36,883,000		
昭和電線HLDGS	7,300	1,714.00	12,512,200		
東京特殊電線	900	2,400.00	2,160,000	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,700	739.00	9,385,300		
カナレ電気	1,000	1,826.00	1,826,000	貸付株式数	400株
平河ビューテック	3,100	1,253.00	3,884,300		
リョービ	7,700	1,318.00	10,148,600	貸付株式数	2,300株
アーレステイ	8,600	368.00	3,164,800		
アサヒHD	11,100	3,470.00	38,517,000		
東洋製罐グループHD	40,200	1,174.00	47,194,800		
ホッカンホールディングス	3,500	1,472.00	5,152,000		
コロナ	3,400	934.00	3,175,600		
横河ブリッジHLDGS	11,800	2,162.00	25,511,600		
OSJBHD	32,000	274.00	8,768,000		
駒井ハルテック	1,200	1,837.00	2,204,400		
高田機工	600	2,552.00	1,531,200	貸付株式数	100株
三和ホールディングス	59,400	1,228.00	72,943,200		
文化シヤツタ-	18,400	950.00	17,480,000	貸付株式数	6,800株



三協立山	8,400	880.00	7,392,000	貸付株式数	3,400株
アルインコ	4,400	923.00	4,061,200		
東洋シャツタ -	1,600	743.00	1,188,800		
L I X I L	92,800	2,311.00	214,460,800	貸付株式数	7,200株
日本ファイルコン	4,500	531.00	2,389,500		
ノーリツ	13,100	1,666.00	21,824,600		
長府製作所	6,600	2,089.00	13,787,400	貸付株式数	2,700株
リンナイ	12,300	11,880.00	146,124,000		
ユニプレス	12,800	1,070.00	13,696,000		
ダイニチ工業	3,500	870.00	3,045,000	貸付株式数	1,300株
日東精工	8,000	488.00	3,904,000	貸付株式数	3,300株
三洋工業	800	1,882.00	1,505,600		
岡 部	12,200	778.00	9,491,600	貸付株式数	5,400株
ジーテクト	7,700	1,634.00	12,581,800	貸付株式数	3,300株
東 プ レ	11,800	1,535.00	18,113,000		
高周波熱錬	12,600	478.00	6,022,800		
東京製綱	4,700	827.00	3,886,900	貸付株式数	1,700株
サンコール	4,900	439.00	2,151,100		
モリテックスチル	5,400	467.00	2,521,800	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,200	1,655.00	15,226,000	貸付株式数	3,900株
エイチワン	6,000	888.00	5,328,000		
日本発条	67,400	750.00	50,550,000	貸付株式数	19,300株
中央発條	700	2,960.00	2,072,000	貸付株式数	100株
アドバネクス	900	1,320.00	1,188,000	貸付株式数	300株
三浦工業	27,200	5,500.00	149,600,000		
タ ク マ	21,300	1,778.00	37,871,400	貸付株式数	8,900株

テクノプロ・ホールディング	12,200	8,270.00	100,894,000		
アトラ	1,700	332.00	564,400	貸付株式数	600株
インターワークス	1,600	359.00	574,400		
アイ・アールジャパンHD	2,500	15,880.00	39,700,000	貸付株式数	1,000株
Keepers 技研	4,600	2,240.00	10,304,000		
ファーストロジック	1,400	758.00	1,061,200	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	1,000.00	1,300,000		
Gunosy	4,000	730.00	2,920,000		
デザインワン・ジャパン	1,500	212.00	318,000	貸付株式数	600株
イー・ガーディアン	3,000	3,060.00	9,180,000		
リブセンス	4,000	238.00	952,000		
ジャパンマテリアル	18,600	1,371.00	25,500,600	貸付株式数	1,600株
ベクトル	7,900	959.00	7,576,100	貸付株式数	3,200株
ウチヤマホールディングス	2,900	306.00	887,400	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
チャームケアコーポレーション	5,300	1,270.00	6,731,000	貸付株式数	500株
キャリアリンク	2,100	1,965.00	4,126,500	貸付株式数	800株
IBJ	4,500	808.00	3,636,000	貸付株式数	1,800株
アサンテ	2,700	1,502.00	4,055,400		
N・フィールド	4,300	895.00	3,848,500	貸付株式数	1,700株
バリューHR	2,400	1,749.00	4,197,600	貸付株式数	1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,000	6,150.00	30,750,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ライドオンエクスプレスHD	2,500	1,983.00	4,957,500	貸付株式数	900株

E R Iホールディングス	1,700	686.00	1,166,200	貸付株式数	500株
アビスト	900	2,992.00	2,692,800	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	1,836.00	8,078,400	貸付株式数	1,700株
ウィルグループ	4,100	1,004.00	4,116,400	貸付株式数	1,600株
エスクローA J	9,000	320.00	2,880,000		
リクルートホールディングス	435,300	4,194.00	1,825,648,200		
エラン	4,200	2,965.00	12,453,000		
ツガミ	13,200	1,593.00	21,027,600	貸付株式数	4,500株
オークマ	7,300	5,750.00	41,975,000		
芝浦機械	7,300	2,254.00	16,454,200	貸付株式数	3,000株
アマダ	78,200	1,094.00	85,550,800		
アイダエンジニア	16,200	951.00	15,406,200		
滝澤鉄工所	2,000	1,006.00	2,012,000	貸付株式数	100株
F U J I	27,200	2,642.00	71,862,400	貸付株式数	2,400株
牧野フライス	7,300	3,990.00	29,127,000	貸付株式数	500株
オーエスジー	30,900	1,874.00	57,906,600	貸付株式数	12,600株
ダイジェット	700	1,444.00	1,010,800		
旭ダイヤモンド	17,000	456.00	7,752,000		
D M G 森精機	39,600	1,650.00	65,340,000		
ソデイツク	13,700	923.00	12,645,100		
ディスコ	8,500	33,250.00	282,625,000		
日東工器	3,500	1,777.00	6,219,500		
日進工具	2,500	2,637.00	6,592,500	貸付株式数	700株
パンチ工業	5,900	444.00	2,619,600		
富士ダイス	2,600	665.00	1,729,000	貸付株式数	1,100株

土木管理総合試験	2,700	357.00	963,900		
ネットマーケティング	2,300	648.00	1,490,400	貸付株式数	900株
日本郵政	497,100	810.50	402,899,550		
ベルシステム24HLDGS	10,200	1,644.00	16,768,800	貸付株式数	900株
鎌倉新書	4,900	1,173.00	5,747,700	貸付株式数	600株 (400株)
SMN	1,300	760.00	988,000		
一蔵	700	338.00	236,600	貸付株式数	200株
LITALICO	2,200	3,510.00	7,722,000		
グローバルキッズCOMP	1,000	971.00	971,000		
エアトリ	3,300	1,251.00	4,128,300	貸付株式数	1,100株
アトラエ	1,900	2,594.00	4,928,600	貸付株式数	700株
ストライク	2,400	6,080.00	14,592,000		
ソラスト	16,700	1,515.00	25,300,500		
セラク	2,000	2,327.00	4,654,000	貸付株式数	800株
インソース	2,600	3,420.00	8,892,000	貸付株式数	1,000株 (900株)
豊田自動織機	51,400	7,930.00	407,602,000		
豊和工業	3,900	897.00	3,498,300		
OKK	2,700	452.00	1,220,400		
石川製作所	1,600	1,904.00	3,046,400	貸付株式数	600株 (600株)
東洋機械金属	3,800	430.00	1,634,000		
津田駒工業	1,200	905.00	1,086,000		
エンシュウ	1,500	941.00	1,411,500		
島精機製作所	9,900	1,646.00	16,295,400	貸付株式数	4,000株

オプトラン	7,900	2,347.00	18,541,300		
N C ホールディングス	1,900	591.00	1,122,900	貸付株式数	800株
イワキポンプ	3,900	820.00	3,198,000	貸付株式数	500株
フリーー	6,500	1,075.00	6,987,500	貸付株式数	2,400株
ヤマシンフィルタ	14,400	1,102.00	15,868,800	貸付株式数	5,800株
日阪製作所	7,700	874.00	6,729,800		
やまびこ	12,200	1,334.00	16,274,800		
平田機工	3,000	8,040.00	24,120,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,600	331.00	2,184,600		
マルマエ	2,400	1,281.00	3,074,400	貸付株式数	900株
タツモ	2,800	1,433.00	4,012,400	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ナブテスコ	37,100	4,435.00	164,538,500		
三井海洋開発	6,700	1,911.00	12,803,700		
レオン自動機	6,300	1,279.00	8,057,700		
S M C	20,000	63,840.00	1,276,800,000		
ホソカワミクロン	2,200	6,670.00	14,674,000		
ユニオンツール	2,300	3,195.00	7,348,500	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	8,000	1,685.00	13,480,000	貸付株式数	100株
日精エーエスビー	1,800	6,160.00	11,088,000		
サト - ホールディングス	9,100	2,188.00	19,910,800		
技研製作所	5,500	4,245.00	23,347,500		
日本エアーテック	2,200	1,730.00	3,806,000	貸付株式数	800株
カ ワ タ	1,900	1,005.00	1,909,500		
日精樹脂工業	5,100	893.00	4,554,300	貸付株式数	2,200株
オカダアイヨン	1,900	1,064.00	2,021,600	貸付株式数	800株

ワイエイシイホールディングス	2,800	1,062.00	2,973,600	
小松製作所	288,100	2,779.50	800,773,950	
住友重機械	36,400	2,534.00	92,237,600	
日立建機	25,600	2,849.00	72,934,400	
日工	8,500	689.00	5,856,500	
巴工業	2,600	1,961.00	5,098,600	貸付株式数 300株
井関農機	6,100	1,427.00	8,704,700	
TOWA	6,500	1,890.00	12,285,000	
丸山製作所	1,500	1,515.00	2,272,500	
北川鉄工所	2,800	1,409.00	3,945,200	
シンニッタン	10,300	205.00	2,111,500	
ローツェ	2,800	5,800.00	16,240,000	貸付株式数 1,100株
タカキタ	2,200	741.00	1,630,200	
クボタ	334,100	2,211.50	738,862,150	
荏原実業	1,600	3,900.00	6,240,000	
東洋エンジニア	7,800	407.00	3,174,600	
三菱化工機	2,300	2,795.00	6,428,500	貸付株式数 800株
月島機械	11,500	1,402.00	16,123,000	貸付株式数 900株
帝国電機製作所	5,200	1,213.00	6,307,600	
東京機械	3,100	255.00	790,500	貸付株式数 1,200株
新東工業	15,100	762.00	11,506,200	
渋谷工業	5,500	3,590.00	19,745,000	
アイチ コーポレーション	11,000	940.00	10,340,000	
小森コーポレーション	16,000	739.00	11,824,000	貸付株式数 5,800株
鶴見製作所	4,900	1,801.00	8,824,900	
住友精密	800	2,098.00	1,678,400	

日本ギア工業	1,800	318.00	572,400	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,200	2,380.00	2,856,000	貸付株式数	300株
荏原製作所	26,300	3,380.00	88,894,000		
石井鉄工所	800	2,870.00	2,296,000		
西島製作所	6,600	896.00	5,913,600		
北越工業	6,300	1,061.00	6,684,300		
ダイキン工業	81,100	21,555.00	1,748,110,500		
オルガノ	2,300	6,080.00	13,984,000		
ト - ヨ - カネツ	3,000	2,147.00	6,441,000		
栗田工業	34,500	3,970.00	136,965,000		
椿本チエイン	8,900	2,777.00	24,715,300	貸付株式数	3,800株
大同工業	2,900	744.00	2,157,600		
日 機 装	20,500	1,027.00	21,053,500		
木村化工機	5,500	597.00	3,283,500	貸付株式数	2,000株
レイズネクスト	10,400	1,168.00	12,147,200		
アネスト岩田	9,900	1,119.00	11,078,100		
ダイフク	32,500	12,470.00	405,275,000		
サムコ	1,700	3,185.00	5,414,500	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,700	1,014.00	3,751,800		
油研工業	1,100	1,545.00	1,699,500		
タダノ	30,800	885.00	27,258,000	貸付株式数	13,100株
フジテック	23,200	2,233.00	51,805,600		
C K D	17,500	2,211.00	38,692,500		
キトー	4,700	1,589.00	7,468,300		
平和	17,200	1,447.00	24,888,400	貸付株式数	900株
理想科学工業	5,800	1,352.00	7,841,600		
S A N K Y O	14,100	2,697.00	38,027,700		

日本金銭機械	7,300	517.00	3,774,100	貸付株式数	2,900株
マースグループHLDGS	3,600	1,540.00	5,544,000		
フクシマガリレイ	4,000	4,540.00	18,160,000	貸付株式数	200株
オーイズミ	1,800	396.00	712,800		
ダイコク電機	2,800	865.00	2,422,000		
竹内製作所	10,700	2,412.00	25,808,400		
アマノ	16,800	2,651.00	44,536,800	貸付株式数	3,800株
JUKI	9,300	532.00	4,947,600		
サンデンホールディングス	8,500	372.00	3,162,000	貸付株式数	2,800株
蛇の目マシン	6,000	814.00	4,884,000		
ブラザー工業	77,700	2,092.00	162,548,400		
マックス	9,400	1,418.00	13,329,200		
モリタホールディングス	10,900	1,716.00	18,704,400		
グローリー	16,700	2,091.00	34,919,700		
新晃工業	5,900	1,722.00	10,159,800	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	9,800	1,139.00	11,162,200		
セガサミーホールディングス	62,900	1,622.00	102,023,800	貸付株式数	19,900株
日本ピストンリング	2,400	998.00	2,395,200		
リケン	3,100	2,265.00	7,021,500		
TPR	8,600	1,486.00	12,779,600	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	12,200	1,159.00	14,139,800		
ホシザキ	20,000	9,590.00	191,800,000	貸付株式数	1,700株
大豊工業	5,400	789.00	4,260,600	貸付株式数	1,600株
日本精工	119,700	918.00	109,884,600		
NTN	150,100	274.00	41,127,400		
ジェイテクト	60,900	825.00	50,242,500		



不二越	5,900	4,545.00	26,815,500	貸付株式数	1,800株
ミネベアミツミ	117,900	2,123.00	250,301,700		
日本トムソン	19,200	371.00	7,123,200		
T H K	39,700	3,290.00	130,613,000		
ユーシン精機	5,200	957.00	4,976,400		
前澤給装工業	2,400	2,343.00	5,623,200		
イーグル工業	8,100	1,004.00	8,132,400		
前澤工業	4,000	450.00	1,800,000	貸付株式数	500株
日本ピラ - 工業	6,600	1,545.00	10,197,000		
キッツ	23,600	647.00	15,269,200	貸付株式数	1,400株
日立	305,500	4,204.00	1,284,322,000		
三菱電機	635,800	1,562.50	993,437,500		
富士電機	38,300	3,650.00	139,795,000		
東洋電機製造	2,400	1,183.00	2,839,200	貸付株式数	500株
安川電機	68,400	4,845.00	331,398,000	貸付株式数	29,300株
シンフォニア テクノロ ジー	8,300	1,474.00	12,234,200	貸付株式数	3,200株
明電舎	11,800	2,156.00	25,440,800		
オリジン	1,800	1,349.00	2,428,200	貸付株式数	100株
山洋電気	3,000	5,250.00	15,750,000		
デンヨー	5,500	2,118.00	11,649,000		
ベイカレントコンサルティ ング	3,700	16,660.00	61,642,000	貸付株式数	1,500株
ORCHESTRA HL DGS	1,400	2,314.00	3,239,600	貸付株式数	500株
アイモバイル	2,200	1,225.00	2,695,000	貸付株式数	800株
キャリアインデックス	2,800	760.00	2,128,000	貸付株式数	1,000株

MS - J a p a n	2,100	955.00	2,005,500	貸付株式数	800株
船場	1,100	914.00	1,005,400	貸付株式数	200株
グレイステクノロジー	2,900	7,000.00	20,300,000	貸付株式数	1,100株
ジャパンエレベーターSH D	7,100	4,790.00	34,009,000		
フルテック	900	1,514.00	1,362,600	貸付株式数	300株
グリーンズ	1,800	479.00	862,200	貸付株式数	600株
ツナググループHLDGS	900	318.00	286,200	貸付株式数	300株
GAMEWITH	1,700	598.00	1,016,600	貸付株式数	600株
ソウルドアウト	1,300	1,461.00	1,899,300	貸付株式数	500株
MS&CONSULTIN G	1,000	609.00	609,000	貸付株式数	300株
ミダック	800	3,355.00	2,684,000		
日総工産	4,200	705.00	2,961,000	貸付株式数	500株
キュービーネットHLDG S	2,700	1,437.00	3,879,900	貸付株式数	1,000株
RPAホールディングス	4,800	639.00	3,067,200	貸付株式数	1,900株
三桜工業	8,300	839.00	6,963,700	貸付株式数	3,400株
マキタ	82,900	5,080.00	421,132,000		
東芝テック	8,000	3,700.00	29,600,000	貸付株式数	900株
芝浦メカトロニクス	1,100	4,310.00	4,741,000		
マブチモーター	17,600	4,420.00	77,792,000		
日本電産	153,100	12,805.00	1,960,445,500	貸付株式数	5,000株
ユーエムシーエレクトロニ クス	3,900	442.00	1,723,800	貸付株式数	1,600株
トレックス・セミコンダク ター	3,700	1,336.00	4,943,200		

東光高岳	3,700	1,645.00	6,086,500	
ダブル・スコープ	10,600	840.00	8,904,000	貸付株式数 4,200株
宮越ホールディングス	2,200	657.00	1,445,400	貸付株式数 900株
ダイヘン	7,000	5,070.00	35,490,000	貸付株式数 300株
ヤーマン	10,500	1,937.00	20,338,500	貸付株式数 4,300株
JVCケンウッド	52,600	165.00	8,679,000	
ミマキエンジニアリング	5,700	527.00	3,003,900	
I - P E X	2,800	1,955.00	5,474,000	貸付株式数 500株 (500株)
日新電機	14,600	1,168.00	17,052,800	
大崎電気	13,300	576.00	7,660,800	貸付株式数 5,300株
オムロン	57,000	9,160.00	522,120,000	
日東工業	9,400	2,050.00	19,270,000	
I D E C	9,000	1,823.00	16,407,000	貸付株式数 3,900株
正興電機製作所	1,600	2,028.00	3,244,800	貸付株式数 600株
不二電機工業	900	1,301.00	1,170,900	貸付株式数 200株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	21,200	2,739.00	58,066,800	
サクサホールディングス	1,500	1,404.00	2,106,000	
メルコホールディングス	2,300	3,530.00	8,119,000	
テクノメディカ	1,400	1,457.00	2,039,800	貸付株式数 300株
ダイヤモンドエレクトリック H D	1,400	1,121.00	1,569,400	貸付株式数 500株
日本電気	77,100	5,590.00	430,989,000	
富士通	61,300	14,045.00	860,958,500	
沖電気	25,400	913.00	23,190,200	
岩崎通信機	2,400	849.00	2,037,600	

電気興業	3,000	2,775.00	8,325,000	貸付株式数	800株
サンケン電気	7,000	4,720.00	33,040,000		
ナカヨ	1,200	1,489.00	1,786,800		
アイホン	3,800	1,740.00	6,612,000		
ルネサスエレクトロニクス	272,400	1,072.00	292,012,800		
セイコーエプソン	79,300	1,616.00	128,148,800		
ワコム	43,100	898.00	38,703,800		
アルバック	11,700	4,360.00	51,012,000	貸付株式数	3,100株
アクセル	2,600	742.00	1,929,200		
E I Z O	5,000	3,735.00	18,675,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	48.00	2,961,600		
日本信号	16,200	948.00	15,357,600		
京三製作所	14,700	436.00	6,409,200	貸付株式数	2,200株
能美防災	8,400	2,281.00	19,160,400	貸付株式数	500株
ホーチキ	4,600	1,290.00	5,934,000	貸付株式数	100株
星和電機	3,300	708.00	2,336,400		
エレコム	7,300	4,930.00	35,989,000		
パナソニック	726,800	1,194.50	868,162,600	貸付株式数	59,600株
シャープ	73,700	1,484.00	109,370,800	貸付株式数	31,300株
アンリツ	41,100	2,341.00	96,215,100	貸付株式数	17,500株
富士通ゼネラル	17,400	2,801.00	48,737,400		
ソ ニ ー	398,500	10,255.00	4,086,617,500		
T D K	30,700	14,560.00	446,992,000		
帝国通信工業	2,600	1,150.00	2,990,000	貸付株式数	100株
タムラ製作所	21,100	575.00	12,132,500		
アルプスアルパイン	56,400	1,383.00	78,001,200		
池上通信機	2,100	880.00	1,848,000	貸付株式数	800株

日本電波工業	6,100	655.00	3,995,500	貸付株式数	2,400株
鈴木	3,300	1,090.00	3,597,000		
日本トリム	800	4,165.00	3,332,000		
ローランド ディー . ジー .	3,700	1,940.00	7,178,000	貸付株式数	1,400株
フオスタ - 電機	6,600	1,285.00	8,481,000	貸付株式数	1,700株
S M K	1,600	3,150.00	5,040,000	貸付株式数	500株
ヨコオ	4,200	2,916.00	12,247,200	貸付株式数	1,700株
ティアック	4,900	107.00	524,300	貸付株式数	900株
ホシデン	17,600	1,011.00	17,793,600		
ヒロセ電機	9,800	14,930.00	146,314,000	貸付株式数	2,500株
日本航空電子	14,500	1,548.00	22,446,000		
T O A	6,700	900.00	6,030,000		
マクセルホールディングス	14,000	1,263.00	17,682,000		
古野電気	8,000	1,200.00	9,600,000		
ユニデンホールディングス	1,900	2,280.00	4,332,000	貸付株式数	200株
スミダコーポレーション	5,200	1,098.00	5,709,600	貸付株式数	500株
アイコム	3,600	2,690.00	9,684,000		
リオン	2,700	3,375.00	9,112,500		
本多通信工業	5,400	470.00	2,538,000		
船井電機	6,800	422.00	2,869,600		
横河電機	58,000	1,956.00	113,448,000		
新電元工業	2,300	2,496.00	5,740,800		
アズビル	40,200	5,360.00	215,472,000		
東亜ディーケーケー	2,900	897.00	2,601,300	貸付株式数	1,300株
日本光電工業	26,300	3,485.00	91,655,500	貸付株式数	4,600株
チ ノ ー	2,000	1,417.00	2,834,000	貸付株式数	800株

共和電業	6,500	404.00	2,626,000		
日本電子材料	2,600	1,708.00	4,440,800	貸付株式数	1,000株
堀場製作所	12,500	5,980.00	74,750,000	貸付株式数	5,000株
アドバンテスト	47,300	7,160.00	338,668,000		
小野測器	2,700	530.00	1,431,000		
エスベック	5,600	2,000.00	11,200,000		
キーエンス	57,600	54,960.00	3,165,696,000		
日置電機	3,100	4,205.00	13,035,500	貸付株式数	1,200株
シスメックス	45,500	11,940.00	543,270,000		
日本マイクロニクス	11,100	1,266.00	14,052,600	貸付株式数	3,000株
メガチップス	6,000	2,949.00	17,694,000	貸付株式数	2,400株
OBARA GROUP	3,700	3,965.00	14,670,500	貸付株式数	1,600株
IMAGICA GROUP	5,600	354.00	1,982,400	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
澤藤電機	900	2,134.00	1,920,600	貸付株式数	300株
デンソー	140,000	5,962.00	834,680,000		
原田工業	2,800	857.00	2,399,600	貸付株式数	1,200株
コーセル	8,600	1,186.00	10,199,600		
イリソ電子工業	5,300	4,440.00	23,532,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	10,500	1,886.00	19,803,000		
千代田インテグレ	2,700	1,721.00	4,646,700		
アイ・オー・データ	2,200	1,050.00	2,310,000	貸付株式数	800株
レーザーテック	28,000	11,870.00	332,360,000	貸付株式数	9,400株
スタンレー電気	44,600	3,415.00	152,309,000		
岩崎電気	2,600	1,431.00	3,720,600	貸付株式数	800株
ウシオ電機	35,200	1,302.00	45,830,400		
岡谷電機	5,200	409.00	2,126,800		

ヘリオステクノH	5,900	295.00	1,740,500	貸付株式数	200株
エノモト	2,000	1,439.00	2,878,000	貸付株式数	800株
日本セラミック	6,400	2,990.00	19,136,000		
遠藤照明	3,000	527.00	1,581,000		
古河電池	4,700	1,556.00	7,313,200	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	454.00	1,498,200	貸付株式数	1,200株
山一電機	4,600	1,531.00	7,042,600		
函 研	4,200	2,780.00	11,676,000	貸付株式数	1,000株
日本電子	12,500	4,495.00	56,187,500		
カ シ オ	56,400	1,862.00	105,016,800		
ファナック	59,800	25,805.00	1,543,139,000		
日本シイエムケイ	15,300	412.00	6,303,600	貸付株式数	5,400株
エンプラス	3,300	4,190.00	13,827,000	貸付株式数	1,000株
大真空	2,400	2,442.00	5,860,800		
口 - ム	26,500	9,810.00	259,965,000	貸付株式数	4,100株
浜松ホトニクス	45,600	6,060.00	276,336,000	貸付株式数	4,300株
三井ハイテック	7,100	3,680.00	26,128,000	貸付株式数	2,600株
新光電気工業	21,400	2,366.00	50,632,400		
京 セ ラ	89,400	6,345.00	567,243,000		
協栄産業	700	1,333.00	933,100		
太陽誘電	28,400	4,675.00	132,770,000		
村田製作所	186,900	8,858.00	1,655,560,200		
双葉電子工業	10,200	917.00	9,353,400		
日東電工	43,900	8,820.00	387,198,000		
北陸電気工業	2,700	946.00	2,554,200		
東海理化電機	16,500	1,775.00	29,287,500	貸付株式数	1,100株
ニチコン	21,600	1,283.00	27,712,800	貸付株式数	9,100株

日本ケミコン	5,100	1,896.00	9,669,600		
K O A	9,600	1,493.00	14,332,800		
三井E & S H D	21,700	399.00	8,658,300		
日立造船	51,200	479.00	24,524,800		
三菱重工業	106,700	2,996.00	319,673,200		
川崎重工業	49,600	2,073.00	102,820,800		
I H I	45,800	1,972.00	90,317,600	貸付株式数	19,500株
名村造船所	22,200	172.00	3,818,400	貸付株式数	8,700株
サノヤホールディングス	9,300	164.00	1,525,200		
スプリックス	2,000	805.00	1,610,000	貸付株式数	500株
マネジメントソリューションズ	2,800	1,670.00	4,676,000	貸付株式数	1,100株
プロレド・パートナーズ	900	4,060.00	3,654,000	貸付株式数	300株
A N D F A C T O R Y	500	765.00	382,500	貸付株式数	200株
ギークス	600	1,108.00	664,800	貸付株式数	200株
カーブスホールディングス	16,700	737.00	12,307,900	貸付株式数	7,100株
フォーラムエンジニアリング	3,300	884.00	2,917,200		
日本車輛	2,100	2,472.00	5,191,200	貸付株式数	900株
三菱ロジスネクスト	8,300	1,254.00	10,408,200	貸付株式数	2,900株
近畿車輛	800	1,310.00	1,048,000	貸付株式数	200株
F P G	19,800	506.00	10,018,800	貸付株式数	8,100株
島根銀行	1,500	645.00	967,500		
じもとホールディングス	4,500	850.00	3,825,000		
全国保証	17,700	4,645.00	82,216,500	貸付株式数	7,500株
めぶきフィナンシャルG	327,700	204.00	66,850,800		
東京きらぼしFG	8,700	1,152.00	10,022,400		



九州フィナンシャルG	136,600	447.00	61,060,200	貸付株式数	2,000株
かんぽ生命保険	21,500	2,117.00	45,515,500		
ゆうちょ銀行	177,400	876.00	155,402,400	貸付株式数	75,800株
富山第一銀行	14,900	287.00	4,276,300		
コンコルディア・フィナンシャル	358,300	364.00	130,421,200		
ジェイリース	2,100	625.00	1,312,500	貸付株式数	700株
西日本フィナンシャルHD	41,500	687.00	28,510,500	貸付株式数	1,500株
マーキュリアインベストメント	2,800	653.00	1,828,400	貸付株式数	1,100株
イントラスト	2,500	881.00	2,202,500	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	2,800	1,142.00	3,197,600		
C a s a	2,300	1,061.00	2,440,300	貸付株式数	900株
アルヒ	10,000	1,794.00	17,940,000	貸付株式数	4,200株 (1,300株)
プレミアグループ	3,500	2,254.00	7,889,000		
日産自動車	750,700	582.60	437,357,820		
いすゞ自動車	184,000	1,032.00	189,888,000		
トヨタ自動車	709,600	7,911.00	5,613,645,600		
日野自動車	79,400	1,062.00	84,322,800		
三菱自動車工業	237,500	218.00	51,775,000	貸付株式数	100,900株
エフテック	4,300	660.00	2,838,000	貸付株式数	1,600株
レシップホールディングス	2,600	528.00	1,372,800	貸付株式数	400株
G M B	1,500	665.00	997,500		
ファルテック	900	650.00	585,000	貸付株式数	400株
武蔵精密工業	14,200	1,631.00	23,160,200	貸付株式数	200株
日産車体	12,300	906.00	11,143,800	貸付株式数	5,200株

新明和工業	17,400	913.00	15,886,200	
極東開発工業	11,600	1,442.00	16,727,200	
トピー工業	5,500	1,242.00	6,831,000	貸付株式数 900株
ティラド	2,400	1,388.00	3,331,200	
タチエス	10,400	1,229.00	12,781,600	貸付株式数 1,400株
N O K	34,400	1,167.00	40,144,800	
フタバ産業	17,600	552.00	9,715,200	
K Y B	7,100	2,505.00	17,785,500	貸付株式数 3,000株
市光工業	9,400	680.00	6,392,000	貸付株式数 4,000株
大同メタル工業	12,000	504.00	6,048,000	貸付株式数 500株
プレス工業	31,300	313.00	9,796,900	
ミクニ	8,400	291.00	2,444,400	貸付株式数 1,400株
太平洋工業	13,400	1,135.00	15,209,000	貸付株式数 5,600株
河西工業	9,000	418.00	3,762,000	貸付株式数 3,400株
アイシン精機	52,300	3,115.00	162,914,500	
マ ッ ダ	187,500	708.00	132,750,000	
今仙電機製作所	3,900	810.00	3,159,000	
本田技研	500,600	3,094.00	1,548,856,400	
スズキ	126,100	5,182.00	653,450,200	
S U B A R U	197,400	2,184.00	431,121,600	
安永	3,200	1,275.00	4,080,000	貸付株式数 1,300株
ヤマハ発動機	89,900	2,151.00	193,374,900	
小糸製作所	38,100	6,820.00	259,842,000	貸付株式数 200株
T B K	7,900	458.00	3,618,200	
エクセディ	8,800	1,360.00	11,968,000	
ミツバ	11,300	532.00	6,011,600	
豊田合成	20,600	3,015.00	62,109,000	

愛三工業	9,900	513.00	5,078,700		
盟和産業	1,000	889.00	889,000	貸付株式数	200株
日本プラスト	4,400	519.00	2,283,600		
ヨロズ	6,300	1,116.00	7,030,800	貸付株式数	1,800株
エフ・シー・シー	10,400	1,936.00	20,134,400	貸付株式数	4,200株
新家工業	1,500	1,223.00	1,834,500	貸付株式数	600株
シマノ	23,800	23,860.00	567,868,000		
テイ・エス テック	14,700	3,275.00	48,142,500	貸付株式数	5,500株
関西みらいFG	39,500	517.00	20,421,500	貸付株式数	400株
33FG	6,000	1,266.00	7,596,000		
第四北越フィナンシャルG	10,800	2,305.00	24,894,000	貸付株式数	3,000株
ひろぎんHLDGS	92,600	593.00	54,911,800	貸付株式数	25,500株
ジャムコ	3,300	634.00	2,092,200	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
小野建	5,500	1,285.00	7,067,500	貸付株式数	2,200株
はるやまHLDGS	2,500	696.00	1,740,000	貸付株式数	1,000株
南陽	1,400	1,680.00	2,352,000		
ノジマ	11,200	2,727.00	30,542,400		
佐鳥電機	4,100	812.00	3,329,200	貸付株式数	700株
カップ・クリエイト	8,600	1,460.00	12,556,000	貸付株式数	1,100株
エコートレーディング	1,500	672.00	1,008,000	貸付株式数	600株 (100株)
伯東	3,700	1,064.00	3,936,800		
コンドーテック	4,800	1,059.00	5,083,200	貸付株式数	1,800株
中山福	3,700	555.00	2,053,500		
ライトオン	4,600	593.00	2,727,800	貸付株式数	1,800株 (1,400株)

ナガイレーベン	8,300	2,737.00	22,717,100	
ジーンズメイト	2,700	304.00	820,800	貸付株式数 900株 (200株)
三菱食品	6,800	2,875.00	19,550,000	
良品計画	83,300	2,029.00	169,015,700	
三城ホールディングス	6,900	292.00	2,014,800	貸付株式数 2,700株
松田産業	4,800	1,862.00	8,937,600	
第一興商	9,300	3,465.00	32,224,500	貸付株式数 3,600株
メディパルHD	67,400	2,011.00	135,541,400	
アドヴァン	9,600	1,250.00	12,000,000	貸付株式数 2,900株
S P K	2,800	1,284.00	3,595,200	貸付株式数 200株
萩原電気HLDGS	2,200	2,485.00	5,467,000	
アルビス	2,400	2,529.00	6,069,600	貸付株式数 500株
アズワン	4,100	15,840.00	64,944,000	貸付株式数 1,700株
スズデン	2,100	1,254.00	2,633,400	貸付株式数 800株
尾家産業	1,900	1,386.00	2,633,400	
シモジマ	3,800	1,418.00	5,388,400	貸付株式数 1,600株
ドウシシャ	6,100	1,936.00	11,809,600	
小津産業	1,400	1,897.00	2,655,800	
コナカ	7,700	285.00	2,194,500	
高速	3,800	1,622.00	6,163,600	
ハウス ローゼ	500	1,631.00	815,500	
G - 7ホールディングス	3,800	2,352.00	8,937,600	
たけびし	2,000	1,565.00	3,130,000	貸付株式数 900株
イオン北海道	7,500	979.00	7,342,500	貸付株式数 3,400株
コジマ	11,000	723.00	7,953,000	貸付株式数 4,300株
ヒマラヤ	2,200	963.00	2,118,600	

コーナン商事	9,000	3,235.00	29,115,000	貸付株式数	300株
ネットワンシステムズ	23,900	3,765.00	89,983,500	貸付株式数	10,100株
エコス	2,200	2,114.00	4,650,800		
ワタミ	7,600	873.00	6,634,800	貸付株式数	3,000株
マルシェ	1,500	504.00	756,000	貸付株式数	600株
リックス	1,200	1,660.00	1,992,000	貸付株式数	500株
システムソフト	16,300	89.00	1,450,700		
パンパシフィックHD	137,700	2,396.00	329,929,200		
丸文	5,600	513.00	2,872,800		
西松屋チェーン	14,000	1,496.00	20,944,000	貸付株式数	5,800株
ゼンショーホールディングス	29,800	2,635.00	78,523,000		
ハピネット	5,500	1,618.00	8,899,000		
幸楽苑ホールディングス	4,000	1,745.00	6,980,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,100	892.00	981,200	貸付株式数	500株
橋本総業HLDGS	1,300	2,780.00	3,614,000		
日本ライフライン	18,600	1,562.00	29,053,200		
サイゼリヤ	9,500	1,895.00	18,002,500	貸付株式数	500株
タカショー	3,900	878.00	3,424,200	貸付株式数	1,500株
V Tホールディングス	25,800	392.00	10,113,600		
マルカ	2,000	1,975.00	3,950,000	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,300	3,200.00	16,960,000		
魚力	1,600	1,818.00	2,908,800		
IDOM	17,200	541.00	9,305,200	貸付株式数	7,100株
日本エム・ディ・エム	3,700	2,264.00	8,376,800	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,100	393.00	432,300	貸付株式数	700株

フジ・コーポレーション	1,500	2,246.00	3,369,000	貸付株式数	700株 (700株)
ユナイテッドアローズ	6,700	1,602.00	10,733,400	貸付株式数	800株
進和	3,500	2,206.00	7,721,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	470.00	752,000	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,600	1,636.00	4,253,600	貸付株式数	1,100株
ハイデイ日高	9,000	1,749.00	15,741,000	貸付株式数	3,800株
シークス	7,900	1,612.00	12,734,800	貸付株式数	3,300株
京都きもの友禅	3,900	224.00	873,600	貸付株式数	1,600株
コロワイド	20,800	1,574.00	32,739,200	貸付株式数	8,800株 (700株)
ピーシーデポコーポ	8,400	577.00	4,846,800	貸付株式数	3,500株
田中商事	1,500	701.00	1,051,500		
オーハシテクニカ	3,100	1,447.00	4,485,700		
壱番屋	4,300	5,150.00	22,145,000	貸付株式数	1,800株
白銅	2,300	1,478.00	3,399,400	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	341.00	818,400	貸付株式数	400株
P L A N T	1,600	735.00	1,176,000	貸付株式数	500株
スギホールディングス	12,500	7,000.00	87,500,000		
ダイコー通産	400	1,405.00	562,000		
薬王堂ホールディングス	2,800	2,436.00	6,820,800	貸付株式数	800株
島津製作所	76,000	3,795.00	288,420,000		
J M S	5,700	918.00	5,232,600	貸付株式数	2,200株
クボテック	1,900	369.00	701,100	貸付株式数	600株
長野計器	4,700	910.00	4,277,000		
ブイ・テクノロジー	3,000	5,590.00	16,770,000	貸付株式数	1,200株
スター精密	10,000	1,641.00	16,410,000		

東京計器	4,000	960.00	3,840,000	
愛知時計	800	4,540.00	3,632,000	
インターアクション	3,500	1,917.00	6,709,500	貸付株式数 1,400株
オーバル	6,400	303.00	1,939,200	貸付株式数 2,400株
東京精密	11,500	4,855.00	55,832,500	
マニー	25,400	2,677.00	67,995,800	貸付株式数 3,000株
ニコン	97,500	685.00	66,787,500	
トプコン	32,100	1,273.00	40,863,300	
オリンパス	351,900	2,234.00	786,144,600	
理研計器	5,600	2,971.00	16,637,600	
S C R E E Nホールディングス	11,100	7,090.00	78,699,000	
キヤノン電子	5,700	1,556.00	8,869,200	貸付株式数 700株
タムロン	5,100	1,799.00	9,174,900	貸付株式数 1,000株
H O Y A	126,200	13,945.00	1,759,859,000	
シード	2,700	615.00	1,660,500	貸付株式数 1,100株
ノーリツ鋼機	4,400	2,402.00	10,568,800	
エー・アンド・デイ	5,900	1,089.00	6,425,100	
朝日インテック	72,200	3,610.00	260,642,000	
キヤノン	316,500	2,093.00	662,434,500	貸付株式数 141,500株
リコー	162,600	715.00	116,259,000	貸付株式数 65,500株
シチズン時計	76,300	296.00	22,584,800	貸付株式数 1,100株
リズム	2,100	646.00	1,356,600	
大研医器	4,400	529.00	2,327,600	
メニコン	9,000	6,370.00	57,330,000	貸付株式数 2,400株
シンシア	900	400.00	360,000	
中本パックス	1,600	1,612.00	2,579,200	貸付株式数 600株

スノーピーク	3,500	1,778.00	6,223,000	貸付株式数	1,400株
パラマウントベッドHD	6,700	4,495.00	30,116,500		
トランザクション	3,700	907.00	3,355,900	貸付株式数	1,400株
粧美堂	1,100	399.00	438,900	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	6,100	1,287.00	7,850,700		
前田工織	7,100	2,580.00	18,318,000	貸付株式数	2,900株
永大産業	8,600	291.00	2,502,600		
アートネイチャー	6,400	644.00	4,121,600		
バンダイナムコHLDGS	65,800	9,358.00	615,756,400		
アイフィスジャパン	1,800	801.00	1,441,800	貸付株式数	600株
共立印刷	10,400	121.00	1,258,400		
SHOEI	5,700	3,655.00	20,833,500		
フランスベッドHLDGS	8,700	928.00	8,073,600	貸付株式数	3,600株
マーベラス	9,700	906.00	8,788,200		
パイロットコーポレーション	11,100	3,005.00	33,355,500		
萩原工業	3,600	1,477.00	5,317,200		
エイベックス	11,100	1,004.00	11,144,400	貸付株式数	100株
トッパン・フォームズ	13,600	1,065.00	14,484,000		
フジシールインターナショナル	14,300	2,039.00	29,157,700	貸付株式数	5,800株
タカラトミー	28,500	926.00	26,391,000		
廣濟堂	4,400	681.00	2,996,400		
エステールホールディングス	1,200	631.00	757,200	貸付株式数	700株
レック	6,800	1,360.00	9,248,000		
タカノ	2,400	607.00	1,456,800	貸付株式数	1,000株



三光合成	7,500	356.00	2,670,000	貸付株式数	3,000株
プロネクス	5,400	1,051.00	5,675,400	貸付株式数	100株
ホクシン	5,300	112.00	593,600		
ウッドワン	2,400	1,112.00	2,668,800		
大建工業	4,300	1,902.00	8,178,600		
きもと	12,400	181.00	2,244,400		
凸版印刷	89,700	1,464.00	131,320,800		
大日本印刷	83,100	1,917.00	159,302,700		
共同印刷	2,000	3,155.00	6,310,000		
N I S S H A	13,300	1,484.00	19,737,200		
光村印刷	600	1,800.00	1,080,000	貸付株式数	200株
藤森工業	5,600	4,685.00	26,236,000	貸付株式数	100株
ヴィア・ホールディングス	8,100	224.00	1,814,400	貸付株式数	3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,982.00	6,540,600	貸付株式数	1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,300	970.00	4,171,000		
未来工業	3,400	1,807.00	6,143,800	貸付株式数	900株
アシックス	56,300	2,022.00	113,838,600		
ツツミ	2,100	2,157.00	4,529,700		
ウェーブロックHLDGS	2,300	778.00	1,789,400		
ジェイエスピー	3,700	1,775.00	6,567,500	貸付株式数	1,500株
ニチハ	8,900	3,170.00	28,213,000	貸付株式数	1,800株
エフピコ	13,500	4,250.00	57,375,000		
小松ウオール工業	1,800	1,738.00	3,128,400		
ヤマハ	37,800	5,730.00	216,594,000		
河合楽器	1,900	3,025.00	5,747,500		
クリナップ	6,300	475.00	2,992,500		

ピジヨン	40,900	4,410.00	180,369,000	貸付株式数	17,300株
天馬	4,300	2,061.00	8,862,300		
オリバー	1,400	2,309.00	3,232,600		
兼松サステック	400	1,624.00	649,600		
キングジム	5,500	867.00	4,768,500		
象印マホービン	17,300	1,835.00	31,745,500		
リンテック	15,100	2,277.00	34,382,700	貸付株式数	6,100株
信越ポリマー	11,100	944.00	10,478,400		
東リ	14,800	244.00	3,611,200		
イトーキ	12,900	349.00	4,502,100		
任天堂	39,000	66,720.00	2,602,080,000		
三菱鉛筆	10,200	1,440.00	14,688,000	貸付株式数	2,700株
松風	2,900	1,883.00	5,460,700		
タカラスタンダード	13,100	1,513.00	19,820,300		
コクヨ	30,500	1,456.00	44,408,000		
ナカバヤシ	5,800	626.00	3,630,800		
ニフコ	23,300	3,805.00	88,656,500	貸付株式数	9,900株
立川ブラインド	2,700	1,320.00	3,564,000	貸付株式数	1,200株
グローブライド	2,900	4,335.00	12,571,500		
オカムラ	22,400	937.00	20,988,800		
バルカー	5,100	2,015.00	10,276,500		
MUTOHホールディングス	1,000	1,477.00	1,477,000	貸付株式数	300株
伊藤忠	438,500	2,923.00	1,281,735,500		
丸紅	651,500	686.20	447,059,300		
スクロール	10,100	732.00	7,393,200	貸付株式数	400株
高島	1,000	1,637.00	1,637,000		

ヨンドシーホールディングス	6,500	1,958.00	12,727,000		
三陽商会	3,500	567.00	1,984,500	貸付株式数	1,400株
長瀬産業	34,700	1,520.00	52,744,000		
ナイガイ	2,500	348.00	870,000	貸付株式数	900株
蝶理	3,800	1,604.00	6,095,200	貸付株式数	100株
豊田通商	69,800	3,920.00	273,616,000		
オンワ - ドホールディングス	39,500	210.00	8,295,000		
三共生興	8,400	461.00	3,872,400		
兼松	23,400	1,257.00	29,413,800		
美津濃	5,500	1,919.00	10,554,500		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,554.00	1,709,400	貸付株式数	400株
ルックホールディングス	2,100	1,009.00	2,118,900	貸付株式数	800株
三井物産	542,600	1,913.50	1,038,265,100		
日本紙パルプ	3,500	3,620.00	12,670,000	貸付株式数	400株
東京エレクトロン	40,400	36,250.00	1,464,500,000	貸付株式数	17,200株
カメイ	7,800	1,169.00	9,118,200		
東都水産	800	4,560.00	3,648,000	貸付株式数	300株
OUGホールディングス	1,000	2,833.00	2,833,000		
スターゼン	2,300	4,095.00	9,418,500		
セイコーHD	8,800	1,367.00	12,029,600	貸付株式数	2,600株
山善	24,500	1,042.00	25,529,000		
椿本興業	1,100	3,945.00	4,339,500		
住友商事	394,900	1,343.00	530,350,700		
日本ユニシス	19,500	3,845.00	74,977,500		
内田洋行	2,500	4,365.00	10,912,500	貸付株式数	1,000株

三菱商事	411,400	2,595.50	1,067,788,700		
第一実業	3,200	4,030.00	12,896,000		
キヤノンマーケティングJ P N	15,700	2,312.00	36,298,400	貸付株式数	600株
西華産業	3,400	1,283.00	4,362,200		
佐藤商事	4,700	903.00	4,244,100	貸付株式数	2,100株
菱洋エレクトロ	6,400	2,820.00	18,048,000	貸付株式数	2,700株
東京産業	5,200	588.00	3,057,600		
ユアサ商事	5,900	3,300.00	19,470,000		
神鋼商事	1,500	1,895.00	2,842,500		
トルク	3,900	268.00	1,045,200		
阪和興業	11,800	2,802.00	33,063,600		
正栄食品	4,100	3,565.00	14,616,500	貸付株式数	1,700株
カナデン	5,300	1,270.00	6,731,000	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,600	1,512.00	6,955,200	貸付株式数	1,600株
ニプロ	43,700	1,218.00	53,226,600	貸付株式数	500株
フルサト工業	3,100	1,340.00	4,154,000	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,900	6,200.00	92,380,000		
ナイス	2,500	1,666.00	4,165,000		
昭光通商	1,900	605.00	1,149,500		
ニチモウ	1,000	1,960.00	1,960,000		
極東貿易	1,800	1,355.00	2,439,000	貸付株式数	700株
イワキ	8,400	524.00	4,401,600	貸付株式数	3,300株
兼松エレクトロニクス	3,400	4,130.00	14,042,000		
三愛石油	15,300	1,159.00	17,732,700	貸付株式数	6,500株
稲畑産業	13,700	1,439.00	19,714,300	貸付株式数	5,900株
G S Iクレオス	1,600	1,740.00	2,784,000	貸付株式数	600株

明和産業	6,200	458.00	2,839,600	貸付株式数	2,300株
クワザワホールディングス	1,900	588.00	1,117,200	貸付株式数	400株
ヤマエ久野	4,600	1,195.00	5,497,000		
ゴ-ルドウイン	11,300	7,250.00	81,925,000		
ユニ・チャ-ム	134,900	4,998.00	674,230,200		
デサント	12,100	1,890.00	22,869,000		
キ ン グ	2,600	566.00	1,471,600		
ワ キ タ	13,700	1,089.00	14,919,300		
ヤマトインタ-ナショナル	5,700	344.00	1,960,800	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	19,800	1,944.00	38,491,200		
サンゲツ	16,800	1,518.00	25,502,400		
ミツウロコグループ	9,300	1,424.00	13,243,200	貸付株式数	3,700株
シナネンホールディングス	2,600	2,920.00	7,592,000	貸付株式数	1,100株
伊藤忠エネクス	14,100	1,026.00	14,466,600		
サンリオ	17,500	1,441.00	25,217,500	貸付株式数	300株
サンワ テクノス	4,500	978.00	4,401,000		
リョ-サン	6,800	1,913.00	13,008,400		
新光商事	9,600	733.00	7,036,800		
トーホ-	2,900	2,103.00	6,098,700	貸付株式数	1,200株
三信電気	3,300	2,137.00	7,052,100		
東陽テクニカ	6,700	1,133.00	7,591,100		
モスフード サービス	8,200	2,933.00	24,050,600	貸付株式数	3,500株
加賀電子	6,300	2,315.00	14,584,500	貸付株式数	500株
三益半導体	4,900	2,608.00	12,779,200	貸付株式数	1,400株
ソーダニツカ	6,300	535.00	3,370,500	貸付株式数	2,300株
立花エレテック	4,500	1,661.00	7,474,500	貸付株式数	1,600株
木曽路	8,200	2,409.00	19,753,800	貸付株式数	3,400株

S R S ホールディングス	7,500	849.00	6,367,500	貸付株式数	3,100株
千 趣 会	11,900	345.00	4,105,500	貸付株式数	4,800株
タカキュー	6,100	136.00	829,600	貸付株式数	2,200株 (1,600株)
リテールパートナーズ	8,300	1,455.00	12,076,500	貸付株式数	2,900株
ケーヨー	13,100	744.00	9,746,400		
上新電機	7,300	2,761.00	20,155,300	貸付株式数	2,800株
日本瓦斯	10,000	5,550.00	55,500,000		
ロイヤルホールディングス	11,100	1,967.00	21,833,700	貸付株式数	4,600株
東 天 紅	500	892.00	446,000		
いなげや	7,700	1,840.00	14,168,000		
島 忠	12,500	5,480.00	68,500,000	貸付株式数	5,000株
チヨダ	6,700	918.00	6,150,600	貸付株式数	2,800株
ライフコーポレーション	4,800	3,595.00	17,256,000	貸付株式数	2,000株
リンガーハット	7,800	2,362.00	18,423,600	貸付株式数	3,300株 (1,700株)
M r M a x H D	8,800	816.00	7,180,800	貸付株式数	2,100株
テナアライド	5,900	300.00	1,770,000	貸付株式数	2,300株
A O K I ホールディングス	13,500	509.00	6,871,500	貸付株式数	100株
オークワ	9,800	1,324.00	12,975,200		
コメリ	9,800	2,876.00	28,184,800		
青山商事	13,800	554.00	7,645,200	貸付株式数	5,500株
しまむら	7,300	10,570.00	77,161,000		
はせがわ	3,400	298.00	1,013,200	貸付株式数	300株
高 島 屋	45,900	875.00	40,162,500		
松 屋	12,400	760.00	9,424,000	貸付株式数	2,800株

エイチ・ツー・オーリテイ リング	29,800	701.00	20,889,800	貸付株式数	12,500株
近鉄百貨店	2,200	3,265.00	7,183,000	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	57,400	1,816.00	104,238,400		
クレディセゾン	44,100	1,231.00	54,287,100		
アクシアル リテイリング	5,100	4,895.00	24,964,500		
井筒屋	1,900	175.00	332,500		
イオン	240,800	3,117.00	750,573,600	貸付株式数	102,600株
イズミ	12,600	3,780.00	47,628,000	貸付株式数	5,400株
フォーバル	2,800	853.00	2,388,400	貸付株式数	100株
平和堂	12,200	2,175.00	26,535,000	貸付株式数	5,200株
フジ	7,200	1,948.00	14,025,600	貸付株式数	1,900株
ヤオコー	7,100	6,990.00	49,629,000	貸付株式数	3,000株
ゼビオホールディングス	7,900	851.00	6,722,900	貸付株式数	3,200株
ケースホールディングス	60,600	1,394.00	84,476,400	貸付株式数	25,700株
PALTAC	10,100	5,870.00	59,287,000	貸付株式数	1,800株
三谷産業	8,700	516.00	4,489,200	貸付株式数	3,400株
OLYMPICグループ	3,300	916.00	3,022,800	貸付株式数	1,300株
日産東京販売HD	8,200	264.00	2,164,800		
新生銀行	46,100	1,247.00	57,486,700		
あおぞら銀行	37,400	1,921.00	71,845,400	貸付株式数	15,900株
三菱UFJフィナンシャル G	4,293,700	447.80	1,922,718,860		
りそなホールディングス	686,000	364.50	250,047,000		
三井住友トラストHD	118,600	3,119.00	369,913,400		
三井住友フィナンシャルG	433,900	3,153.00	1,368,086,700		

千葉銀行	209,400	559.00	117,054,600		
群馬銀行	120,900	320.00	38,688,000		
武蔵野銀行	9,200	1,547.00	14,232,400		
千葉興業銀行	16,900	256.00	4,326,400		
筑波銀行	28,100	187.00	5,254,700		
七十七銀行	21,000	1,427.00	29,967,000		
青森銀行	4,800	2,421.00	11,620,800		
秋田銀行	4,100	1,386.00	5,682,600	貸付株式数	1,600株
山形銀行	7,100	1,032.00	7,327,200	貸付株式数	3,000株
岩手銀行	4,200	2,119.00	8,899,800		
東邦銀行	56,000	216.00	12,096,000		
東北銀行	3,100	1,127.00	3,493,700	貸付株式数	1,000株
みちのく銀行	4,200	1,068.00	4,485,600		
ふくおかフィナンシャルG	52,800	1,837.00	96,993,600		
静岡銀行	152,800	761.00	116,280,800		
十六銀行	7,900	1,917.00	15,144,300		
スルガ銀行	63,000	332.00	20,916,000		
八十二銀行	151,500	346.00	52,419,000		
山梨中央銀行	7,500	784.00	5,880,000		
大垣共立銀行	12,300	2,222.00	27,330,600		
福井銀行	5,300	1,858.00	9,847,400	貸付株式数	500株
北國銀行	6,300	2,742.00	17,274,600	貸付株式数	500株
清水銀行	2,500	1,702.00	4,255,000		
富山銀行	1,300	3,205.00	4,166,500		
滋賀銀行	12,500	2,197.00	27,462,500		
南都銀行	10,300	1,812.00	18,663,600		
百五銀行	55,800	308.00	17,186,400		



京都銀行	22,400	5,510.00	123,424,000	貸付株式数	9,500株
紀陽銀行	22,000	1,523.00	33,506,000	貸付株式数	4,100株
ほくほくフィナンシャルG	41,600	1,012.00	42,099,200		
山陰合同銀行	36,700	532.00	19,524,400		
中国銀行	54,000	844.00	45,576,000	貸付株式数	22,800株
鳥取銀行	2,200	1,171.00	2,576,200		
伊予銀行	89,300	678.00	60,545,400	貸付株式数	37,900株
百十四銀行	6,900	1,534.00	10,584,600	貸付株式数	1,700株
四国銀行	9,900	696.00	6,890,400	貸付株式数	2,700株
阿波銀行	10,200	2,438.00	24,867,600		
大分銀行	3,600	2,119.00	7,628,400		
宮崎銀行	4,100	2,241.00	9,188,100		
佐賀銀行	4,000	1,379.00	5,516,000	貸付株式数	800株
沖縄銀行	5,800	2,934.00	17,017,200	貸付株式数	2,000株
琉球銀行	14,800	808.00	11,958,400		
セブン銀行	211,000	218.00	45,998,000		
みずほフィナンシャルG	852,300	1,317.00	1,122,479,100		
高知銀行	2,500	817.00	2,042,500		
山口フィナンシャルG	77,900	615.00	47,908,500		
芙蓉総合リース	6,500	6,870.00	44,655,000	貸付株式数	100株
みずほリース	9,600	2,988.00	28,684,800		
東京センチュリー	12,600	7,700.00	97,020,000	貸付株式数	5,300株
SBIホールディングス	72,000	2,997.00	215,784,000	貸付株式数	30,000株
日本証券金融	28,600	527.00	15,072,200	貸付株式数	11,800株
アイフル	96,500	259.00	24,993,500		
日本アジア投資	5,400	220.00	1,188,000		
長野銀行	2,100	1,463.00	3,072,300		

名古屋銀行	4,700	2,609.00	12,262,300		
北洋銀行	94,600	226.00	21,379,600		
愛知銀行	2,200	3,120.00	6,864,000		
中京銀行	2,600	2,059.00	5,353,400	貸付株式数	1,000株
大光銀行	2,100	1,336.00	2,805,600		
愛媛銀行	9,000	1,023.00	9,207,000	貸付株式数	3,600株
トマト銀行	2,500	1,101.00	2,752,500		
京葉銀行	26,200	440.00	11,528,000		
栃木銀行	31,600	175.00	5,530,000		
北日本銀行	2,000	2,003.00	4,006,000		
東和銀行	11,500	619.00	7,118,500		
福島銀行	7,300	207.00	1,511,100	貸付株式数	2,500株
大東銀行	3,300	643.00	2,121,900		
リコーリース	4,800	3,090.00	14,832,000	貸付株式数	2,100株
イオンフィナンシャルサー ビス	38,600	1,274.00	49,176,400	貸付株式数	16,400株
アコム	126,000	458.00	57,708,000	貸付株式数	2,800株
ジャックス	7,100	1,858.00	13,191,800		
オリコ	170,700	116.00	19,801,200		
日立キャピタル	14,800	2,434.00	36,023,200		
オリックス	388,700	1,601.00	622,308,700		
三菱UFJリース	159,100	487.00	77,481,700		
ジャフコグループ	9,700	4,860.00	47,142,000		
九州リースサービス	2,300	625.00	1,437,500	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	47,500	319.00	15,152,500	貸付株式数	3,800株
大和証券G本社	502,200	482.50	242,311,500		
野村ホールディングス	1,103,000	534.00	589,002,000		

岡三証券グループ	53,500	380.00	20,330,000	貸付株式数	2,500株
丸三証券	19,300	474.00	9,148,200		
東洋証券	23,400	134.00	3,135,600		
東海東京HD	71,000	307.00	21,797,000	貸付株式数	30,600株
光世証券	1,800	675.00	1,215,000		
水戸証券	18,900	231.00	4,365,900	貸付株式数	7,600株
いちよし証券	12,200	474.00	5,782,800	貸付株式数	3,000株
松井証券	35,800	812.00	29,069,600		
SOMPOホールディングス	117,800	4,014.00	472,849,200		
日本取引所グループ	180,300	2,542.00	458,322,600		
マネックスG	47,000	375.00	17,625,000		
極東証券	8,700	700.00	6,090,000	貸付株式数	3,400株
岩井コスモホールディング	6,000	1,281.00	7,686,000		
藍澤證券	11,600	754.00	8,746,400		
フィデアホール	64,400	107.00	6,890,800		
池田泉州HD	76,100	151.00	11,491,100		
アニコムホールディングス	21,000	1,041.00	21,861,000		
MS&AD	163,400	3,054.00	499,023,600		
マネーパートナーズGP	6,600	213.00	1,405,800		
スパークス・グループ	29,300	256.00	7,500,800	貸付株式数	12,300株
小林洋行	2,700	270.00	729,000		
第一生命HLDGS	354,600	1,590.50	563,991,300		
東京海上HD	221,600	5,233.00	1,159,632,800		
アドバンテッジリスクマネ	3,200	666.00	2,131,200	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	7,400	2,183.00	16,154,200	貸付株式数	400株

アサックス	3,500	715.00	2,502,500	貸付株式数	300株
NECキャピタルソリューション	2,400	1,868.00	4,483,200		
T&Dホールディングス	187,300	1,211.00	226,820,300		
アドバンスクリエイト	1,300	2,007.00	2,609,100	貸付株式数	500株
三井不動産	304,700	2,269.50	691,516,650		
三菱地所	439,200	1,638.00	719,409,600		
平和不動産	11,400	3,560.00	40,584,000		
東京建物	61,700	1,436.00	88,601,200		
ダイビル	15,900	1,301.00	20,685,900	貸付株式数	4,300株
京阪神ビルディング	10,500	1,854.00	19,467,000	貸付株式数	400株
住友不動産	140,700	3,349.00	471,204,300		
太平洋興発	2,600	639.00	1,661,400	貸付株式数	300株
テーオーシー	11,600	689.00	7,992,400	貸付株式数	1,200株
東京楽天地	1,000	4,390.00	4,390,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	8,400	2,963.00	24,889,200	貸付株式数	3,300株
フジ住宅	6,400	659.00	4,217,600	貸付株式数	2,200株
空港施設	5,200	486.00	2,527,200		
明和地所	3,400	549.00	1,866,600		
ゴールドクレスト	5,000	1,610.00	8,050,000	貸付株式数	2,000株
リログループ	33,200	2,651.00	88,013,200	貸付株式数	500株
エスリード	2,200	1,407.00	3,095,400		
日神グループHLDGS	8,100	413.00	3,345,300	貸付株式数	3,700株
日本エスコン	11,100	907.00	10,067,700		
タカラレーベン	28,100	308.00	8,654,800	貸付株式数	7,800株
A V A N T I A	3,500	855.00	2,992,500	貸付株式数	600株
イオンモール	31,300	1,655.00	51,801,500	貸付株式数	13,300株

毎日コムネット	900	715.00	643,500		
ファースト住建	2,400	1,060.00	2,544,000	貸付株式数	1,000株
ランド	359,600	9.00	3,236,400		
カチタス	15,600	3,240.00	50,544,000	貸付株式数	5,000株
東祥	3,900	1,558.00	6,076,200		
トーセイ	8,700	1,195.00	10,396,500	貸付株式数	3,500株
穴吹興産	800	1,673.00	1,338,400	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	8,300	902.00	7,486,600		
インテリックス	1,400	525.00	735,000	貸付株式数	100株
ランドビジネス	2,300	342.00	786,600		
サンネクスタグループ	1,900	985.00	1,871,500		
グランディハウス	4,900	386.00	1,891,400		
東武鉄道	67,000	3,000.00	201,000,000		
相鉄ホールディングス	20,500	2,527.00	51,803,500	貸付株式数	1,600株
東急	162,600	1,242.00	201,949,200		
京浜急行	84,000	1,710.00	143,640,000	貸付株式数	34,700株
小田急電鉄	95,400	3,100.00	295,740,000		
京王電鉄	33,200	7,500.00	249,000,000		
京成電鉄	45,500	3,470.00	157,885,000		
富士急行	9,000	4,440.00	39,960,000	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,700	2,380.00	4,046,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	113,700	6,730.00	765,201,000		
西日本旅客鉄道	58,300	5,252.00	306,191,600		
東海旅客鉄道	53,800	14,135.00	760,463,000		
西武ホールディングス	85,400	1,035.00	88,389,000		
鴻池運輸	10,000	1,019.00	10,190,000		
西日本鉄道	18,000	2,928.00	52,704,000	貸付株式数	4,200株

ハマキョウレックス	4,800	2,844.00	13,651,200		
サカイ引越センター	3,400	5,360.00	18,224,000	貸付株式数	500株
近鉄グループHLDGS	60,500	4,400.00	266,200,000		
阪急阪神HLDGS	82,000	3,345.00	274,290,000	貸付株式数	500株
南海電鉄	30,100	2,553.00	76,845,300	貸付株式数	2,600株
京阪ホールディングス	27,100	4,830.00	130,893,000	貸付株式数	11,400株
神戸電鉄	1,500	3,725.00	5,587,500		
名古屋鉄道	52,300	2,657.00	138,961,100	貸付株式数	17,800株
山陽電鉄	4,600	1,988.00	9,144,800	貸付株式数	1,800株
トランコム	1,700	8,530.00	14,501,000		
日本通運	20,900	6,920.00	144,628,000		
ヤマトホールディングス	100,000	2,634.00	263,400,000		
山 九	16,600	3,940.00	65,404,000		
日 新	5,600	1,221.00	6,837,600		
丸 運	3,500	258.00	903,000	貸付株式数	800株
丸全昭和運輸	4,800	3,310.00	15,888,000		
センコーグループHLDGS	33,500	998.00	33,433,000	貸付株式数	11,900株
トナミホールディングス	1,400	6,080.00	8,512,000		
ニッコンホールディングス	21,300	2,039.00	43,430,700		
日石輸送	600	2,665.00	1,599,000		
福山通運	7,700	4,450.00	34,265,000	貸付株式数	3,200株
セイノーホールディングス	45,200	1,473.00	66,579,600		
エスライン	1,700	923.00	1,569,100	貸付株式数	600株
神奈川中央交通	1,600	3,925.00	6,280,000	貸付株式数	600株
日立物流	11,000	3,100.00	34,100,000		
丸和運輸機関	6,400	4,300.00	27,520,000		

C & F ロジホールディングス	6,100	1,992.00	12,151,200	
日本郵船	50,400	2,351.00	118,490,400	貸付株式数 21,200株
商船三井	38,100	3,185.00	121,348,500	
川崎汽船	18,600	2,028.00	37,720,800	貸付株式数 7,800株
N S ユナイテッド海運	3,300	1,417.00	4,676,100	貸付株式数 800株
明治海運	6,600	393.00	2,593,800	
飯野海運	27,900	421.00	11,745,900	
共栄タンカー	1,200	842.00	1,010,400	
九州旅客鉄道	55,400	2,186.00	121,104,400	
S G ホールディングス	126,700	3,025.00	383,267,500	
日本航空	138,600	1,928.00	267,220,800	
A N A ホールディングス	116,600	2,247.00	262,000,200	
パスコ	1,200	1,412.00	1,694,400	
西本W I S M E T T A C H D	1,200	2,177.00	2,612,400	貸付株式数 400株
シルバーライフ	900	2,280.00	2,052,000	貸付株式数 300株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	500	1,734.00	867,000	貸付株式数 200株
一家ダイニングプロジ	500	534.00	267,000	貸付株式数 200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,800	4,380.00	12,264,000	貸付株式数 1,100株
国際紙パルプ商事	15,600	249.00	3,884,400	
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	1,400	724.00	1,013,600	
ブックオフG H D	3,600	823.00	2,962,800	貸付株式数 1,500株
三菱倉庫	19,100	2,889.00	55,179,900	

三井倉庫HOLD	6,800	2,234.00	15,191,200	貸付株式数	600株
住友倉庫	21,500	1,353.00	29,089,500		
渋沢倉庫	3,200	2,286.00	7,315,200		
ヤマタネ	3,200	1,370.00	4,384,000		
東陽倉庫	10,700	324.00	3,466,800		
乾汽船	3,600	945.00	3,402,000	貸付株式数	100株
日本トランスシティ	13,000	582.00	7,566,000		
ケイヒン	1,200	1,368.00	1,641,600	貸付株式数	300株
中央倉庫	3,500	1,205.00	4,217,500		
川西倉庫	1,100	1,109.00	1,219,900	貸付株式数	100株
安田倉庫	4,700	981.00	4,610,700		
ファイズホールディングス	1,400	1,049.00	1,468,600	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,800	1,444.00	2,599,200		
宇徳	5,100	486.00	2,478,600	貸付株式数	1,200株
上組	33,900	1,865.00	63,223,500		
サンリツ	1,500	709.00	1,063,500		
キムラユニティー	1,200	1,066.00	1,279,200		
キューソー流通システム	1,600	1,672.00	2,675,200	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	12,800	2,294.00	29,363,200	貸付株式数	5,400株
東海運	3,100	322.00	998,200	貸付株式数	1,300株
エーアイテイー	4,400	965.00	4,246,000		
内外トランスライン	2,100	1,359.00	2,853,900	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	900	1,008.00	907,200		
日本コンセプト	1,900	1,745.00	3,315,500	貸付株式数	700株
TBSホールディングス	37,700	1,911.00	72,044,700		
日本テレビHLD S	52,000	1,143.00	59,436,000	貸付株式数	12,700株
朝日放送グループHD	6,400	703.00	4,499,200	貸付株式数	2,500株



テレビ朝日HD	17,100	1,705.00	29,155,500	貸付株式数	7,300株
スカパーJ S A T H D	41,500	525.00	21,787,500		
テレビ東京HD	5,000	2,297.00	11,485,000		
日本BS放送	2,100	1,087.00	2,282,700	貸付株式数	800株
ビジョン	6,700	1,023.00	6,854,100	貸付株式数	2,400株
スマートバリュー	1,800	964.00	1,735,200	貸付株式数	600株
USEN - NEXT HL DGS	2,500	1,372.00	3,430,000	貸付株式数	1,000株
ワイヤレスゲート	3,000	573.00	1,719,000	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	3,400	1,411.00	4,797,400		
日本通信	49,200	183.00	9,003,600	貸付株式数	20,600株
クロップス	1,200	776.00	931,200		
日本電信電話	834,100	2,673.00	2,229,549,300		
KDDI	455,000	3,022.00	1,375,010,000		
ソフトバンク	567,700	1,346.00	764,124,200		
光通信	6,400	24,700.00	158,080,000		
エムティーアイ	6,400	882.00	5,644,800	貸付株式数	500株
GMOインターネット	22,600	2,874.00	64,952,400	貸付株式数	9,400株
ファイバーゲート	2,100	2,579.00	5,415,900	貸付株式数	800株
アйдママーケティングコ ミュ	2,100	428.00	898,800		
KADOKAWA	16,900	3,690.00	62,361,000		
学研ホールディングス	8,400	1,713.00	14,389,200		
ゼンリン	12,400	1,275.00	15,810,000		
昭文社ホールディングス	2,900	497.00	1,441,300	貸付株式数	1,200株
インプレスホールディング ス	5,300	175.00	927,500		

東京電力HD	505,800	274.00	138,589,200	貸付株式数	196,800株
中部電力	195,000	1,241.00	241,995,000		
関西電力	240,700	967.20	232,805,040		
中国電力	91,600	1,251.00	114,591,600	貸付株式数	39,000株
北陸電力	58,200	677.00	39,401,400		
東北電力	159,300	864.00	137,635,200		
四国電力	57,700	672.00	38,774,400		
九州電力	131,100	892.00	116,941,200		
北海道電力	58,800	381.00	22,402,800		
沖縄電力	12,700	1,401.00	17,792,700		
電源開発	50,900	1,388.00	70,649,200		
エフオン	3,700	1,161.00	4,295,700	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,300	1,945.00	18,088,500	貸付株式数	3,800株
レノバ	10,700	3,300.00	35,310,000	貸付株式数	4,500株
東京瓦斯	122,400	2,337.50	286,110,000		
大阪瓦斯	123,500	2,051.00	253,298,500		
東邦瓦斯	31,300	6,410.00	200,633,000	貸付株式数	8,600株
北海道瓦斯	3,400	1,577.00	5,361,800		
広島ガス	12,400	374.00	4,637,600	貸付株式数	5,600株
西部瓦斯	7,100	3,165.00	22,471,500		
静岡ガス	18,000	1,010.00	18,180,000		
メタウォーター	6,200	2,344.00	14,532,800		
アイネット	3,100	1,576.00	4,885,600	貸付株式数	1,300株
松竹	4,100	13,930.00	57,113,000	貸付株式数	1,400株
東宝	36,800	4,325.00	159,160,000		
エイチ・アイ・エス	9,100	1,609.00	14,641,900	貸付株式数	4,000株
東映	2,300	16,170.00	37,191,000	貸付株式数	900株

ラックランド	1,500	2,365.00	3,547,500	貸付株式数	600株
N T Tデータ	165,800	1,367.00	226,648,600		
共立メンテナンス	10,100	3,810.00	38,481,000	貸付株式数	4,200株
イチネンホールディングス	6,700	1,286.00	8,616,200	貸付株式数	2,800株
建設技術研究所	4,000	2,138.00	8,552,000		
スペース	4,100	826.00	3,386,600	貸付株式数	1,600株
長 大	2,500	1,381.00	3,452,500		
アインホールディングス	7,700	6,680.00	51,436,000	貸付株式数	1,000株
燦ホールディングス	2,700	1,253.00	3,383,100	貸付株式数	300株
ピー・シー・エー	1,100	4,430.00	4,873,000		
スバル興業	400	8,620.00	3,448,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,306.00	3,003,800	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,100	1,342.00	1,476,200		
ビジネスB太田昭和	2,200	1,535.00	3,377,000		
ナ ガ ワ	1,900	9,380.00	17,822,000	貸付株式数	800株
よみうりランド	1,400	6,030.00	8,442,000		
東京都競馬	4,000	4,645.00	18,580,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,200	1,434.00	3,154,800	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,700	2,280.00	24,396,000	貸付株式数	4,200株
東京ドーム	26,400	1,302.00	34,372,800	貸付株式数	7,000株
D T S	13,800	2,225.00	30,705,000	貸付株式数	5,100株
スクウェア・エニックス・ H D	26,700	6,590.00	175,953,000	貸付株式数	11,300株
シーイーシー	6,500	1,532.00	9,958,000		
カプコン	29,500	6,870.00	202,665,000		
西尾レントオール	5,600	2,174.00	12,174,400	貸付株式数	2,400株
アイ・エス・ビー	1,400	3,070.00	4,298,000		

アゴーラ・ホスピタリ ティーG	44,700	24.00	1,072,800	
日本空港ビルデング	20,000	6,750.00	135,000,000	貸付株式数 8,500株
トランス・コスモス	5,800	2,720.00	15,776,000	
乃村工藝社	26,100	828.00	21,610,800	
ジャステック	4,100	1,356.00	5,559,600	
S C S K	14,300	5,650.00	80,795,000	
藤田観光	2,700	1,427.00	3,852,900	貸付株式数 1,100株 (100株)
KNT - CTホールディン グス	3,900	913.00	3,560,700	貸付株式数 1,500株
日本管財	6,400	2,042.00	13,068,800	
トーカイ	5,900	2,046.00	12,071,400	
白 洋 舎	700	2,444.00	1,710,800	貸付株式数 300株
セコム	64,500	9,389.00	605,590,500	
日本システムウエア	2,000	2,157.00	4,314,000	
セントラル警備保障	2,900	3,615.00	10,483,500	
アイネス	6,300	1,415.00	8,914,500	貸付株式数 2,100株
丹青社	11,600	838.00	9,720,800	貸付株式数 1,400株
メイテック	7,500	5,140.00	38,550,000	
T K C	5,200	6,890.00	35,828,000	貸付株式数 2,200株
富士ソフト	6,700	5,130.00	34,371,000	貸付株式数 2,800株
応用地質	6,900	1,235.00	8,521,500	
船井総研ホールディン	12,600	2,559.00	32,243,400	
N S D	20,000	2,077.00	41,540,000	
進学会ホールディングス	2,500	451.00	1,127,500	貸付株式数 1,000株
丸紅建材リース	300	1,693.00	507,900	

オオバ	4,400	738.00	3,247,200		
コナミホールディングス	22,600	5,900.00	133,340,000		
いであ	1,500	1,828.00	2,742,000	貸付株式数	600株
学 究 社	1,800	1,288.00	2,318,400		
ベネッセホールディングス	20,400	2,096.00	42,758,400		
イオンディライト	7,500	2,579.00	19,342,500		
ナック	3,100	928.00	2,876,800	貸付株式数	600株
福井コンピュータHLD S	2,500	3,635.00	9,087,500	貸付株式数	1,000株
ダイセキ	10,200	3,005.00	30,651,000	貸付株式数	100株
ステップ	2,100	1,615.00	3,391,500	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,300	3,785.00	16,275,500		
泉州電業	1,800	3,210.00	5,778,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,600	2,325.00	3,720,000	貸付株式数	600株 (500株)
トラスコ中山	14,400	2,903.00	41,803,200	貸付株式数	4,200株
ヤマダホールディングス	191,000	538.00	102,758,000	貸付株式数	61,200株
オートバックスセブン	23,200	1,395.00	32,364,000		
モリト	4,700	664.00	3,120,800		
アークランドサカモト	9,900	1,736.00	17,186,400		
ニトリホールディングス	27,100	21,995.00	596,064,500		
グルメ杵屋	4,000	991.00	3,964,000	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛 眼	4,800	250.00	1,200,000	貸付株式数	2,100株
ケーユーホールディングス	2,900	826.00	2,395,400	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	20,700	1,908.00	39,495,600	貸付株式数	8,700株
加藤産業	9,100	3,390.00	30,849,000	貸付株式数	2,300株
北恵	1,600	897.00	1,435,200		

イノテック	3,300	997.00	3,290,100		
イエローハット	11,600	1,606.00	18,629,600	貸付株式数	5,000株
松屋フーズHLDGS	2,900	3,365.00	9,758,500	貸付株式数	300株
JBCホールディングス	4,100	1,444.00	5,920,400		
JKホールディングス	5,600	881.00	4,933,600	貸付株式数	2,100株
サガミホールディングス	8,400	1,258.00	10,567,200	貸付株式数	3,500株
日 伝	5,700	2,281.00	13,001,700	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	4,900	1,205.00	5,904,500		
ミロク情報サービス	5,500	2,006.00	11,033,000	貸付株式数	1,100株 (400株)
北沢産業	5,200	274.00	1,424,800	貸付株式数	100株
杉本商事	3,400	2,512.00	8,540,800	貸付株式数	1,100株
因幡電機産業	17,700	2,558.00	45,276,600	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,500	5,790.00	26,055,000		
プレナス	7,100	1,753.00	12,446,300	貸付株式数	1,100株
ミニストップ	4,700	1,418.00	6,664,600	貸付株式数	1,900株
アークス	12,600	2,270.00	28,602,000	貸付株式数	4,300株
パローホールディングス	13,800	2,659.00	36,694,200		
東 テ ク	2,100	2,778.00	5,833,800	貸付株式数	200株
ミスミグループ本社	78,400	3,425.00	268,520,000		
藤 久	1,200	833.00	999,600	貸付株式数	400株
アルテック	5,600	308.00	1,724,800	貸付株式数	1,900株
ベ ル ク	3,100	6,190.00	19,189,000		
大 庄	3,200	991.00	3,171,200	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	1,900	1,958.00	3,720,200	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	8,400	84,560.00	710,304,000		
ソフトバンクグループ	495,300	8,354.00	4,137,736,200		

蔵王産業	1,100	1,372.00	1,509,200		
スズケン	26,500	3,935.00	104,277,500	貸付株式数	1,300株
サンドラッグ	23,500	4,160.00	97,760,000		
サックスバーホールディング	5,100	539.00	2,748,900	貸付株式数	2,200株
ジェコス	4,100	979.00	4,013,900		
ヤマザワ	1,200	1,785.00	2,142,000	貸付株式数	500株
やまや	1,000	2,153.00	2,153,000		
グローセル	5,700	450.00	2,565,000	貸付株式数	600株
ベルーナ	13,400	1,044.00	13,989,600	貸付株式数	5,700株
合計			157,993,811,340		

(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せん。

ソニー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
本田技研	30,000株	三菱UFJフィナンシャルG	200,000株
三井住友フィナンシャルG	30,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	707,357,143	273,117,006
コール・ローン	3,881,924,324	4,342,148,797
株式	123,585,676,323	155,418,316,420
投資証券	3,533,744,490	3,675,537,050
派生商品評価勘定	9,627,771	35,304,583
未収入金	2,144,789	59,317,136
未収配当金	145,384,795	129,709,291
差入委託証拠金	1,916,588,000	2,484,597,565
流動資産合計	133,782,447,635	166,418,047,848
資産合計	133,782,447,635	166,418,047,848
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,395,573	14,756,178
未払金	20,849,385	8,961,660
未払解約金	194,134,100	2,439,902,053
流動負債合計	221,379,058	2,463,619,891



負債合計		221,379,058	2,463,619,891
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,884,230,145	53,363,008,733
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		85,676,838,432	110,591,419,224
元本等合計		133,561,068,577	163,954,427,957
純資産合計		133,561,068,577	163,954,427,957
負債純資産合計		133,782,447,635	166,418,047,848

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な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な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な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。

<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>
-----------------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日	2019年12月19日
期首元本額	44,096,261,199円	47,884,230,145円
期中追加設定元本額	10,685,063,775円	16,305,439,478円
期中一部解約元本額	6,897,094,829円	10,826,660,890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 V A	459,891,676円	413,652,679円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	12,135,579円	6,008,769円

ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	133,457,323円	104,337,898円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	18,713,870円	13,282,741円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	459,765,228円	341,490,682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)	9,340,416円	23,557,605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)	543,057,737円	532,054,270円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	1,911,761,435円	2,224,733,038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)	535,710,578円	642,685,076円
D-I's 外国株式インデックス	2,791,904円	11,166,825円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	2,288,919円	6,448,626円

i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,176,446,112円	2,155,017,720円
i F r e e 8資産バランス	835,395,033円	1,024,708,121円
i F r e e 年金バランス	26,977,520円	58,404,777円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	29,487,171,890円	33,252,767,831円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	573,572,423円	573,806,614円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	873,279,649円	971,059,550円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	678,322,151円	720,326,091円
大和D C 海外株式インデック スファンド	1,501,546,937円	1,544,063,117円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,984,064円	- 円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,416,386円	11,346,854円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,930,998円	7,806,988円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	164,215,275円	470,237,646円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	348,591円	2,119,892円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	121,712円	2,068,375円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	530,015円	2,584,033円

ダイワ世界バランスファンド 40VA	177,817,695円	151,581,899円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	313,874,830円	273,109,607円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,605,295,399円	2,200,857,974円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	126,914,123円	106,162,087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・インデックスセレク ト 外国株式	675,635,286円	795,415,836円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	114,168,565円	187,448,192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）	1,595,581,808円	1,428,539,384円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,705,159,602円	2,722,831,827円
ダイワライフスタイル25	18,324,834円	16,727,001円
ダイワライフスタイル50	67,071,616円	63,073,407円
ダイワライフスタイル75	54,212,966円	50,068,112円
計	47,884,230,145円	53,363,008,733円
2. 期末日における受益権の総数	47,884,230,145口	53,363,008,733口

（金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	1,939,703,834	3,551,878,921
投資証券	116,003,488	30,358,987
合計	1,823,700,346	3,582,237,908

(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2019年12月18日まで、及び2020年12月1日から2020年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

種 類	2019年12月18日 現在				2020年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	6,479,532,777	-	6,473,561,985	5,970,792	4,738,563,197	-	4,766,828,344	28,265,147
合計	6,479,532,777	-	6,473,561,985	5,970,792	4,738,563,197	-	4,766,828,344	28,265,147

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	2019年12月18日 現在				2020年12月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	3,732,321,510	-	3,741,524,500	9,202,990	1,869,292,542	-	1,861,575,800	7,716,742
アメリカ・ドル	3,016,718,160	-	3,017,784,000	1,065,840	1,468,702,530	-	1,454,979,000	13,723,530
イギリス・ポンド	49,485,450	-	50,253,000	767,550	63,973,902	-	64,395,400	421,498
オーストラリア・ドル	51,869,440	-	52,451,000	581,560	53,655,910	-	55,013,000	1,357,090
カナダ・ドル	127,720,310	-	128,789,500	1,069,190	49,761,572	-	50,238,600	477,028
スイス・フラン	87,713,600	-	89,416,000	1,702,400	11,489,660	-	11,673,000	183,340
ユーロ	398,814,550	-	402,831,000	4,016,450	221,708,968	-	225,276,800	3,567,832

合計	3,732,321,510	-	3,741,524,500	9,202,990	1,869,292,542	-	1,861,575,800	7,716,742

(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。

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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。  
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.7892円	3.0724円
(1万口当たり純資産額)	(27,892円)	(30,724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 SOLUTION	3,750	150.830	565,612.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,230	331.400	1,070,422.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,100	126.860	773,846.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	89.040	391,776.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,780	148.910	265,059.800	
	SYNCHRONY FINANCIAL	17,300	33.300	576,090.000	
	ABBOTT LABORATORIES	57,916	108.780	6,300,102.480	
	HOWMET AEROSPACE INC	13,233	26.960	356,761.680	
	VERISK ANALYTICS INC	5,150	201.240	1,036,386.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	11,100	57.340	636,474.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	9,650	132.170	1,275,440.500	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,450	341.470	495,131.500	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	20,262	145.970	2,957,644.140	
	QORVO INC	3,850	159.600	614,460.000	
	AFLAC INC	22,550	44.810	1,010,465.500	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,350	118.620	515,997.000		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,050	73.980	373,599.000		
ADOBE INC	15,770	495.360	7,811,827.200		

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,050	37.540	264,657.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,100	386.070	1,582,887.000	
GARMIN LTD	4,650	118.630	551,629.500	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,310	268.600	1,963,466.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,750	211.940	4,821,635.000	
WR BERKLEY CORP	4,575	66.740	305,335.500	
AUTOZONE INC	770	1,180.890	909,285.300	
DOLLAR TREE INC	7,721	113.050	872,859.050	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	36,650	10.300	377,495.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,800	79.320	301,416.000	
CELANESE CORP	3,950	130.960	517,292.000	
DR HORTON INC	11,316	73.470	831,386.520	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	53.270	372,890.000	
AUTODESK INC	7,230	297.350	2,149,840.500	
MOODY'S CORP	5,570	280.060	1,559,934.200	
ALBEMARLE CORP	3,550	137.480	488,054.000	
ATMOS ENERGY CORP	4,000	99.090	396,360.000	
ALLIANT ENERGY CORP	8,050	51.730	416,426.500	
CITIGROUP INC	68,173	60.050	4,093,788.650	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,150	177.340	2,509,361.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,400	83.860	1,375,304.000	
ALLEGHANY CORP	480	600.790	288,379.200	
DOMINO'S PIZZA INC	1,270	395.160	501,853.200	
HESS CORP	9,000	56.670	510,030.000	
DAVITA INC	2,750	115.730	318,257.500	

DANAHER CORP	20,850	224.490	4,680,616.500	
FORTIVE CORP	9,850	69.330	682,900.500	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	18,050	112.790	2,035,859.500	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,400	49.380	908,592.000	
BUNGE LTD	4,450	64.000	284,800.000	
TE CONNECTIVITY LTD	10,675	116.160	1,240,008.000	
APPLE INC	558,400	128.700	71,866,080.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,200	87.480	892,296.000	
BOEING CO/THE	17,560	221.240	3,884,974.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,165	84.290	435,357.850	
BECTON DICKINSON AND CO	9,419	248.700	2,342,505.300	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	18.720	125,424.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,350	104.830	456,010.500	
NISOURCE INC	12,600	22.810	287,406.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,450	92.290	410,690.500	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,021	40.410	1,051,508.610	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	135,504	60.010	8,131,595.040	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	45,550	224.680	10,234,174.000	
ANSYS INC	2,780	346.630	963,631.400	
TRUIST FINANCIAL CORP	44,417	47.100	2,092,040.700	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	22,200	65.340	1,450,548.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	74,000	62.540	4,627,960.000	
JPMORGAN CHASE & CO	99,770	119.670	11,939,475.900	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,700	151.300	1,165,010.000	
LKQ CORP	9,150	37.120	339,648.000	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,660	167.540	278,116.400	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,062	78.910	793,992.420	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,300	127.300	1,183,890.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,010	190.050	762,100.500	
DOLLAR GENERAL CORP	8,350	212.550	1,774,792.500	
SERVICENOW INC	6,260	554.070	3,468,478.200	
CATERPILLAR INC	17,650	179.170	3,162,350.500	
BROWN & BROWN INC	7,950	46.690	371,185.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,300	46.860	342,078.000	
CMS ENERGY CORP	9,300	59.510	553,443.000	
MOSAIC CO/THE	12,050	23.100	278,355.000	
DELTA AIR LINES INC	5,150	41.110	211,716.500	
CORNING INC	24,600	36.590	900,114.000	
CISCO SYSTEMS INC	138,250	44.820	6,196,365.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,200	51.190	214,998.000	
MORGAN STANLEY	44,402	64.670	2,871,477.340	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	142.890	300,069.000	
MSCI INC	2,820	436.780	1,231,719.600	
FAIR ISAAC CORP	1,000	527.430	527,430.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,100	280.590	308,649.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,500	71.840	538,800.000	
BROADCOM INC	13,052	426.100	5,561,457.200	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,780	138.650	524,097.000	
ARAMARK	7,200	37.920	273,024.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,250	29.160	211,410.000	
DTE ENERGY COMPANY	6,250	123.550	772,187.500	



CENTENE CORP	18,987	62.090	1,178,902.830	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,500	89.540	313,390.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,300	34.780	497,354.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,150	128.190	788,368.500	
GARTNER INC	2,920	157.050	458,586.000	
SPLUNK INC	5,180	166.260	861,226.800	
DOMINION ENERGY INC	27,641	75.930	2,098,781.130	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,850	90.140	1,158,299.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,250	55.260	234,855.000	
DEERE & CO	9,650	264.530	2,552,714.500	
POOL CORP	1,350	356.150	480,802.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,884	195.420	1,931,531.280	
VMWARE INC-CLASS A	2,830	148.100	419,123.000	
CABLE ONE INC	170	2,204.570	374,776.900	
BURLINGTON STORES INC	2,190	245.160	536,900.400	
NASDAQ INC	3,700	128.500	475,450.000	
VAIL RESORTS INC	1,360	278.530	378,800.800	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,250	117.790	265,027.500	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,430	87.080	211,604.400	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,900	71.620	780,658.000	
COGNEX CORP	5,500	79.790	438,845.000	
TELEFLEX INC	1,500	402.900	604,350.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,800	138.710	388,388.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,400	273.580	656,592.000	

BIO-RAD LABORATORIES-A	710	584.240	414,810.400	
CATALENT INC	5,150	103.620	533,643.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,480	279.890	1,253,907.200	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	203.650	407,300.000	
IDEX CORP	2,520	197.880	498,657.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,800	85.660	2,295,688.000	
ROLLINS INC	7,387	40.210	297,031.270	
AMETEK INC	7,425	117.630	873,402.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,200	87.210	715,122.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,350	41.400	180,090.000	
HEICO CORP	1,400	131.560	184,184.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	119.180	369,458.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,100	218.600	459,060.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,240	345.230	428,085.200	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,850	90.100	797,385.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,300	455.280	591,864.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	14,440	370.290	5,346,987.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,600	126.030	327,678.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,800	344.200	619,560.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,350	89.460	389,151.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	880	1,409.680	1,240,518.400	
UGI CORP	7,050	35.990	253,729.500	
CUMMINS INC	4,850	223.430	1,083,635.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,300	88.460	2,238,038.000	
CDW CORP/DE	4,650	135.240	628,866.000	

COSTAR GROUP INC	1,310	893.970	1,171,100.700	
SVB FINANCIAL GROUP	1,710	364.860	623,910.600	
AMERCO	290	448.350	130,021.500	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,150	196.060	617,589.000	
MERCADOLIBRE INC	1,480	1,679.990	2,486,385.200	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,500	162.760	406,900.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,016	104.700	943,975.200	
IPG PHOTONICS CORP	1,170	217.020	253,913.400	
DEXCOM INC	3,000	357.910	1,073,730.000	
NORDSON CORP	1,730	196.910	340,654.300	
COPART INC	6,850	121.680	833,508.000	
SEAGEN INC	3,950	197.920	781,784.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,510	526.720	1,322,067.200	
TRANSDIGM GROUP INC	1,710	598.350	1,023,178.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,800	100.150	280,420.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,400	69.310	512,894.000	
KINDER MORGAN INC	67,381	14.300	963,548.300	
HCA HEALTHCARE INC	9,000	164.750	1,482,750.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,220	577.350	704,367.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,400	17.230	213,652.000	
T-MOBILE US INC	18,327	130.010	2,382,693.270	
ZILLOW GROUP INC - C	4,550	138.530	630,311.500	
COCA-COLA CO/THE	133,600	53.270	7,116,872.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,500	47.260	307,190.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,550	94.030	521,866.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,500	25.160	239,020.000	

CSX CORP	25,250	90.550	2,286,387.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,130	202.690	634,419.700	
EXPEDIA GROUP INC	4,375	124.480	544,600.000	
AUTOLIV INC	2,750	92.910	255,502.500	
AMAZON.COM INC	13,880	3,236.080	44,916,790.400	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,240	86.520	1,751,164.800	
EXXON MOBIL CORP	138,405	43.480	6,017,849.400	
AES CORP	21,900	22.090	483,771.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	235.160	317,466.000	
EOG RESOURCES INC	19,300	52.150	1,006,495.000	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	5,200	105.610	549,172.000	
ABIOMED INC	1,520	281.990	428,624.800	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,950	98.740	488,763.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,140	118.970	1,206,355.800	
FORD MOTOR CO	126,323	9.080	1,147,012.840	
DISCOVERY INC - A	4,690	28.740	134,790.600	
EXACT SCIENCES CORP	4,850	136.040	659,794.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	25.560	124,911.720	
LIBERTY BROADBAND-A	850	159.620	135,677.000	
DISCOVERY INC-C	10,389	25.310	262,945.590	
FORTINET INC	4,800	136.420	654,816.000	
MARKEL CORP	460	1,011.000	465,060.000	
NEXTERA ENERGY INC	64,080	75.060	4,809,844.800	
MASIMO CORP	1,700	267.720	455,124.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	47,208	24.720	1,166,981.760	

INSULET CORP	2,220	240.920	534,842.400	
US BANCORP	44,150	45.280	1,999,112.000	
UNITED RENTALS INC	2,350	229.160	538,526.000	
F5 NETWORKS INC	1,900	174.500	331,550.000	
FASTENAL CO	18,600	49.570	922,002.000	
FISERV INC	18,583	114.700	2,131,470.100	
GENERAL ELECTRIC CO	288,050	10.880	3,133,984.000	
GENERAL MOTORS CO	42,600	42.030	1,790,478.000	
ZENDESK INC	3,900	140.090	546,351.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,950	151.590	1,205,140.500	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,760	244.430	2,630,066.800	
ALPHABET INC-CL A	9,820	1,740.510	17,091,808.200	
ALPHABET INC-CL C	9,807	1,747.900	17,141,655.300	
OWENS CORNING	3,350	77.170	258,519.500	
GENERAL MILLS INC	20,050	59.700	1,196,985.000	
FIRSTENERGY CORP	18,068	30.500	551,074.000	
GENUINE PARTS CO	4,850	96.950	470,207.500	
IHS MARKIT LTD	12,584	87.680	1,103,365.120	
FIFTH THIRD BANCORP	23,000	27.130	623,990.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,160	185.710	1,329,683.600	
HALLIBURTON CO	27,600	20.080	554,208.000	
HOME DEPOT INC	35,200	273.970	9,643,744.000	
ASSURANT INC	1,900	132.370	251,503.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,800	12.340	392,412.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,290	170.470	219,906.300	

HERSHEY CO/THE	4,740	151.610	718,631.400	
HUMANA INC	4,350	396.340	1,724,079.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,300	158.060	1,469,958.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,360	387.630	914,806.800	
HENRY SCHEIN INC	4,500	68.890	310,005.000	
HP INC	47,300	24.220	1,145,606.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	41,900	12.180	510,342.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	43.580	260,521.240	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	6,500	42.270	274,755.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	43.340	127,853.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,200	35.550	469,260.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	21,753	34.620	753,088.860	
ENPHASE ENERGY INC	4,000	163.520	654,080.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29,150	125.550	3,659,782.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	12,200	49.750	606,950.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,350	88.890	386,671.500	
ZOETIS INC	15,600	162.700	2,538,120.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,979	140.970	1,124,799.630	
CHENIERE ENERGY INC	7,650	58.960	451,044.000	
ALLEGION PLC	2,900	112.820	327,178.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	24.690	320,303.370	
WASTE CONNECTIONS INC	8,507	102.450	871,542.150	
JUNIPER NETWORKS INC	10,500	22.230	233,415.000	

SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,400	171.060	410,544.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,670	115.320	423,224.400	
JOHNSON & JOHNSON	86,200	153.620	13,242,044.000	
ABBVIE INC	57,772	104.890	6,059,705.080	
HOLOGIC INC	8,350	75.100	627,085.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,250	136.320	1,533,600.000	
KROGER CO	25,500	31.000	790,500.000	
KLA CORP	5,030	259.680	1,306,190.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,260	352.600	2,912,476.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,780	282.010	783,987.800	
LOWE'S COS INC	24,450	163.540	3,998,553.000	
ELI LILLY & CO	28,185	172.630	4,865,576.550	
LAM RESEARCH CORP	4,820	486.240	2,343,676.800	
LOEWS CORP	8,300	44.410	368,603.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,249	49.460	309,075.540	
MCDONALD'S CORP	24,300	214.250	5,206,275.000	
3M CO	18,850	176.650	3,329,852.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	78,450	274.480	21,532,956.000	
S&P GLOBAL INC	7,900	321.060	2,536,374.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,110	265.730	560,690.300	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,700	305.700	519,690.000	
CONCHO RESOURCES INC	6,200	61.070	378,634.000	
PHILLIPS 66	14,150	67.170	950,455.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	31.120	474,580.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,100	94.600	766,260.000	
METLIFE INC	25,550	46.490	1,187,819.500	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	21,700	47.100	1,022,070.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,870	285.370	533,641.900	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	42.510	204,048.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,658	169.650	959,879.700	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	800	1,130.330	904,264.000	
BAKER HUGHES CO	21,373	21.500	459,519.500	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,760	247.190	929,434.400	
MERCK & CO. INC.	82,621	79.820	6,594,808.220	
DUPONT DE NEMOURS INC	24,218	69.490	1,682,908.820	
MASCO CORP	8,700	55.280	480,936.000	
M & T BANK CORP	4,289	125.830	539,684.870	
MARSH & MCLENNAN COS	16,850	118.690	1,999,926.500	
BLACK KNIGHT INC	5,000	90.470	452,350.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,500	118.040	295,100.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	9,122	130.290	1,188,505.380	
WORKDAY INC-CLASS A	5,680	239.810	1,362,120.800	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,100	285.060	598,626.000	
SQUARE INC - A	11,800	230.740	2,722,732.000	
TRANSUNION	6,150	99.600	612,540.000	
VISTRA CORP	14,250	17.930	255,502.500	
NOVOCURE LTD	2,900	162.810	472,149.000	
NETAPP INC	7,450	64.120	477,694.000	
NIKE INC -CL B	40,600	140.500	5,704,300.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,450	230.690	1,949,330.500	



MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,000	139.720	1,117,760.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,150	94.770	393,295.500	
ALLY FINANCIAL INC	12,550	34.020	426,951.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,220	300.680	1,569,549.600	
APTIV PLC	8,700	124.890	1,086,543.000	
NEWMONT CORP	26,461	61.640	1,631,056.040	
MCKESSON CORP	5,250	172.910	907,777.500	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,700	85.840	746,808.000	
XYLEM INC	5,870	99.750	585,532.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	51,000	85.670	4,369,170.000	
NUCOR CORP	9,900	55.450	548,955.000	
SUNRUN INC	3,900	62.310	243,009.000	
WESTERN UNION CO	12,946	23.080	298,793.680	
GODADDY INC - CLASS A	5,700	86.820	494,874.000	
NEWELL BRANDS INC	12,542	20.090	251,968.780	
EVERGY INC	7,400	54.040	399,896.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,224	19.180	579,696.320	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	820	247.680	203,097.600	
OKTA INC	3,860	271.370	1,047,488.200	
COUPA SOFTWARE INC	2,180	356.000	776,080.000	
LIBERTY BROADBAND-C	3,600	162.400	584,640.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	13,355	30.490	407,193.950	
LINDE PLC	17,196	256.630	4,413,009.480	
WIX.COM LTD	1,780	270.050	480,689.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	25.870	344,071.000	
KKR & CO INC	16,300	40.420	658,846.000	

PAYCHEX INC	10,700	95.650	1,023,455.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,410	451.830	1,088,910.300	
ALTRIA GROUP INC	61,150	43.000	2,629,450.000	
P G & E CORP	46,500	12.240	569,160.000	
PFIZER INC	181,913	38.030	6,918,151.390	
CIGNA CORP	12,160	202.630	2,463,980.800	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,851	74.710	586,548.210	
ALTICE USA INC- A	10,900	35.340	385,206.000	
XCEL ENERGY INC	17,450	67.010	1,169,324.500	
STERIS PLC	2,850	182.640	520,524.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	28.160	152,993.280	
FOX CORP - CLASS A	10,849	28.540	309,630.460	
STRYKER CORP	11,120	238.100	2,647,672.000	
DOW INC	24,068	53.830	1,295,580.440	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,800	68.000	190,400.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,580	401.620	2,241,039.600	
PARKER HANNIFIN CORP	4,170	273.300	1,139,661.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	31,500	50.630	1,594,845.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,350	114.380	611,933.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	80,917	138.250	11,186,775.250	
EXELON CORP	32,272	42.650	1,376,400.800	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,350	157.930	1,160,785.500	
TELADOC HEALTH INC	3,600	196.810	708,516.000	
INGERSOLL-RAND INC	11,358	45.440	516,107.520	
NVR INC	110	4,219.800	464,178.000	

CONOCOPHILLIPS	35,500	41.970	1,489,935.000	
TWILIO INC - A	4,050	361.070	1,462,333.500	
DOCUSIGN INC	5,750	247.000	1,420,250.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,610	441.800	711,298.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,500	97.390	438,255.000	
PEPSICO INC	45,400	145.710	6,615,234.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	124.710	162,123.000	
DROPBOX INC-CLASS A	8,000	23.890	191,120.000	
MONGODB INC	1,620	372.850	604,017.000	
SNAP INC - A	29,500	53.250	1,570,875.000	
CORTEVA INC	24,818	39.680	984,778.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,800	77.660	994,048.000	
AMCOR PLC	52,200	11.560	603,432.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,650	185.250	861,412.500	
ROKU INC	3,350	329.480	1,103,758.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,000	151.860	911,160.000	
ACCENTURE PLC-CL A	20,850	264.470	5,514,199.500	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	12,600	42.540	536,004.000	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,100	151.300	317,730.000	
PENTAIR PLC	5,505	52.770	290,498.850	
QUALCOMM INC	36,450	149.530	5,450,368.500	
INVESCO LTD	12,000	17.480	209,760.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	160.340	376,799.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,200	48.400	445,280.000	

DATADOG INC - CLASS A	4,350	108.700	472,845.000	
PINTEREST INC- CLASS A	14,900	71.000	1,057,900.000	
AVALARA INC	2,500	177.660	444,150.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,320	496.210	1,647,417.200	
REPUBLIC SERVICES INC	7,400	96.890	716,986.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,350	2,113.430	2,853,130.500	
ROSS STORES INC	11,800	116.690	1,376,942.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,100	135.650	420,515.000	
RESMED INC	4,850	213.730	1,036,590.500	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,350	120.720	525,132.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,600	62.350	224,460.000	
MODERNA INC	8,800	144.000	1,267,200.000	
HUBSPOT INC	1,450	393.810	571,024.500	
PERKINELMER INC	3,730	143.420	534,956.600	
CARRIER GLOBAL CORP	26,637	38.700	1,030,851.900	
OTIS WORLDWIDE CORP	13,718	65.790	902,507.220	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	49.040	284,432.000	
AVANTOR INC	15,500	27.440	425,320.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,700	31.150	146,405.000	
DYNATRACE INC	6,100	43.740	266,814.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,330	942.400	1,253,392.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	32,135	15.560	500,020.600	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,000	44.180	176,720.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,530	160.030	404,875.900	
MATCH GROUP INC	8,170	148.750	1,215,287.500	
CHEVRON CORP	61,018	88.410	5,394,601.380	

PELTON INTERACTIVE INC-A	6,500	136.800	889,200.000	
ZSCALER INC	2,400	187.760	450,624.000	
EDISON INTERNATIONAL	12,350	62.900	776,815.000	
ETSY INC	4,000	188.100	752,400.000	
TESLA INC	24,270	655.900	15,918,693.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,000	325.540	325,540.000	
NORTONLIFELOCK INC	17,850	20.560	366,996.000	
DRAFTKINGS INC - CL A	5,800	55.200	320,160.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,022	182.090	914,455.980	
SYNOPSIS INC	5,040	250.290	1,261,461.600	
CARVANA CO	2,100	271.990	571,179.000	
CHEWY INC - CLASS A	2,600	100.180	260,468.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	5,200	81.820	425,464.000	
PPD INC	4,400	34.950	153,780.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,685	653.980	3,063,896.300	
VIATRIS INC	38,621	17.720	684,364.120	
CBRE GROUP INC - A	10,850	64.410	698,848.500	
TWITTER INC	25,950	54.630	1,417,648.500	
SOUTHERN CO/THE	34,750	61.070	2,122,182.500	
SYSCO CORP	16,000	74.440	1,191,040.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,403	138.030	1,159,866.090	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	56.800	244,240.000	
STEEL DYNAMICS INC	6,600	37.590	248,094.000	
SCHLUMBERGER LTD	46,002	22.930	1,054,825.860	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,050	50.800	256,540.000	

AT&T INC	233,291	29.620	6,910,079.420	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,700	46.390	218,033.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,900	31.600	407,640.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,690	726.250	1,953,612.500	
SEMPRA ENERGY	9,670	131.740	1,273,925.800	
TIFFANY & CO	3,650	131.220	478,953.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,650	66.210	506,506.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,750	162.690	4,840,027.500	
SALESFORCE.COM INC	29,421	225.920	6,646,792.320	
WESTROCK CO	8,530	44.980	383,679.400	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	24,484	46.450	1,137,281.800	
TERADYNE INC	5,500	119.350	656,425.000	
UNION PACIFIC CORP	21,980	202.200	4,444,356.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,588	40.580	876,041.040	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	49,479	70.640	3,495,196.560	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	23,050	174.490	4,021,994.500	
IQVIA HOLDINGS INC	6,244	178.950	1,117,363.800	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	57.260	249,081.000	
AMEREN CORPORATION	8,050	78.740	633,857.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	31,016	341.670	10,597,236.720	
VERISIGN INC	3,370	217.930	734,424.100	
VALERO ENERGY CORP	13,142	56.340	740,420.280	
ULTA BEAUTY INC	1,760	272.780	480,092.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,688	39.310	341,525.280	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	139.730	349,325.000	

ANTHEM INC	8,300	314.080	2,606,864.000	
WALT DISNEY CO/THE	59,162	173.550	10,267,565.100	
WELLS FARGO & CO	127,422	29.470	3,755,126.340	
WASTE MANAGEMENT INC	14,000	117.510	1,645,140.000	
WILLIAMS COS INC	40,200	21.800	876,360.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,700	145.510	538,387.000	
WHIRLPOOL CORP	1,950	190.750	371,962.500	
WALMART INC	46,400	146.100	6,779,040.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,750	151.360	1,021,680.000	
WYNN RESORTS LTD	3,050	114.810	350,170.500	
WABTEC CORP	5,861	73.530	430,959.330	
TJX COMPANIES INC	39,400	67.510	2,659,894.000	
WATERS CORP	2,050	250.740	514,017.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,760	375.430	660,756.800	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	24,700	40.880	1,009,736.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,173	212.230	885,635.790	
WESTERN DIGITAL CORP	9,750	53.460	521,235.000	
WEC ENERGY GROUP INC	10,480	92.220	966,465.600	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,800	57.190	960,792.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	55,200	211.180	11,657,136.000	
PPL CORP	24,800	27.350	678,280.000	
PULTEGROUP INC	8,900	44.780	398,542.000	
PPG INDUSTRIES INC	7,850	144.290	1,132,676.500	
NORTHERN TRUST CORP	6,400	92.100	589,440.000	

NVIDIA CORP	20,100	533.650	10,726,365.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,843	145.020	2,007,511.860	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	55.860	296,058.000	
TYSON FOODS INC-CL A	9,800	65.000	637,000.000	
NETFLIX INC	14,400	532.900	7,673,760.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,920	464.940	6,007,024.800	
NRG ENERGY INC	7,950	33.540	266,643.000	
GLOBE LIFE INC	3,225	93.430	301,311.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,700	138.100	787,170.000	
TEXTRON INC	7,150	46.990	335,978.500	
NEWS CORP - CLASS A	13,137	17.710	232,656.270	
OGE ENERGY CORP	6,750	31.520	212,760.000	
OMNICOM GROUP	7,150	63.310	452,666.500	
ORACLE CORP	65,433	63.610	4,162,193.130	
MASTERCARD INC - A	29,200	336.900	9,837,480.000	
ONEOK INC	14,400	40.730	586,512.000	
CENTURYLINK INC	31,152	10.250	319,308.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,420	425.040	1,453,636.800	
YUM! BRANDS INC	9,800	108.790	1,066,142.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,700	197.400	730,380.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,050	45.970	278,118.500	
BANK OF AMERICA CORP	255,601	28.830	7,368,976.830	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,210	380.930	460,925.300	



BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,850	90.200	527,670.000	
AMERICAN EXPRESS CO	22,600	118.980	2,688,948.000	
ANALOG DEVICES INC	12,199	143.780	1,753,972.220	
ADVANCED MICRO DEVICES	38,300	96.840	3,708,972.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	28,322	38.230	1,082,750.060	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,500	145.530	800,415.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,900	73.940	436,246.000	
AVERY DENNISON CORP	2,750	152.230	418,632.500	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,900	81.730	1,462,967.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,700	81.160	1,598,852.000	
AON PLC-CLASS A	7,620	211.300	1,610,106.000	
AMGEN INC	19,250	231.240	4,451,370.000	
EATON CORP PLC	13,086	115.290	1,508,684.940	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,580	217.800	1,215,324.000	
APPLIED MATERIALS INC	30,200	87.500	2,642,500.000	
CME GROUP INC	11,800	184.940	2,182,292.000	
ECOLAB INC	8,450	220.610	1,864,154.500	
EQUIFAX INC	4,050	193.750	784,687.500	
GILEAD SCIENCES INC	41,150	59.070	2,430,730.500	
KEURIG DR PEPPER INC	18,000	31.125	560,250.000	
HORMEL FOODS CORP	9,600	47.770	458,592.000	
STATE STREET CORP	11,743	70.740	830,699.820	
SCHWAB (CHARLES) CORP	50,290	51.780	2,604,016.200	
BAXTER INTERNATIONAL INC	16,900	81.040	1,369,576.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	47.780	286,680.000	

CROWN HOLDINGS INC	4,550	98.080	446,264.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,450	54.220	512,379.000	
FEDEX CORP	8,200	292.260	2,396,532.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,104	94.080	1,420,984.320	
FMC CORP	4,200	115.620	485,604.000	
CERNER CORP	10,050	78.160	785,508.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,824	113.580	320,749.920	
CITRIX SYSTEMS INC	3,800	130.740	496,812.000	
INTEL CORP	138,600	50.650	7,020,090.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,400	23.800	295,120.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,650	46.780	544,987.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,300	206.110	2,122,933.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,600	6.380	220,748.000	
ILLUMINA INC	4,850	361.300	1,752,305.000	
SEALED AIR CORP	5,000	44.790	223,950.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,820	779.780	2,978,759.600	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	119.630	484,501.500	
SNAP-ON INC	1,630	171.160	278,990.800	
CARMAX INC	5,350	99.790	533,876.500	
DUKE ENERGY CORP	24,178	91.520	2,212,770.560	
TARGET CORP	16,280	171.240	2,787,787.200	
DOVER CORP	4,800	123.760	594,048.000	
WW GRAINGER INC	1,490	410.040	610,959.600	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,250	107.000	454,750.000	
CINTAS CORP	2,940	352.000	1,034,880.000	

CONAGRA BRANDS INC	15,800	36.170	571,486.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,750	78.640	373,540.000	
CLOROX COMPANY	4,050	202.340	819,477.000	
ENTERGY CORP	6,650	100.560	668,724.000	
MICROSOFT CORP	234,700	219.420	51,497,874.000	
INCYTE CORP	6,000	88.280	529,680.000	
CVS HEALTH CORP	42,969	69.590	2,990,212.710	
MEDTRONIC PLC	43,898	115.340	5,063,195.320	
MICRON TECHNOLOGY INC	36,650	72.260	2,648,329.000	
BLACKROCK INC	5,000	706.010	3,530,050.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,800	21.880	345,704.000	
HASBRO INC	4,400	93.210	410,124.000	
KELLOGG CO	8,400	62.480	524,832.000	
KEYCORP	32,600	15.580	507,908.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,150	196.620	619,353.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	46,811	57.930	2,711,761.230	
COOPER COS INC/THE	1,770	351.520	622,190.400	
CHUBB LTD	14,869	153.410	2,281,053.290	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	99.200	267,840.000	
ALLSTATE CORP	10,250	106.560	1,092,240.000	
EBAY INC	22,850	53.050	1,212,192.500	
PAYPAL HOLDINGS INC	36,500	235.510	8,596,115.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,550	102.500	466,375.000	
XILINX INC	8,000	151.860	1,214,880.000	
DISH NETWORK CORP-A	8,200	31.410	257,562.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,450	263.830	1,965,533.500	

TRIMBLE INC	8,250	65.970	544,252.500	
LENNAR CORP-A	9,000	79.950	719,550.000	
LEAR CORP	1,800	164.690	296,442.000	
PROGRESSIVE CORP	19,300	96.310	1,858,783.000	
PACCAR INC	11,487	85.770	985,239.990	
BIOGEN INC	5,220	250.240	1,306,252.800	
IDEXX LABORATORIES INC	2,770	477.800	1,323,506.000	
STARBUCKS CORP	38,350	103.210	3,958,103.500	
PTC INC	3,700	118.470	438,339.000	
PERRIGO CO PLC	4,200	46.970	197,274.000	
EVERSOURCE ENERGY	10,980	85.780	941,864.400	
INTUIT INC	8,570	380.320	3,259,342.400	
BORGWARNER INC	8,200	39.000	319,800.000	
BEST BUY CO INC	7,600	102.340	777,784.000	
BALL CORP	10,584	91.980	973,516.320	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	47,097	35.390	1,666,762.830	
ELECTRONIC ARTS INC	9,570	139.850	1,338,364.500	
VULCAN MATERIALS CO	4,350	139.540	606,999.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,550	236.920	2,025,666.000	
VF CORP	10,900	86.550	943,395.000	
VIACOMCBS INC - CLASS B	18,375	36.200	665,175.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	135.250	256,975.000	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,070	174.410	535,438.700	
CARNIVAL CORP	15,300	21.630	330,939.000	
COMCAST CORP-CLASS A	149,090	51.360	7,657,262.400	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	7,200	25.580	184,176.000	

	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,500	56.100	420,750.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,300	4.140	166,842.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 1,075,712,629.440 (111,078,086,116)	
イギリス・ポ ンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	666,500	2.693	1,795,217.750	
	UNILEVER PLC	86,360	43.300	3,739,388.000	
	BARCLAYS PLC	568,800	1.455	827,831.520	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	279,500	1.124	314,297.750	
	PRUDENTIAL PLC	84,900	13.300	1,129,170.000	
	NATWEST GROUP PLC	159,791	1.627	260,059.850	
	EVRAZ PLC	15,000	4.703	70,545.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	25.640	155,480.960	
	BAE SYSTEMS PLC	106,500	4.938	525,897.000	
	AVIVA PLC	128,966	3.319	428,038.150	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	33.010	66,020.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	165,100	13.644	2,252,624.400	
	INFORMA PLC	49,900	5.462	272,553.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	156,500	1.718	268,867.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	5.926	189,039.400	
	DCC PLC	3,150	53.960	169,974.000	
	OCADO GROUP PLC	15,200	22.200	337,440.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,450	113.950	279,177.500		
HALMA PLC	12,250	24.410	299,022.500		

ENTAIN PLC	19,100	11.470	219,077.000	
JD SPORTS FASHION PLC	14,600	8.416	122,873.600	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	19,000	7.256	137,864.000	
M&G PLC	83,700	2.010	168,237.000	
RELX PLC	63,146	17.845	1,126,840.370	
DIAGEO PLC	76,900	29.385	2,259,706.500	
RIO TINTO PLC	37,000	56.050	2,073,850.000	
STANDARD CHARTERED PLC	86,800	4.728	410,390.400	
TESCO PLC	320,700	2.303	738,572.100	
FRESNILLO PLC	6,200	11.590	71,858.000	
SMITH & NEPHEW PLC	29,050	15.325	445,191.250	
GLENCORE PLC	330,725	2.418	799,693.050	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,250	15.100	154,775.000	
SMITHS GROUP PLC	12,383	15.510	192,060.330	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	3.107	130,441.180	
PEARSON PLC	23,563	6.854	161,500.800	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.277	123,470.320	
NEXT PLC	4,450	69.220	308,029.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	117,700	1.630	191,909.850	
WHITBREAD PLC	6,861	31.600	216,807.600	
BUNZL PLC	11,205	23.850	267,239.250	
VODAFONE GROUP PLC	870,183	1.254	1,091,905.620	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,261	63.300	269,721.300	
KINGFISHER PLC	68,211	2.758	188,125.930	
WPP PLC	40,900	8.150	333,335.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,827	9.260	211,378.020	

SEVERN TRENT PLC	7,833	23.440	183,605.520	
RENTOKIL INITIAL PLC	61,200	5.130	313,956.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,450	64.600	1,514,870.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	16,550	11.420	189,001.000	
SCHRODERS PLC	4,150	33.390	138,568.500	
SSE PLC	33,900	14.810	502,059.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	34,000	6.500	221,000.000	
ASTRAZENECA PLC	43,150	75.420	3,254,373.000	
FERGUSON PLC	7,487	88.000	658,856.000	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	195,500	2.587	505,758.500	
3I GROUP PLC	31,391	11.590	363,821.690	
ASHTHEAD GROUP PLC	14,650	32.980	483,157.000	
SAGE GROUP PLC/THE	35,114	5.886	206,681.000	
NATIONAL GRID PLC	114,434	8.756	1,001,984.100	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,296,465	0.362	831,779.620	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	6.766	214,888.160	
IMPERIAL BRANDS PLC	30,400	15.710	477,584.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	44.510	184,716.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	75,360	27.950	2,106,312.000	
BHP GROUP PLC	68,727	19.750	1,357,358.250	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,500	22.940	263,810.000	
HSBC HOLDINGS PLC	669,650	3.947	2,643,443.370	
ANGLO AMERICAN PLC	40,383	24.795	1,001,296.480	
MONDI PLC	15,650	17.920	280,448.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	73,400	1.787	131,165.800	

COMPASS GROUP PLC	58,939	14.065	828,977.030	
PERSIMMON PLC	10,600	26.980	285,988.000	
BT GROUP PLC	290,100	1.385	401,933.550	
COCA-COLA HBC AG-DI	6,550	23.590	154,514.500	
BURBERRY GROUP PLC	13,289	18.275	242,856.470	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,636	46.590	262,581.240	
INTERTEK GROUP PLC	5,200	58.600	304,720.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	10,499	88.800	932,311.200	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	135,000	13.888	1,874,880.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	122,318	13.500	1,651,293.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	24.670	140,619.000	
ADMIRAL GROUP PLC	6,150	29.490	181,363.500	
ANTOFAGASTA PLC	12,800	14.330	183,424.000	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.883	204,295.140	
EXPERIAN PLC	29,654	27.660	820,229.640	
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 53,295,976.810 (7,462,502,673)	
イスラエル・ シュケル	株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,500	11.600	400,200.000	
AZRIELI GROUP LTD	1,400	189.000	264,600.000	
ICL GROUP LTD	23,600	15.330	361,788.000	
ELBIT SYSTEMS LTD	950	408.900	388,455.000	
BANK HAPOALIM BM	35,700	21.900	781,830.000	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,200	19.110	978,432.000	



	NICE LTD	2,200	854.100	1,879,020.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	70.020	287,082.000	
イスラエル・シケル 小計				イスラエル・シケル 5,341,407.000 (170,123,813)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	88,800	2.870	254,856.000	
	BHP GROUP LTD	95,750	43.300	4,145,975.000	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.630	398,708.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,550	23.560	719,758.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,500	22.410	1,266,165.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	102,450	23.850	2,443,432.500	
	WESTPAC BANKING CORP	117,348	20.210	2,371,603.080	
	SANTOS LTD	53,100	6.500	345,150.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	1.825	118,625.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	92,450	23.580	2,179,971.000	
	RIO TINTO LTD	12,250	116.440	1,426,390.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,500	4.970	265,895.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	4.070	244,200.000	
	XERO LTD	4,000	154.000	616,000.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	30.630	104,142.000	
	COLES GROUP LTD	43,045	18.210	783,849.450	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,500	31.650	142,425.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	25,000	12.570	314,250.000	
	EVOLUTION MINING LTD	53,000	4.910	260,230.000	

AFTERPAY LTD	7,000	120.310	842,170.000	
TPG TELECOM LTD	12,000	7.210	86,520.000	
OIL SEARCH LTD	64,200	3.680	236,256.000	
SEEK LTD	10,700	28.440	304,308.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	9.590	225,365.000	
NEWCREST MINING LTD	26,000	27.080	704,080.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	57,450	84.720	4,867,164.000	
AMPOL LTD	7,950	29.930	237,943.500	
ORICA LTD	13,100	15.690	205,539.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	46,450	9.950	462,177.500	
CIMIC GROUP LTD	2,800	26.240	73,472.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	41,300	39.460	1,629,698.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	15,700	12.940	203,158.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	72,763	4.020	292,507.260	
CROWN RESORTS LTD	11,600	9.870	114,492.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	5.100	155,550.000	
TELSTRA CORP LTD	134,500	3.050	410,225.000	
AMP LTD	102,000	1.735	176,970.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,250	39.070	556,747.500	
MACQUARIE GROUP LTD	11,084	141.580	1,569,272.720	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	18,450	30.550	563,647.500	
CSL LTD	14,750	288.160	4,250,360.000	
WESFARMERS LTD	37,000	51.620	1,909,940.000	
COCHLEAR LTD	2,050	198.750	407,437.500	
BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	17.600	286,880.000	

	SUNCORP GROUP LTD	41,257	10.040	414,220.280	
	ASX LTD	6,250	75.350	470,937.500	
	COMPUTERSHARE LTD	15,900	15.250	242,475.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	5.080	360,354.880	
	SONIC HEALTHCARE LTD	14,350	33.390	479,146.500	
	AGL ENERGY LTD	19,000	13.080	248,520.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	10.850	546,840.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,750	64.410	370,357.500	
	REA GROUP LTD	1,600	148.590	237,744.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	56.240	213,712.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 42,757,813.170 (3,361,191,694)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	24.410	202,603.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	1,641.320	1,148,924.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,287	79.090	734,508.830	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	14,900	54.960	818,904.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,650	151.310	703,591.500	
	BCE INC	4,930	55.430	273,269.900	
	FRANCO-NEVADA CORP	6,200	173.990	1,078,738.000	
	SUNCOR ENERGY INC	50,130	22.360	1,120,906.800	
	METRO INC/CN	8,200	57.780	473,796.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	11,000	72.110	793,210.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	39,900	68.110	2,717,589.000	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,650	111.490	1,633,328.500	
TORONTO-DOMINION BANK	59,400	71.970	4,275,018.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,100	29.730	270,543.000	
ROYAL BANK OF CANADA	46,750	104.430	4,882,102.500	
TC ENERGY CORP	31,050	55.510	1,723,585.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	17,829	32.340	576,589.860	
BARRICK GOLD CORP	58,600	30.040	1,760,344.000	
CAE INC	7,900	33.000	260,700.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,712	102.640	586,279.680	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	34.580	183,274.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	60.940	283,371.000	
HYDRO ONE LTD	10,500	28.680	301,140.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	64.670	385,433.200	
NORTHLAND POWER INC	6,500	43.290	281,385.000	
WSP GLOBAL INC	3,700	123.290	456,173.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	91.610	256,508.000	
PARKLAND CORP	4,400	43.490	191,356.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	33.340	176,702.000	
EMERA INC	7,700	54.390	418,803.000	
SSR MINING INC	7,200	25.640	184,608.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	31.320	125,280.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,600	59.450	689,620.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,800	92.960	725,088.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	18,900	20.660	390,474.000	
B2GOLD CORP	34,700	7.380	256,086.000	
AIR CANADA	4,100	23.640	96,924.000	

KINROSS GOLD CORP	40,300	9.590	386,477.000	
BANK OF MONTREAL	21,100	97.580	2,058,938.000	
POWER CORP OF CANADA	18,100	29.590	535,579.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,500	1,506.770	5,273,695.000	
NUTRIEN LTD	18,819	61.660	1,160,379.540	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	33.340	246,716.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	53.910	474,408.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,200	65.120	273,504.000	
CAMECO CORP	12,800	16.710	213,888.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,400	168.380	235,732.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	35.490	230,685.000	
TELUS CORP	10,800	25.410	274,428.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	23.300	351,830.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	166.200	299,160.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	38,900	31.240	1,215,236.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	432.340	389,106.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	82.570	759,644.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,537	97.650	247,738.050	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	43.360	303,520.000	
BLACKBERRY LTD	16,000	10.510	168,160.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	19,250	56.710	1,091,667.500	
ENBRIDGE INC	66,500	42.180	2,804,970.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,425	51.910	2,254,191.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	63,800	22.460	1,432,948.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	26.860	282,030.000	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,500	436.630	1,964,835.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	55.680	183,744.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	34.660	218,358.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,350	141.460	3,303,091.000	
CGI INC - CLASS A	7,900	101.570	802,403.000	
ONEX CORPORATION	2,600	72.820	189,332.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	15,100	22.650	342,015.000	
IGM FINANCIAL INC	2,400	35.340	84,816.000	
TMX GROUP LTD	1,900	128.180	243,542.000	
OPEN TEXT CORP	8,700	58.200	506,340.000	
CI FINANCIAL CORP	7,000	16.180	113,260.000	
SAPUTO INC	8,000	36.000	288,000.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	21.780	420,354.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	28,300	45.160	1,278,028.000	
YAMANA GOLD INC	32,300	7.490	241,927.000	
FORTIS INC	15,000	53.260	798,900.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	85.830	326,154.000	
LUNDIN MINING CORP	19,400	10.340	200,596.000	
CENOVUS ENERGY INC	31,400	7.580	238,012.000	
DOLLARAMA INC	9,700	54.220	525,934.000	
ATCO LTD -CLASS I	2,200	36.930	81,246.000	
ALTAGAS LTD	9,100	18.690	170,079.000	
KEYERA CORP	7,400	23.450	173,530.000	
INTER PIPELINE LTD	12,800	12.900	165,120.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 67,261,004.110	

				(5,452,176,994)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	42,000	22.850	959,700.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	62,900	25.370	1,595,773.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,675	4.420	193,043.500	
	KEPPEL CORP LTD	51,300	5.370	275,481.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.810	109,340.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.060	129,766.000	
	CAPITALAND LTD	82,900	3.290	272,741.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	116,400	10.090	1,174,476.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.870	181,830.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	19.470	167,442.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	290,950	2.340	680,823.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	50,000	3.910	195,500.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,300	9.280	253,344.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	65,900	4.310	284,029.000		
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,473,288.500 (503,880,776)		
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	120,000	12.495	1,499,400.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	834.500	233,660.000	
ADECCO GROUP AG-REG	5,150	59.380	305,807.000		

ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	22,980	308.800	7,096,224.000	
SIKA AG-REG	4,710	236.600	1,114,386.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	87,800.000	263,400.000	
ABB LTD-REG	60,100	24.170	1,452,617.000	
SWISS RE AG	9,750	83.480	813,930.000	
NESTLE SA-REG	93,600	101.580	9,507,888.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	590	1,012.500	597,375.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	241.600	304,416.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	79,970	11.310	904,460.700	
JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	50.840	376,216.000	
SGS SA-REG	200	2,634.000	526,800.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	239.400	165,186.000	
VIFOR PHARMA AG	1,450	134.000	194,300.000	
TEMENOS AG - REG	2,120	122.900	260,548.000	
ALCON INC	16,130	57.060	920,377.800	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	238.800	231,636.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,862	369.100	1,794,564.200	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	157.900	247,903.000	
CLARIANT AG-REG	5,700	18.400	104,880.000	
NOVARTIS AG-REG	72,600	81.520	5,918,352.000	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	2,064.000	206,400.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	17,160	80.780	1,386,184.800	
SWISSCOM AG-REG	830	470.500	390,515.000	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	1,010	95.000	95,950.000	



	GEBERIT AG-REG	1,190	535.400	637,126.000	
	GIVAUDAN-REG	300	3,668.000	1,100,400.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	1,026.000	348,840.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,822	226.300	412,318.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,500	82.260	452,430.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,400	558.400	1,340,160.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	46.360	70,467.200	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,290	47.970	829,401.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	409.000	425,360.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,800	202.000	363,600.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,510	87.900	220,629.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	8,475.000	288,150.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 43,402,258.600 (5,065,043,579)	
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	410.900	1,446,368.000	
	ERICSSON LM-B SHS	99,630	99.960	9,959,014.800	
	VOLVO AB-B SHS	47,950	196.350	9,414,982.500	
	SKF AB-B SHARES	13,300	215.300	2,863,490.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	7,600	193.200	1,468,320.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,650	640.200	3,617,130.000	
	TELE2 AB-B SHS	16,800	110.200	1,851,360.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	57,400	84.400	4,844,560.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	52,850	82.220	4,345,327.000	

SWEDBANK AB - A SHARES	31,800	143.080	4,549,944.000	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	177.850	5,015,370.000	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	20,700	141.800	2,935,260.000	
SKANSKA AB-B SHS	11,550	206.300	2,382,765.000	
SANDVIK AB	38,450	202.700	7,793,815.000	
INVESTOR AB-B SHS	15,600	593.800	9,263,280.000	
ATLAS COPCO AB-A SHS	22,950	428.700	9,838,665.000	
SECURITAS AB-B SHS	10,950	134.500	1,472,775.000	
TELIA CO AB	86,200	34.030	2,933,386.000	
ALFA LAVAL AB	11,000	223.600	2,459,600.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	13,250	373.000	4,942,250.000	
ASSA ABLOY AB-B	34,150	207.600	7,089,540.000	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,900	274.600	1,070,940.000	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	3,600	429.000	1,544,400.000	
LUNDBERGS AB-B SHS	2,600	439.000	1,141,400.000	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	195.900	1,018,680.000	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10,400	260.600	2,710,240.000	
LUNDIN ENERGY AB	6,350	224.500	1,425,575.000	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,200	264.400	5,605,280.000	
BOLIDEN AB	9,300	283.900	2,640,270.000	
EPIROC AB-A	22,250	149.500	3,326,375.000	
EPIROC AB-B	13,500	140.000	1,890,000.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,150	105.850	1,497,777.500	
NORDEA BANK ABP	111,100	69.630	7,735,893.000	
EQT AB	8,100	190.850	1,545,885.000	
EVOLUTION GAMING GROUP	4,400	795.600	3,500,640.000	

	KINNEVIK AB - B	8,300	420.000	3,486,000.000	
	HEXAGON AB-B SHS	9,500	722.600	6,864,700.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	268.500	1,530,450.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 149,021,707.800 (1,858,300,696)	
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	58,000	437.450	25,372,100.000	
	DANSKE BANK A/S	22,700	96.100	2,181,470.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	105	12,770.000	1,340,850.000	
	H LUNDBECK A/S	2,300	211.300	485,990.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,800	1,310.000	8,908,000.000	
	GN STORE NORD A/S	4,300	488.700	2,101,410.000	
	CARLSBERG AS-B	3,650	967.200	3,530,280.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,250	342.600	2,483,850.000	
	COLOPLAST-B	4,050	925.800	3,749,490.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,160	1,002.000	7,174,320.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	2,128.000	638,400.000	
	DEMANT A/S	3,425	232.200	795,285.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	220	13,575.000	2,986,500.000	
	TRYG A/S	4,000	187.800	751,200.000	
	PANDORA A/S	3,500	627.400	2,195,900.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,450	605.600	2,089,320.000	
	GENMAB A/S	2,290	2,440.000	5,587,600.000	
	ORSTED A/S	6,400	1,107.000	7,084,800.000	
	AMBU A/S-B	5,600	217.700	1,219,120.000	

デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 80,675,885.000 (1,371,490,045)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	41,500	6.700	278,050.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	6.180	142,140.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	14.120	369,944.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	62,089	4.470	277,537.830	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,900	8.060	313,534.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,400	33.150	676,260.000	
RYMAN HEALTHCARE LTD	14,000	14.940	209,160.000		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,266,625.830 (167,231,654)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	41,700	40.270	1,679,259.000	
	DNB ASA	33,100	159.750	5,287,725.000	
	ORKLA ASA	24,450	84.740	2,071,893.000	
	TELENOR ASA	25,400	146.050	3,709,670.000	
	EQUINOR ASA	33,823	146.100	4,941,540.300	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	353.900	990,920.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,710	353.300	2,017,343.000	
	MOWI ASA	14,100	182.350	2,571,135.000	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	186.300	1,369,305.000		

	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	308.200	955,420.000	
	ADEVINTA ASA	8,100	140.100	1,134,810.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 26,729,020.300 (321,817,404)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	32,270	49.085	1,583,972.950	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,500	26.900	174,850.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	63,950	9.097	581,753.150	
	COMMERZBANK AG	32,935	5.294	174,357.890	
	VOLKSWAGEN AG	1,010	166.900	168,569.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,120	154.440	945,172.800	
	SIEMENS AG-REG	24,750	116.600	2,885,850.000	
	E.ON SE	74,200	9.086	674,181.200	
	UNIPER SE	6,650	28.620	190,323.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,000	73.780	811,580.000	
	GEA GROUP AG	5,050	28.960	146,248.000	
	CONTINENTAL AG	3,590	117.300	421,107.000	
	BASF SE	30,120	64.900	1,954,788.000	
	ALLIANZ SE-REG	13,470	200.850	2,705,449.500	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,800	90.240	523,392.000	
	RWE AG	21,200	33.840	717,408.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	9.742	94,010.300	
	BRENNTAG AG	5,000	64.620	323,100.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,550	38.850	526,417.500	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	34.150	113,378.000	

HOCHTIEF AG	710	78.200	55,522.000	
SAP SE	34,192	105.000	3,590,160.000	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,610	250.000	1,152,500.000	
ZALANDO SE	4,950	89.680	443,916.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	60.780	297,822.000	
KION GROUP AG	2,100	71.520	150,192.000	
COVESTRO AG	5,600	50.600	283,360.000	
RATIONAL AG	190	720.500	136,895.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	340.600	412,126.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,000	58.160	290,800.000	
DELIVERY HERO SE	4,150	119.550	496,132.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	107.300	134,125.000	
BECHTLE AG	950	180.600	171,570.000	
NEMETSCHEK SE	2,000	59.300	118,600.000	
SCOUT24 AG	3,600	68.100	245,160.000	
AROUNDTOWN SA	32,500	6.072	197,340.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,600	40.985	352,471.000	
KNORR-BREMSE AG	2,300	106.620	245,226.000	
HELLOFRESH SE	5,000	58.550	292,750.000	
TEAMVIEWER AG	4,450	42.630	189,703.500	
SIEMENS ENERGY AG	13,125	25.880	339,675.000	
BEIERSDORF AG	3,290	93.700	308,273.000	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,350	48.120	113,082.000	
MERCK KGAA	4,250	139.100	591,175.000	
ADIDAS AG	6,170	295.000	1,820,150.000	
PUMA SE	2,710	88.460	239,726.600	

HENKEL AG & CO KGAA	3,400	79.650	270,810.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	109,250	15.035	1,642,573.750	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,920	69.080	478,033.600	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	28,100	58.540	1,644,974.000	
QIAGEN N.V.	7,298	42.020	306,661.960	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	41,300	30.945	1,278,028.500	
HANNOVER RUECK SE	2,000	133.600	267,200.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	32,400	41.450	1,342,980.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,260	140.750	881,095.000	
LANXESS AG	2,500	63.340	158,350.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,710	204.500	349,695.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,000	43.580	479,380.000	
SYMRISE AG	4,220	106.150	447,953.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.273	76,827.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,950	56.150	109,492.500	
VONOVIA SE	17,050	58.620	999,471.000	
LEG IMMOBILIEN AG	2,300	123.600	284,280.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	30,210	44.030	1,330,146.300	
NN GROUP NV	9,050	34.610	313,220.500	
ARCELORMITTAL	23,300	19.254	448,618.200	
HEINEKEN NV	8,550	89.640	766,422.000	
AEGON NV	58,244	3.160	184,051.040	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	36,233	23.290	843,866.570	

AKZO NOBEL N.V.	6,538	86.840	567,759.920	
KONINKLIJKE DSM NV	5,700	137.350	782,895.000	
WOLTERS KLUWER	8,900	68.360	608,404.000	
ING GROEP NV	126,250	7.945	1,003,056.250	
KONINKLIJKE KPN NV	114,650	2.462	282,268.300	
ASML HOLDING NV	13,780	390.500	5,381,090.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	8.130	106,096.500	
GALAPAGOS NV	1,390	78.180	108,670.200	
ADYEN NV	600	1,906.500	1,143,900.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,000	86.620	346,480.000	
PROSUS NV	16,100	92.040	1,481,844.000	
JDE PEET'S NV	2,600	34.760	90,376.000	
VOPAK	2,300	43.280	99,544.000	
RANDSTAD NV	3,700	54.720	202,464.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,750	77.800	291,750.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	5.330	109,265.000	
TOTAL SE	81,050	36.385	2,949,004.250	
MICHELIN (CGDE)	5,700	109.000	621,300.000	
AIR LIQUIDE SA	15,577	134.900	2,101,337.300	
KERING	2,500	572.100	1,430,250.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	17,600	116.450	2,049,520.000	
BOUYGUES SA	7,400	34.000	251,600.000	
BNP PARIBAS	36,450	44.045	1,605,440.250	
PEUGEOT SA	19,150	22.060	422,449.000	
NATIXIS	29,550	2.620	77,421.000	
THALES SA	3,500	75.500	264,250.000	
DANONE	20,000	53.980	1,079,600.000	



CARREFOUR SA	19,800	13.655	270,369.000	
SUEZ	11,225	15.990	179,487.750	
VIVENDI	26,891	25.990	698,897.090	
L'OREAL	8,230	304.700	2,507,681.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	16,850	39.100	658,835.000	
LEGRAND SA	8,817	72.020	635,000.340	
PERNOD RICARD SA	6,937	158.300	1,098,127.100	
EURAZEO SE	1,254	57.250	71,791.500	
SOCIETE GENERALE SA	26,950	17.210	463,809.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,100	502.900	4,576,390.000	
ACCOR SA	6,150	29.770	183,085.500	
CAPGEMINI SE	5,320	120.050	638,666.000	
VALEO SA	7,700	32.700	251,790.000	
PUBLICIS GROUPE	7,050	41.850	295,042.500	
BUREAU VERITAS SA	9,700	22.640	219,608.000	
EIFFAGE	2,740	80.280	219,967.200	
SODEXO SA	2,700	70.700	190,890.000	
IPSEN	1,150	68.050	78,257.500	
ORPEA	1,800	108.000	194,400.000	
AMUNDI SA	1,950	67.750	132,112.500	
TELEPERFORMANCE	1,920	268.000	514,560.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	76.340	229,020.000	
FAURECIA	2,250	42.100	94,725.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,400	69.460	305,624.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	900	287.400	258,660.000	
SEB SA	650	146.400	95,160.000	

ESSILORLUXOTTICA	9,250	129.050	1,193,712.500	
DASSAULT AVIATION SA	100	908.000	90,800.000	
WORLDLINE SA	7,814	77.760	607,616.640	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,000	35.770	107,310.000	
AXA SA	63,850	20.145	1,286,258.250	
EDENRED	7,950	47.260	375,717.000	
RENAULT SA	5,800	36.580	212,164.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,020	862.000	879,240.000	
STMICROELECTRONICS NV	21,050	29.670	624,553.500	
REMY COINTREAU	750	148.600	111,450.000	
ATOS SE	3,200	76.000	243,200.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	4,360	159.100	693,676.000	
WENDEL	780	99.300	77,454.000	
ORANGE	65,900	9.626	634,353.400	
ALSTOM	6,300	46.490	292,887.000	
CNP ASSURANCES	4,850	13.420	65,087.000	
SANOFI	37,075	78.000	2,891,850.000	
VINCI SA	17,000	85.240	1,449,080.000	
AIRBUS SE	19,400	90.380	1,753,372.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,500	19.790	346,325.000	
CREDIT AGRICOLE SA	37,600	10.490	394,424.000	
BIOMERIEUX	1,340	114.300	153,162.000	
ENGIE	60,223	12.670	763,025.410	
EDF	20,250	12.670	256,567.500	
SES	11,000	7.742	85,162.000	
SAFRAN SA	10,420	116.750	1,216,535.000	
ILIAD SA	490	169.800	83,202.000	

ARKEMA	2,220	95.080	211,077.600	
ADP	910	107.300	97,643.000	
SCOR SE	4,950	27.640	136,818.000	
GETLINK SE	14,200	14.000	198,800.000	
BOLLORE	28,600	3.394	97,068.400	
UCB SA	4,130	87.300	360,549.000	
KBC GROUP NV	8,250	59.440	490,380.000	
COLRUYT SA	1,600	48.700	77,920.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,600	83.000	298,800.000	
SOLVAY SA	2,450	98.440	241,178.000	
UMICORE	6,350	39.220	249,047.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	24,900	58.760	1,463,124.000	
AGEAS	5,790	43.700	253,023.000	
PROXIMUS	4,950	17.085	84,570.750	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	95.800	100,590.000	
SOFINA	550	264.000	145,200.000	
ARGENX SE	1,450	241.800	350,610.000	
PRYSMIAN SPA	7,850	27.600	216,660.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	37,243	14.325	533,505.970	
MEDIOBANCA SPA	18,865	7.444	140,431.060	
TENARIS SA	13,300	6.826	90,785.800	
UNICREDIT SPA	69,656	7.786	542,341.610	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.375	98,618.250	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.420	72,287.780	
INTESA SANPAOLO	550,737	1.944	1,070,853.020	
ATLANTIA SPA	17,257	14.775	254,972.170	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	8.390	134,240.000	

MONCLER SPA	6,300	49.000	308,700.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,450	44.420	153,249.000	
ENI SPA	84,100	8.711	732,595.100	
DAVIDE CAMPARI -MILANO NV	19,500	9.270	180,765.000	
DIASORIN SPA	850	167.100	142,035.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	8,300	10.060	83,498.000	
NEXI SPA	12,050	16.500	198,825.000	
AMPLIFON SPA	4,300	33.450	143,835.000	
ENEL SPA	267,134	8.173	2,183,286.180	
SNAM SPA	66,600	4.570	304,362.000	
TERNA SPA	46,300	6.200	287,060.000	
EXOR NV	3,530	61.900	218,507.000	
CNH INDUSTRIAL NV	32,800	9.414	308,779.200	
FINECOBANK SPA	19,700	13.075	257,577.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,000	14.404	518,544.000	
FERRARI NV	4,145	183.500	760,607.500	
TELEFONICA SA	157,227	3.359	528,125.490	
ENDESA SA	10,350	22.760	235,566.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	220,512	4.059	895,058.200	
IBERDROLA SA	194,434	11.395	2,215,575.430	
REPSOL SA	49,400	8.284	409,229.600	
GRIFOLS SA	9,800	24.800	243,040.000	
BANCO SANTANDER SA	547,750	2.688	1,472,625.870	
AMADEUS IT GROUP SA	14,600	60.280	880,088.000	

NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	19.125	179,775.000	
CAIXABANK SA	117,500	2.246	263,905.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.720	237,166.720	
AENA SME SA	2,250	138.300	311,175.000	
CELLNEX TELECOM SA	10,455	49.970	522,436.350	
REPSOL SA-RTS	49,400	0.286	14,153.100	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	36,000	26.550	955,800.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	7,700	28.450	219,065.000	
ENAGAS SA	7,950	19.480	154,866.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	16.675	231,782.500	
FERROVIAL SA	16,270	23.550	383,158.500	
UPM-KYMMENE OYJ	17,550	30.170	529,483.500	
NOKIA OYJ	186,400	3.289	613,069.600	
WARTSILA OYJ ABP	14,700	8.080	118,776.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	18,850	15.535	292,834.750	
ELISA OYJ	4,600	44.480	204,608.000	
SAMPO OYJ-A SHS	15,300	34.810	532,593.000	
FORTUM OYJ	13,850	19.435	269,174.750	
KESKO OYJ-B SHS	9,200	20.300	186,760.000	
KONE OYJ-B	11,250	66.360	746,550.000	
NESTE OYJ	13,900	57.760	802,864.000	
ORION OYJ-CLASS B	3,200	37.680	120,576.000	
VERBUND AG	2,000	63.700	127,400.000	
OMV AG	4,450	33.300	148,185.000	
ERSTE GROUP BANK AG	9,450	25.300	239,085.000	

	VOESTALPINE AG	4,250	29.590	125,757.500	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	17.000	74,800.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,550	38.700	292,185.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,000	57.800	289,000.000	
	JERONIMO MARTINS	7,700	14.285	109,994.500	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	88,300	4.896	432,316.800	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,050	8.780	132,139.000	
	KERRY GROUP PLC-A	5,150	118.200	608,730.000	
	CRH PLC	25,350	33.950	860,632.500	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,960	171.950	852,872.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 134,552,965.410 (17,024,986,712)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	47,500	40.550	1,926,125.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	77,000	59.200	4,558,400.000	
	MTR CORP	52,500	43.950	2,307,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,500	103.800	4,619,100.000	
	SINO LAND CO	104,000	10.580	1,100,320.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	95,669	54.100	5,175,692.900	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	44.000	682,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	56,000	70.500	3,948,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,507	30.400	1,474,612.800	
	HONG KONG & CHINA GAS	377,358	11.520	4,347,164.160	
	HANG SENG BANK LTD	26,100	136.700	3,567,870.000	

NEW WORLD DEVELOPMENT	52,500	37.000	1,942,500.000	
WH GROUP LTD	321,000	6.530	2,096,130.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	40,700	393.200	16,003,240.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	66,000	20.000	1,320,000.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,800	100.000	1,080,000.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	16.740	757,317.600	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	62,000	19.600	1,215,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	58,000	9.080	526,640.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	23.000	878,600.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	41.050	3,742,487.450	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	39.650	793,000.000	
PCCW LTD	147,000	4.790	704,130.000	
AIA GROUP LTD	407,400	90.950	37,053,030.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	57,000	39.500	2,251,500.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	60,900	25.950	1,580,355.000	
ESR CAYMAN LTD	58,000	24.800	1,438,400.000	
SANDS CHINA LTD	82,400	34.650	2,855,160.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	47,000	106.800	5,019,600.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	125,500	24.200	3,037,100.000	
WYNN MACAU LTD	54,000	13.500	729,000.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 118,730,049.910 (1,581,484,264)	

合計			155,418,316,420	
			[155,418,316,420]	

## (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	4,587	748,736.010	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	10,137	902,497.110	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,950	497,079.000	
		VORNADO REALTY TRUST	5,397	207,136.860	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,650	1,029,446.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	12,350	736,554.000	
		EQUINIX INC	2,918	2,079,775.320	
		AMERICAN TOWER CORP	14,500	3,229,295.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	22,243	317,852.470	
		INVITATION HOMES INC	17,700	518,256.000	
		VICI PROPERTIES INC	15,400	409,640.000	
		VENTAS INC	12,200	628,178.000	
		WEYERHAEUSER CO	24,114	830,968.440	
		AGNC INVESTMENT CORP	18,100	279,826.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	13,750	2,141,562.500	
		IRON MOUNTAIN INC	9,710	287,318.900	
		VEREIT INC	33,500	257,950.000	
		SUN COMMUNITIES INC	3,250	491,107.500	
		PROLOGIS INC	24,402	2,454,353.160	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,120	732,124.000			
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,200	319,264.000			



	DUKE REALTY CORP	12,150	491,467.500	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,170	524,814.500	
	WELLTOWER INC	13,850	913,407.500	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17,650	538,148.500	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,750	470,962.500	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,800	364,356.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45,100	379,291.000	
	REALTY INCOME CORP	11,200	683,536.000	
	PUBLIC STORAGE	5,220	1,213,963.200	
	REGENCY CENTERS CORP	5,300	251,697.000	
	UDR INC	9,750	374,302.500	
	WP CAREY INC	5,800	414,700.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7,600	287,888.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,900	1,191,977.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,250	485,222.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,250	364,665.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 28,049,318.970 (2,896,372,676)	
イギリス・ポ ンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	153,735.210	
	SEGRO PLC	38,450	363,044.900	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	147,927.300	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 664,707.410 (93,072,332)	

オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	21,500	291,110.000	
	TRANSURBAN GROUP	89,500	1,277,165.000	
	SYDNEY AIRPORT	42,500	280,075.000	
	APA GROUP	38,100	393,954.000	
	SCENTRE GROUP	159,922	444,583.160	
	DEXUS	33,150	325,864.500	
	GPT GROUP	63,160	300,010.000	
	MIRVAC GROUP	126,100	348,036.000	
	STOCKLAND	78,000	345,540.000	
	GOODMAN GROUP	52,900	996,636.000	
VICINITY CENTRES	123,273	202,167.720		
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,205,141.380 (409,176,163)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	123,096.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	83,143.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 206,239.000 (16,717,733)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,000	300,980.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	158,032	341,349.120	
	SUNTEC REIT	63,000	97,020.000	

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91,800	176,256.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	138,205.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,053,810.120 (82,028,580)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	270,480.000	ユーロ
	GECINA SA	1,400	179,760.000	
	KLEPIERRE	6,250	118,531.250	
	COVIVIO	1,500	115,050.000	
ユーロ 小計			ユーロ 683,821.250 (86,523,903)	
香港・ドル	LINK REIT	70,500	4,924,425.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	713,920.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122,000	1,241,960.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 6,880,305.000 (91,645,663)	
投資証券 合計			3,675,537,050 [3,675,537,050]	
合計			3,675,537,050 [3,675,537,050]	

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 594銘柄 投資証券 37銘柄	97.5%	2.5%	71.5%
イギリス・ポンド	株式 85銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	4.7%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄 投資証券 11銘柄	89.1%	10.9%	2.4%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.4%
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資証券 5銘柄	86.0%	14.0%	0.4%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100%	-%	3.2%
スウェーデン・クローナ	株式 38銘柄	100%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式 19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 235銘柄 投資証券 4銘柄	99.5%	0.5%	10.8%
香港・ドル	株式 31銘柄 投資証券 3銘柄	94.5%	5.5%	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。

## 「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,385,182,832	7,159,458,670
投資証券	2 357,070,085,750	359,920,911,700
派生商品評価勘定	-	127,513,090
未収配当金	1,517,781,411	1,944,947,366
前払金	178,605,000	-
流動資産合計	366,151,654,993	369,152,830,826
資産合計	366,151,654,993	369,152,830,826
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	189,832,100	-
前受金	-	217,186,600
未払金	2,116,330,041	117,859,215
未払解約金	291,333,000	29,844,564

流動負債合計		2,597,495,141	364,890,379
負債合計		2,597,495,141	364,890,379
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,579,310,877	134,624,414,134
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		250,974,848,975	234,163,526,313
元本等合計		363,554,159,852	368,787,940,447
純資産合計		363,554,159,852	368,787,940,447
負債純資産合計		366,151,654,993	369,152,830,826

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日	2019年12月19日
期首元本額	83,618,179,092円	112,579,310,877円
期中追加設定元本額	35,700,341,757円	49,045,204,059円
期中一部解約元本額	6,739,209,972円	27,000,100,802円
期末元本額の内訳		

ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	5,907,694,824円	5,775,421,582円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	96,435,527,079円	118,214,001,589円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	312,440,932円	358,472,846円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	352,959円	1,383,988円
iFree J-REITイ ンデックス	130,587,507円	168,835,511円
iFree 8資産バランス	703,418,176円	1,132,230,418円
DC・ダイワJ-REIT オープン	5,121,995,518円	5,343,826,156円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,036,683円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,120,846円	4,840,218円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,865,960円	3,047,039円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	84,721,097円	95,850,900円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,270,235,750円	1,717,269,132円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,117,282,843円	282,971,153円
ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	349,273,748円	448,996,578円



	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,136,756,955円	1,077,267,024円
計		112,579,310,877円	134,624,414,134円
2.	期末日における受益権の総数	112,579,310,877口	134,624,414,134口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 1,106,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 4,747,650,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年12月18日現在	2020年12月18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）
投資証券	1,983,707,427	29,510,330
合計	1,983,707,427	29,510,330

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年9月18日から2019年12月18日まで、及び2020年9月16日から2020年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2019年12月18日 現在			2020年12月18日 現在			評価損益 （円）	
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	6,661,400,000	-	6,471,910,000	189,490,000	8,742,302,900	-	8,870,392,500	128,089,600
合計	6,661,400,000	-	6,471,910,000	189,490,000	8,742,302,900	-	8,870,392,500	128,089,600

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.2293円	2.7394円
(1万口当たり純資産額)	(32,293円)	(27,394円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	6,403	728,021,100	
	サンケイリアルエステート	9,587	911,723,700	
	SOSILA物流リート投	10,302	1,247,572,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	13,503	7,413,147,000	

MCUBS MidCity投資法人	47,940	4,285,836,000	
森ヒルズリート	46,023	6,277,537,200	
産業ファンド	55,382	9,918,916,200	
アドバンス・レジデンス	37,215	11,071,462,500	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	25,561	4,488,511,600	
API投資法人	19,632	7,970,592,000	
GLP投資法人	122,424	19,220,568,000	
コンフォリア・レジデンシャル	17,097	4,821,354,000	
日本プロロジスリート	59,283	18,674,145,000	
星野リゾート・リート	5,961	2,932,812,000	
ONEリート投資法人	6,107	1,523,696,500	
イオンリート投資	39,739	4,995,192,300	
ヒューリックリート投資法	31,543	4,570,580,700	
日本リート投資法人	12,726	4,651,353,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	251,711	3,549,125,100	
積水ハウス・リート投資	115,237	8,527,538,000	
トーセイ・リート投資法人	8,668	961,281,200	
ケネディクス商業リート	14,407	3,506,663,800	
ヘルスケア&メディカル投資	8,357	1,042,953,600	
サムティ・レジデンシャル	7,542	801,714,600	
野村不動産マスターF	126,698	17,712,380,400	
いちごホテルリート投資	6,851	467,923,300	
ラサールロジポート投資	43,661	6,749,990,600	
スターアジア不動産投	40,255	1,954,380,250	
マリモ地方創生リート	3,671	418,494,000	
三井不ロジパーク	13,675	6,892,200,000	

大江戸温泉リート	6,324	434,458,800	
投資法人みらい	42,314	1,618,510,500	
森トラスト・ホテルリート投	8,485	963,047,500	
三菱地所物流REIT	8,815	3,600,927,500	
CREロジスティクスファンド	10,692	1,664,744,400	
ザイマックス・リート	6,003	548,073,900	
タカラレーベン不動産投	11,773	1,054,860,800	
伊藤忠アドバンスロジ	15,197	1,958,893,300	
日本ビルファンド	44,095	25,619,195,000	
ジャパンリアルエステイト	39,180	21,979,980,000	
日本リテールファンド	73,610	13,249,800,000	
オリックス不動産投資	78,065	12,701,175,500	
日本プライムリアルティ	24,393	8,135,065,500	
プレミアム投資法人	35,388	4,303,180,800	
東急リアル・エステート	26,268	4,079,420,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	27,206	2,728,761,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	83,790	10,473,750,000	
森トラスト総合リート	28,002	3,539,452,800	
インヴィンシブル投資法人	163,823	5,529,026,250	
フロンティア不動産投資	13,002	5,135,790,000	
平和不動産リート	24,040	2,860,760,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	25,599	7,730,898,000	
福岡リート投資法人	20,263	2,930,029,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,120	8,047,680,000	
いちごオフィスリート投資法人	32,505	2,278,600,500	
大和証券オフィス投資法人	8,347	5,175,140,000	
阪急阪神リート投資法人	17,697	2,173,191,600	

	スタートプロシード投資法人	6,101	1,198,236,400	
	大和ハウスリート投資法人	55,901	13,964,069,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	126,215	6,777,745,500	
	大和証券リビング投資法人	51,160	4,783,460,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	36,355	4,395,319,500	
投資証券	合計		359,920,911,700	
合計			359,920,911,700	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本プロロジスリート	3,500口	野村不動産マスターF	5,000口
日本ビルファンド	2,850口	ジャパンリアルエステイト	2,300口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	84,259,481	32,249,255
コール・ローン	617,829,784	287,304,645
投資信託受益証券	-	335,607,908
投資証券	26,082,798,515	28,605,415,077
派生商品評価勘定	1,669,974	20,119,610
未収入金	249,929	810,267
未収配当金	33,402,733	63,943,846
差入委託証拠金	96,785,805	274,955,056
流動資産合計	26,916,996,221	29,620,405,664
資産合計	26,916,996,221	29,620,405,664
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,658,406	946,014
未払金	81,776,260	216,385
未払解約金	19,922,080	7,145,747
流動負債合計	106,356,746	8,308,146
負債合計	106,356,746	8,308,146
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,727,508,018	13,140,962,393
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	16,083,131,457	16,471,135,125
元本等合計	26,810,639,475	29,612,097,518
純資産合計	26,810,639,475	29,612,097,518
負債純資産合計	26,916,996,221	29,620,405,664



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p>

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な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な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。

3. 収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>受取配当金 原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
-----	---------------	---------------

1. 1 期首	2018年12月19日	2019年12月19日
期首元本額	8,605,559,107円	10,727,508,018円
期中追加設定元本額	3,493,386,129円	4,963,535,148円
期中一部解約元本額	1,371,437,218円	2,550,080,773円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	4,859,934,730円	6,083,924,762円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	777,898,200円	1,090,872,679円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	325,710,667円	364,662,168円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	231,491,706円	269,730,117円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,374,584円	2,053,952円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	385,683円	1,717,692円
iFree 外国REITイ ンデックス	99,386,729円	154,564,575円
iFree 8資産バランス	914,351,451円	1,406,288,160円

グローバル・リート・イン デックスファンド（資産形成 型）	386,806円	63,466,632円
グローバル・リート・イン デックスファンド（毎月決算 型）	386,806円	26,171,817円
D Cダイワ・グローバルR E I Tインデックスファンド	2,255,329,705円	2,711,342,114円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,670,316円	- 円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,719,175円	6,008,777円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,137,765円	3,760,732円
ダイワバランスファンド 2020-07（適格機関投資家専 用）	- 円	228,872,981円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルR E I T	239,856,057円	251,701,437円
ダイワ・ノーロード グロー バルR E I Tファンド	35,933,971円	54,131,802円
ダイワ外国R E I Tインデッ クス（為替ヘッジあり）（ダ イワSMA専用）	760,409,422円	216,762,068円
ダイワ外国R E I Tインデッ クス（為替ヘッジなし）（ダ イワSMA専用）	213,144,245円	204,929,928円
計	10,727,508,018円	13,140,962,393円

2. 期末日における受益権の総数	10,727,508,018口	13,140,962,393口
------------------	-----------------	-----------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2019年12月18日現在	2020年12月18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）

投資信託受益証券	-	4,541,375
投資証券	952,094,314	602,440,063
合計	952,094,314	606,981,438

(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2019年12月18日まで、及び2020年12月1日から2020年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 不動産投信関連

種 類	2019年12月18日 現在				2020年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	737,803,068	-	733,270,153	4,532,915	633,013,206	-	651,108,773	18,095,567
合計	737,803,068	-	733,270,153	4,532,915	633,013,206	-	651,108,773	18,095,567

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。



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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	2019年12月18日 現在				2020年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	608,809,817	-	610,354,300	1,544,483	282,479,671	-	283,557,700	1,078,029
アメリカ・ドル	492,610,277	-	493,167,100	556,823	113,423,030	-	112,477,100	945,930
オーストラリア ・ドル	-	-	-	-	14,099,649	-	14,146,200	46,551
ユーロ	116,199,540	-	117,187,200	987,660	154,956,992	-	156,934,400	1,977,408
合計	608,809,817	-	610,354,300	1,544,483	282,479,671	-	283,557,700	1,078,029

(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。

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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.4992円	2.2534円
(1万口当たり純資産額)	(24,992円)	(22,534円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	37,500.000	アメリカ・ドル 3,250,125.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 3,250,125.000 (335,607,908)	
投資信託受益証券 合計				335,607,908 [335,607,908]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,500	アメリカ・ドル 552,240.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	76,172.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	306,868.720	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	25,400	381,000.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,400	5,125,422.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	71,847	6,396,538.410	
		BOSTON PROPERTIES INC	31,400	3,153,188.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	32,289	150,143.850	
		VORNADO REALTY TRUST	35,064	1,345,756.320	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18,000	407,700.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,900	493,311.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,800	208,944.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	13,600	827,152.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	76,500	4,562,460.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,800	572,466.000	
EPR PROPERTIES	16,100	536,774.000			

BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	41,090.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	89,931.000	
GLOBAL NET LEASE INC	19,833	351,242.430	
EQUINIX INC	19,600	13,969,704.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,529	465,093.550	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	85,026.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,100	110,476.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,300	776,499.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25,700	352,861.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,900	239,953.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	157,600	2,252,104.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,008	1,762,568.960	
CORESITE REALTY CORP	9,500	1,166,980.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34,100	855,228.000	
RLJ LODGING TRUST	35,871	505,781.100	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	24,940.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	46,100	844,091.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14,000	158,200.000	
CYRUSONE INC	25,900	1,846,670.000	
KIMCO REALTY CORP	94,400	1,423,552.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,800	142,198.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48,850	1,339,955.500	
WHITESTONE REIT	8,500	68,935.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,349	2,035,184.590	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27,200	455,056.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	51,680	890,963.200	

COLONY CAPITAL INC	105,011	498,802.250	
INVITATION HOMES INC	125,297	3,668,696.160	
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	798,946.280	
ALEXANDER & BALDWIN INC	16,500	272,250.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	9,184.000	
GLADSTONE LAND CORP	4,500	68,175.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	45,100	1,620,894.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14,300	342,628.000	
VICI PROPERTIES INC	118,200	3,144,120.000	
RETAIL VALUE INC	2,815	39,747.800	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,500	197,875.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	20,358.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,100	163,418.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,900	924,777.000	
SAFEHOLD INC	3,200	236,416.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	29,246.950	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22,400	179,200.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22,900	490,060.000	
CORECIVIC INC	25,224	190,441.200	
COREPOINT LODGING INC	6,700	43,684.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	50,456.000	
STORE CAPITAL CORP	50,500	1,692,760.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,400	28,800.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22,400	215,264.000	
LIFE STORAGE INC	10,400	1,235,728.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,100	298,657.000	

INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	274,320.120	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9,200	69,736.000	
PARAMOUNT GROUP INC	36,400	337,064.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,200	287,036.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	32,289	1,264,437.240	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27,400	1,363,698.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,700	341,754.000	
STAG INDUSTRIAL INC	32,500	1,026,350.000	
VENTAS INC	83,379	4,293,184.710	
CARETRUST REIT INC	21,503	505,105.470	
GEO GROUP INC/THE	27,400	259,478.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64,300	1,069,309.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10,600	253,340.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	801,668.340	
UMH PROPERTIES INC	8,600	142,244.000	
IRON MOUNTAIN INC	63,800	1,887,842.000	
TERRENO REALTY CORP	15,200	880,992.000	
VEREIT INC	240,908	1,854,991.600	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,320	935,208.000	
SUN COMMUNITIES INC	21,800	3,294,198.000	
ACADIA REALTY TRUST	17,011	254,654.670	
ALEXANDER'S INC	400	115,532.000	
PROLOGIS INC	163,619	16,456,799.020	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,200	4,655,740.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	38,300	469,941.000	
SAUL CENTERS INC	2,400	82,800.000	

MACK-CALI REALTY CORP	20,200	265,630.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	21,800	2,174,986.000	
COUSINS PROPERTIES INC	32,906	1,171,453.600	
SITE CENTERS CORP	31,878	333,762.660	
DUKE REALTY CORP	82,100	3,320,945.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,700	1,210,431.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,467	3,498,843.950	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27,800	1,179,276.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,400	1,397,242.000	
GETTY REALTY CORP	7,703	228,702.070	
WELLTOWER INC	93,200	6,146,540.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120,300	3,667,947.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,100	931,392.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	36,500	430,335.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,100	900,893.000	
EQUITY COMMONWEALTH	27,375	724,342.500	
KILROY REALTY CORP	23,200	1,396,176.000	
LTC PROPERTIES INC	8,400	337,596.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	60,000	669,000.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,328	3,180,943.520	
MACERICH CO/THE	21,979	244,846.060	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37,500	2,355,750.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9,600	670,752.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38,400	1,570,560.000	
REALTY INCOME CORP	77,117	4,706,450.510	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24,000	634,320.000	

PUBLIC STORAGE	33,800	7,860,528.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,300	577,232.000	
REGENCY CENTERS CORP	34,920	1,658,350.800	
RPT REALTY	17,800	155,750.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,600	195,360.000	
SL GREEN REALTY CORP	16,400	986,788.000	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49,000	211,435.000	
TAUBMAN CENTERS INC	13,300	571,102.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	87,300.000	
UDR INC	65,300	2,506,867.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,600	186,810.000	
WP CAREY INC	38,500	2,752,750.000	
WASHINGTON REIT	17,800	416,698.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25,900	586,894.000	
AGREE REALTY CORP	11,700	780,390.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,748	1,922,334.240	
CUBESMART	43,300	1,451,416.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	506,704.380	
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,778	8,006,067.540	
EXTRA SPACE STORAGE INC	28,600	3,265,262.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	66,150.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,460	171,093.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	18,950	296,757.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21,000	358,680.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,233	47,384.260	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30,500	1,328,885.000	



	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,300	117,432.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	350,591.760	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,100	2,475,494.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	99,330.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	36,500	1,129,310.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46,700	423,569.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	320,562	238,818.690	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151,400	109,008.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	12,330.000	
	PRIME US REIT	99,000	81,675.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 202,330,089.980 (20,892,605,091)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	594,520	459,563.960	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129,570	97,177.500	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	59,000.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	125,640.970	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	92,043.600	
	REGIONAL REIT LTD	81,310	64,234.900	
	NEWRIVER REIT PLC	69,330	62,951.640	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183,290	274,385.130	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135,490	141,993.520	
	CUSTODIAN REIT PLC	89,420	79,315.540	
	GCP STUDENT LIVING PLC	96,860	136,185.160	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67,900	73,332.000	

	LXI REIT PLC	118,038	140,937.370	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75,200	81,216.000	
	AEW UK REIT PLC	25,610	19,463.600	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180,000	142,380.000	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	150,000	159,000.000	
	RDI REIT PLC	41,036	37,342.760	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	166,381	1,180,805.950	
	SEGro PLC	263,740	2,490,233.080	
	HAMMERSON PLC	811,984	211,115.840	
	UNITE GROUP PLC/THE	87,260	890,052.000	
	BRITISH LAND CO PLC	208,520	1,043,851.120	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53,581	363,493.500	
	DERWENT LONDON PLC	24,390	758,529.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283,370	432,422.620	
	WORKSPACE GROUP PLC	26,460	201,228.300	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	46,350	356,663.250	
	SHAFTESBURY PLC	53,850	298,329.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	36,960	425,040.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	203,150	478,621.400	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	44,809.600	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	370,260	609,447.960	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 12,030,806.270 (1,684,553,494)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	28,840	イスラエル・シュケル 461,728.400	

イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 461,728.400 (14,706,050)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78,380	253,951.200	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	435,284	398,284.860	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95,110	297,694.300	
	AVENTUS GROUP	88,000	251,680.000	
	RURAL FUNDS GROUP	78,595	201,989.150	
	WAYPOINT REIT	177,830	503,258.900	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	98,668	473,606.400	
	CENTURIA OFFICE REIT	84,950	188,589.000	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	97,590	243,975.000	
	IRONGATE GROUP	119,630	158,509.750	
	HOME CONSORTIUM	35,000	138,250.000	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	17,500	21,350.000	
	ABACUS PROPERTY-ASX INTERNAL	16,900	0.000	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241,860	636,091.800	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70,547	253,263.730	
	NATIONAL STORAGE REIT	206,195	410,328.050	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	89,577.600	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	150,438.200	
	SCENTRE GROUP	1,170,710	3,254,573.800	
ARENA REIT	79,890	233,278.800		
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	125,241.000		
BWP TRUST	105,550	466,531.000		

	DEXUS	246,130	2,419,457.900	
	GPT GROUP	444,000	2,109,000.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	120,400	464,744.000	
	MIRVAC GROUP	887,460	2,449,389.600	
	STOCKLAND	537,810	2,382,498.300	
	ABACUS PROPERTY GROUP	81,120	245,793.600	
	GOODMAN GROUP	375,310	7,070,840.400	
	VICINITY CENTRES	878,900	1,441,396.000	
	CHARTER HALL GROUP	105,060	1,564,343.400	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	68,660	340,553.600	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 29,238,479.340 (2,298,436,861)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	142,397.000
		SLATE GROCERY REIT	8,100	92,502.000
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,200	178,398.000
		SLATE OFFICE REIT	5,100	21,777.000
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	86,898.000
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19,700	250,387.000
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17,600	239,536.000
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	71,904.000
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8,500	160,820.000
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	45,961.000
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,200	490,606.000
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18,300	244,854.000
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,200	229,878.000	

FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24,700	356,668.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	36,800	494,592.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	67,284.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	185,997.000	
PLAZA RETAIL REIT	11,100	40,071.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16,300	388,266.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19,500	1,000,155.000	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	183,253.900	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32,566	454,295.700	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34,300	606,767.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	114,534.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	166,427.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	142,025.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,300	524,020.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 6,980,273.600 (565,820,978)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	
KEPPEL DC REIT	293,783	802,027.590	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	126,200	53,004.000	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455,000	448,175.000	
AIMS APAC REIT	89,000	108,580.000	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	66,381.000	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	591,190	839,489.800	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	71,380.000	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208,900	155,630.500	

EC WORLD REIT	57,000	40,755.000	
IREIT GLOBAL	105,124	67,804.980	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722,377	2,152,683.460	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,029,422	2,223,551.520	
SUNTEC REIT	473,400	729,036.000	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608,200	1,167,744.000	
KEPPEL REIT	375,400	416,694.000	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417,456	459,201.600	
ESR-REIT	559,902	226,760.310	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161,600	210,080.000	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211,776	529,440.000	
STARHILL GLOBAL REIT	308,800	157,488.000	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	189,442	261,429.960	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86,300	329,666.000	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467,200	38,777.600	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384,780	1,092,775.200	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244,500	149,145.000	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498,484	1,051,801.240	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	113,812.500	
SPH REIT	220,600	187,510.000	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202,100	109,134.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	77,887.000	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541,063	216,425.200	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 14,554,270.460 (1,132,904,412)	

ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	244,120.800	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	357,920	431,293.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76,800	245,760.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	248,220	575,870.400	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245,820	420,352.200	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル	
			1,917,397.000	
			(141,465,550)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	34,820	518,818.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	108,299.200	
	WERELDHAVE NV	6,470	72,464.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,770	1,723,988.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	8,230	127,400.400	
	NSI NV	3,231	111,469.500	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	88,687.500	
	ICADE	5,940	387,882.000	
	CARMILA	10,000	117,600.000	
	ALTAREA	740	101,232.000	
	GECINA SA	10,521	1,350,896.400	
	KLEPIERRE	39,940	757,462.100	
	COVIVIO	8,992	689,686.400	
	MERCIALYS	4,030	29,822.000	
	AEDIFICA	6,256	608,708.800	
COFINIMMO	5,300	652,960.000		

	BEFIMMO	5,070	188,097.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,610	103,725.000	
	RETAIL ESTATES	1,940	109,998.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	25,480	712,930.400	
	CARE PROPERTY INVEST	4,900	131,810.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,700	132,300.000	
	MONTEA	2,150	195,005.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	22,869.600	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	50,807.250	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50,033	414,773.570	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66,100	521,529.000	
	CROMWELL EUROPEAN REIT	294,600	139,935.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82,050	118,972.500	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	135,070.880	
ユーロ 小計			ユーロ 10,425,199.500 (1,319,100,492)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	42,480,000.000	韓国・ウォン
	LOTTE REIT CO LTD	17,960	97,343,200.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17,960	74,623,800.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 214,447,000.000 (20,265,242)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349,000	1,305,260.000	香港・ドル
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	717,960.000	



	FORTUNE REIT	311,000	2,223,650.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	735,000.000	
	LINK REIT	476,900	33,311,465.000	
	CHAMPION REIT	431,000	1,913,640.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 40,206,975.000 (535,556,907)	
投資証券	合計		28,605,415,077 [28,605,415,077]	
合計			28,941,022,985 [28,941,022,985]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄 投資証券 156銘柄	1.6%	98.4%	73.2%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.8%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 32銘柄	-%	100%	7.9%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	2.0%

シンガポール・ドル	投資証券	31銘柄	-%	100%	3.9%
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券	30銘柄	-%	100%	4.6%
韓国・ウォン	投資証券	3銘柄	-%	100%	0.1%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	-%	100%	1.9%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	146,370,537	289,942,850
国債証券	17,241,097,460	21,398,324,960
地方債証券	1,451,961,400	1,559,557,100
特殊債券	728,040,400	833,791,500
社債券	932,981,800	929,158,300

未収利息	53,080,992	56,748,209
前払費用	2,255,924	2,896,991
流動資産合計	20,555,788,513	25,070,419,910
資産合計	20,555,788,513	25,070,419,910
負債の部		
流動負債		
未払金	73,985,700	100,588,000
未払解約金	2,007,188	68,937,679
流動負債合計	75,992,888	169,525,679
負債合計	75,992,888	169,525,679
純資産の部		
元本等		
元本	1 15,760,287,085	19,253,905,112
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,719,508,540	5,646,989,119
元本等合計	20,479,795,625	24,900,894,231
純資産合計	20,479,795,625	24,900,894,231
負債純資産合計	20,555,788,513	25,070,419,910

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
-----	--------------------------------

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日	2019年12月19日
期首元本額	13,470,544,219円	15,760,287,085円
期中追加設定元本額	3,333,782,725円	5,665,238,677円
期中一部解約元本額	1,044,039,859円	2,171,620,650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	135,845,810円	363,772,901円
ド（F0Fs用）（適格機関投資		
家専用）		
DCダイワ・ターゲットイ	747,557円	2,439,183円
ヤー2050		

iFree 日本債券イン デックス	128,400,956円	585,908,873円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,767,217,281円	2,395,094,854円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	6,314,635,022円	7,045,215,556円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,606,266,384円	4,331,412,238円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,135,898,805円	1,341,288,259円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	924,064,741円	1,090,968,391円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	715,468,649円	803,478,222円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	235,660,379円	264,932,494円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	51,940,084円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	65,163,259円	67,550,309円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	8,870,941円	15,586,155円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	153,980,501円	417,649,293円
ダイワつみたてインデックス バランス30	4,084,360円	26,521,697円
ダイワつみたてインデックス バランス50	506,442円	9,216,104円

	ダイワつみたてインデックス バランス70	876,781円	4,849,504円
	ダイワ世界バランスファンド 40VA	312,252,348円	296,337,265円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	198,406,785円	191,683,814円
	計	15,760,287,085円	19,253,905,112円
2.	期末日における受益権の総数	15,760,287,085口	19,253,905,112口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年12月18日現在	2020年12月18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	32,212,830	27,901,390
地方債証券	4,415,500	472,600
特殊債券	1,725,200	223,200
社債券	2,607,800	381,600
合計	40,961,330	28,978,790

(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2019年12月18日まで、及び2020年12月1日から2020年12月18日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.2995円	1.2933円
(1万口当たり純資産額)	(12,995円)	(12,933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	4 0 8 2年国債	160,000,000	160,387,200	
	4 0 9 2年国債	40,000,000	40,104,800	
	4 1 3 2年国債	120,000,000	120,424,800	
	4 1 4 2年国債	170,000,000	170,649,400	



4 1 5	2年国債	100,000,000	100,411,000	
4 1 6	2年国債	20,000,000	20,086,600	
4 1 7	2年国債	130,000,000	130,578,500	
4 1 8	2年国債	160,000,000	160,761,600	
1 3 1	5年国債	190,000,000	190,532,000	
1 3 2	5年国債	190,000,000	190,668,800	
1 3 3	5年国債	230,000,000	230,966,000	
1 3 4	5年国債	170,000,000	170,833,000	
1 3 5	5年国債	360,000,000	361,983,600	
1 3 6	5年国債	300,000,000	301,803,000	
1 3 7	5年国債	410,000,000	412,767,500	
1 3 8	5年国債	310,000,000	312,284,700	
1 3 9	5年国債	320,000,000	322,553,600	
1 4 0	5年国債	140,000,000	141,204,000	
1 4 1	5年国債	240,000,000	242,215,200	
1 4 2	5年国債	40,000,000	40,410,000	
1 4 3	5年国債	280,000,000	282,928,800	
1 4 4	5年国債	200,000,000	202,170,000	
1 4 5	5年国債	17,000,000	17,186,660	
1	40年国債	30,000,000	43,930,500	
2	40年国債	38,000,000	53,987,740	
3	40年国債	19,000,000	27,136,940	
4	40年国債	30,000,000	43,002,600	
5	40年国債	35,000,000	48,595,750	
6	40年国債	28,000,000	38,299,800	
7	40年国債	31,000,000	40,790,110	

8	40年国債	33,000,000	40,614,750	
9	40年国債	40,000,000	36,868,000	
10	40年国債	91,000,000	98,249,060	
11	40年国債	85,000,000	89,090,200	
12	40年国債	99,000,000	93,875,760	
13	40年国債	115,000,000	108,924,550	
321	10年国債	65,000,000	65,910,650	
322	10年国債	140,000,000	141,786,400	
323	10年国債	70,000,000	71,080,100	
324	10年国債	80,000,000	81,114,400	
325	10年国債	160,000,000	162,606,400	
326	10年国債	20,000,000	20,332,400	
327	10年国債	90,000,000	91,675,800	
328	10年国債	60,000,000	60,992,400	
329	10年国債	200,000,000	204,682,000	
330	10年国債	81,000,000	83,088,180	
331	10年国債	10,000,000	10,202,700	
332	10年国債	65,000,000	66,437,150	
333	10年国債	83,000,000	84,987,020	
334	10年国債	320,000,000	328,259,200	
335	10年国債	210,000,000	215,023,200	
337	10年国債	230,000,000	234,066,400	
338	10年国債	80,000,000	81,844,000	
339	10年国債	115,000,000	117,809,450	
340	10年国債	175,000,000	179,473,000	
341	10年国債	15,000,000	15,320,550	

3 4 2	10年国債	60,000,000	60,696,000	
3 4 3	10年国債	180,000,000	182,190,600	
3 4 4	10年国債	50,000,000	50,636,500	
3 4 5	10年国債	280,000,000	283,634,400	
3 4 6	10年国債	40,000,000	40,540,800	
3 4 7	10年国債	235,000,000	238,226,550	
3 4 8	10年国債	240,000,000	243,343,200	
3 4 9	10年国債	250,000,000	253,612,500	
3 5 0	10年国債	230,000,000	233,270,600	
3 5 1	10年国債	220,000,000	223,152,600	
3 5 2	10年国債	245,000,000	248,437,350	
3 5 3	10年国債	260,000,000	263,658,200	
3 5 4	10年国債	190,000,000	192,597,300	
3 5 5	10年国債	105,000,000	106,389,150	
3 5 6	10年国債	185,000,000	187,355,050	
3 5 7	10年国債	100,000,000	101,172,000	
3 5 8	10年国債	235,000,000	237,610,850	
3 5 9	10年国債	240,000,000	242,392,800	
3 6 0	10年国債	235,000,000	237,173,750	
2	30年国債	9,000,000	11,000,250	
3	30年国債	4,000,000	4,870,360	
4	30年国債	8,000,000	10,290,080	
5	30年国債	8,000,000	9,801,680	
6	30年国債	9,000,000	11,308,230	
7	30年国債	12,000,000	15,046,320	
10	30年国債	15,000,000	16,814,250	

1 1	3 0 年国債	9,000,000	10,770,480	
1 2	3 0 年国債	11,000,000	13,743,290	
1 3	3 0 年国債	11,000,000	13,637,800	
1 4	3 0 年国債	22,000,000	28,501,880	
1 5	3 0 年国債	21,000,000	27,582,660	
1 6	3 0 年国債	26,000,000	34,253,180	
1 7	3 0 年国債	17,000,000	22,228,520	
1 8	3 0 年国債	20,000,000	25,942,400	
1 9	3 0 年国債	15,000,000	19,506,150	
2 0	3 0 年国債	16,000,000	21,332,800	
2 1	3 0 年国債	16,000,000	20,922,720	
2 2	3 0 年国債	17,000,000	22,783,910	
2 3	3 0 年国債	16,000,000	21,514,880	
2 4	3 0 年国債	15,000,000	20,220,750	
2 5	3 0 年国債	17,000,000	22,446,970	
2 6	3 0 年国債	32,000,000	42,839,680	
2 7	3 0 年国債	32,000,000	43,573,760	
2 8	3 0 年国債	34,000,000	46,530,700	
2 9	3 0 年国債	43,000,000	58,412,920	
3 0	3 0 年国債	56,000,000	75,372,640	
3 1	3 0 年国債	76,000,000	101,360,440	
3 2	3 0 年国債	45,000,000	61,151,400	
3 3	3 0 年国債	95,000,000	124,183,050	
3 4	3 0 年国債	70,000,000	94,570,000	
3 5	3 0 年国債	92,000,000	121,128,120	
3 6	3 0 年国債	88,000,000	116,251,520	

37	30年国債	83,000,000	108,342,390	
38	30年国債	65,000,000	83,759,000	
39	30年国債	50,000,000	65,546,500	
40	30年国債	44,000,000	56,843,600	
41	30年国債	45,000,000	57,259,350	
42	30年国債	53,000,000	67,508,750	
43	30年国債	55,000,000	70,129,950	
44	30年国債	50,000,000	63,820,000	
45	30年国債	57,000,000	70,190,370	
46	30年国債	95,000,000	117,059,950	
47	30年国債	62,000,000	77,903,000	
48	30年国債	68,000,000	82,292,920	
49	30年国債	68,000,000	82,330,320	
50	30年国債	60,000,000	64,106,400	
51	30年国債	75,000,000	71,125,500	
52	30年国債	69,000,000	68,608,080	
53	30年国債	75,000,000	76,286,250	
54	30年国債	64,000,000	68,137,600	
55	30年国債	56,000,000	59,581,760	
56	30年国債	60,000,000	63,795,000	
57	30年国債	70,000,000	74,375,700	
58	30年国債	75,000,000	79,536,750	
59	30年国債	55,000,000	56,902,450	
60	30年国債	58,000,000	62,886,500	
61	30年国債	50,000,000	51,569,000	
62	30年国債	46,000,000	44,997,660	

6 3	3 0 年国債	55,000,000	52,259,350	
6 4	3 0 年国債	50,000,000	47,431,500	
6 5	3 0 年国債	55,000,000	52,089,950	
6 6	3 0 年国債	102,000,000	96,444,060	
6 7	3 0 年国債	59,000,000	58,778,750	
6 8	3 0 年国債	60,000,000	59,698,200	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	42,087,730	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,383,040	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	24,730,080	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	36,247,750	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,110,220	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	41,021,600	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,374,560	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	31,453,500	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	36,964,200	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	44,572,080	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	31,746,900	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	20,259,700	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	26,901,750	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	12,873,720	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	19,602,720	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	18,394,170	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	57,462,070	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,338,820	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	27,177,250	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	18,564,850	

7 9	2 0 年国債	14,000,000	15,351,980	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	71,613,750	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	30,982,840	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	34,631,650	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	6,766,200	
8 7	2 0 年国債	35,000,000	39,284,700	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	37,418,040	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	16,925,250	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	51,019,200	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	20,394,180	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	51,268,500	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	34,730,100	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	26,325,570	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	28,916,250	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	39,094,900	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	61,216,060	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	40,843,950	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	21,267,900	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	11,874,600	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	24,778,320	
1 0 4	2 0 年国債	64,000,000	74,549,120	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	44,441,000	
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	18,836,640	
1 0 7	2 0 年国債	20,000,000	23,490,200	
1 0 8	2 0 年国債	68,000,000	78,773,240	
1 0 9	2 0 年国債	60,000,000	69,771,600	

1 1 0	2 0 年国債	27,000,000	31,844,880	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	41,736,800	
1 1 2	2 0 年国債	40,000,000	47,357,600	
1 1 3	2 0 年国債	70,000,000	83,186,600	
1 1 4	2 0 年国債	45,000,000	53,647,200	
1 1 5	2 0 年国債	42,000,000	50,449,560	
1 1 6	2 0 年国債	27,000,000	32,550,930	
1 1 7	2 0 年国債	77,000,000	92,117,410	
1 1 8	2 0 年国債	13,000,000	15,476,240	
1 1 9	2 0 年国債	23,000,000	26,944,040	
1 2 0	2 0 年国債	75,000,000	86,436,000	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	50,741,460	
1 2 4	2 0 年国債	55,000,000	65,897,700	
1 2 5	2 0 年国債	25,000,000	30,555,750	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	25,237,590	
1 2 7	2 0 年国債	70,000,000	83,410,600	
1 2 8	2 0 年国債	32,000,000	38,260,800	
1 2 9	2 0 年国債	95,000,000	112,593,050	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	33,273,800	
1 3 1	2 0 年国債	70,000,000	82,435,500	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	29,527,500	
1 3 3	2 0 年国債	80,000,000	95,364,000	
1 3 4	2 0 年国債	15,000,000	17,924,850	
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	23,676,400	
1 3 6	2 0 年国債	80,000,000	93,811,200	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	21,358,080	



1 3 9	2 0 年国債	120,000,000	141,018,000	
1 4 0	2 0 年国債	20,000,000	23,784,600	
1 4 1	2 0 年国債	48,000,000	57,205,920	
1 4 2	2 0 年国債	90,000,000	108,330,300	
1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	56,743,200	
1 4 4	2 0 年国債	70,000,000	81,902,800	
1 4 5	2 0 年国債	130,000,000	155,573,600	
1 4 6	2 0 年国債	115,000,000	137,899,950	
1 4 7	2 0 年国債	110,000,000	130,750,400	
1 4 8	2 0 年国債	110,000,000	129,536,000	
1 4 9	2 0 年国債	140,000,000	165,109,000	
1 5 0	2 0 年国債	115,000,000	134,272,850	
1 5 1	2 0 年国債	120,000,000	136,992,000	
1 5 2	2 0 年国債	110,000,000	125,668,400	
1 5 3	2 0 年国債	140,000,000	162,036,000	
1 5 4	2 0 年国債	100,000,000	114,489,000	
1 5 5	2 0 年国債	120,000,000	133,880,400	
1 5 6	2 0 年国債	103,000,000	105,656,370	
1 5 7	2 0 年国債	113,000,000	112,407,880	
1 5 8	2 0 年国債	140,000,000	145,523,000	
1 5 9	2 0 年国債	120,000,000	126,459,600	
1 6 0	2 0 年国債	130,000,000	138,914,100	
1 6 1	2 0 年国債	80,000,000	84,168,800	
1 6 2	2 0 年国債	100,000,000	105,119,000	
1 6 3	2 0 年国債	98,000,000	102,920,580	
1 6 4	2 0 年国債	125,000,000	129,098,750	

	1 6 5	2 0 年国債	95,000,000	97,995,350	
	1 6 6	2 0 年国債	115,000,000	122,441,650	
	1 6 7	2 0 年国債	100,000,000	102,888,000	
	1 6 8	2 0 年国債	110,000,000	111,133,000	
	1 6 9	2 0 年国債	80,000,000	79,304,800	
	1 7 0	2 0 年国債	60,000,000	59,367,600	
	1 7 1	2 0 年国債	70,000,000	69,191,500	
	1 7 2	2 0 年国債	95,000,000	95,511,100	
	1 7 3	2 0 年国債	95,000,000	95,431,300	
	1 7 4	2 0 年国債	110,000,000	110,403,700	
国債証券 合計				21,398,324,960	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	101,830,600	
	2 7 - 1 5	北海道公債	100,000,000	101,006,800	
	2 2 2	神奈川県公債	100,000,000	100,181,200	
	4 0 1	大阪府公債	100,000,000	102,263,900	
	3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	102,334,000	
	1 1	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	116,603,400	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	100,298,800	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	101,566,700	
	2 2 - 1	福岡県 1 5 年	100,000,000	108,191,800	
	2 9 - 6	千葉県公債	100,000,000	101,330,100	
	1 1 6	共同発行地方	100,000,000	101,507,700	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	101,402,200	
	1 6 8	共同発行地方	100,000,000	101,013,200	
	2 5 - 6	大阪市公債	100,000,000	101,948,900	
1 1	名古屋市 2 0 年	100,000,000	118,077,800		

地方債証券	合計		1,559,557,100	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	108,027,700	
	8 1 政保道路機構	100,000,000	117,248,200	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	101,424,600	
	2 4 1 政保道路機構	100,000,000	101,922,600	
	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	101,935,500	
	3 6 地方公共団体	100,000,000	101,227,600	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,925,100	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	100,080,200	
特殊債券	合計		833,791,500	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,971,800	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	101,847,100	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,049,500	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,069,500	
	5 N T Tファイナンス	100,000,000	102,232,900	
	8 0 三菱地所	100,000,000	113,048,900	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	107,130,400	
	9 ソフトバンク	100,000,000	100,033,600	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	103,774,600	
社債券	合計		929,158,300	
合計			24,720,831,860	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	469,405,131	552,409,394
コール・ローン	1,682,232,878	1,737,358,108
国債証券	188,425,986,916	210,467,554,675
派生商品評価勘定	16,456,090	13,259,498
未収入金	180,792	7,448,324,125
未収利息	1,234,550,264	1,213,274,427
前払費用	51,176,059	51,013,597
流動資産合計	191,879,988,130	221,483,193,824
資産合計	191,879,988,130	221,483,193,824
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	16,251,715
未払金	382,302	165,911
未払解約金	76,475,415	8,451,045,951
流動負債合計	76,857,717	8,467,463,577

負債合計		76,857,717	8,467,463,577
純資産の部			
元本等			
元本	1	66,497,252,620	70,392,881,865
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		125,305,877,793	142,622,848,382
元本等合計		191,803,130,413	213,015,730,247
純資産合計		191,803,130,413	213,015,730,247
負債純資産合計		191,879,988,130	221,483,193,824

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1. 1 期首	2018年12月19日	2019年12月19日
期首元本額	61,406,010,061円	66,497,252,620円
期中追加設定元本額	9,182,640,549円	13,724,989,200円
期中一部解約元本額	4,091,397,990円	9,829,359,955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 V A	652,317,354円	602,129,178円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30 V A(一般投資家私 募)	22,093,366円	11,992,600円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50 V A(一般投資家私 募)	125,838,485円	102,918,497円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	41,489,203円	29,649,083円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	436,984,397円	339,616,893円
外国債券インデックスファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)	35,285,132円	97,097,761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)	428,909,606円	466,813,735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)	1,503,129,836円	1,839,870,511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)	791,622,418円	667,466,889円
D-I's 外国債券インデックス	2,461,899円	941,122円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	339,166円	1,036,726円
iFree 外国債券インデックス	608,510,044円	834,000,559円
iFree 8資産バランス	797,051,079円	1,020,314,288円
iFree 年金バランス	15,358,920円	58,231,076円



DCダイワ外国債券インデックス	45,573,295,737円	48,655,933,396円
ダイワ・ライフ・バランス30	787,764,479円	824,651,833円
ダイワ・ライフ・バランス50	410,049,356円	464,722,969円
ダイワ・ライフ・バランス70	257,466,417円	286,603,572円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）	419,282,302円	467,184,716円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ6分散コース）	324,748,380円	343,396,307円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）	106,991,375円	113,161,645円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	9,435,326円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	21,613,243円	20,009,459円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,215,568円	5,077,197円
ダイワつみたてインデックス外国債券	72,111,722円	173,829,603円
ダイワつみたてインデックスバランス30	501,780円	3,103,785円
ダイワつみたてインデックスバランス50	57,519円	989,956円
ダイワつみたてインデックスバランス70	199,958円	1,037,838円

ダイワ世界バランスファンド 40VA	198,296,934円	177,567,819円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	149,999,782円	136,813,088円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,917,923,875円	4,235,222,037円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	281,187,508円	248,882,370円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	144,819,210円	142,589,887円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	33,661,572円	32,790,195円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	1,465,206,572円	2,007,724,966円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,744,278,287円	5,869,754,617円
ダイワライフスタイル25	34,675,687円	33,292,265円
ダイワライフスタイル50	61,883,870円	60,140,209円
ダイワライフスタイル75	17,195,256円	16,323,218円
計	66,497,252,620円	70,392,881,865円
2. 期末日における受益権の総数	66,497,252,620口	70,392,881,865口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年12月18日現在
-----	---------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年12月18日現在	2020年12月18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	924,948,753	496,440,174
合計	924,948,753	496,440,174

（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2019年12月18日まで、及び2020年12月1日から2020年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2019年12月18日 現在				2020年12月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	7,654,037,293	-	7,661,067,250	7,029,957
アメリカ・ドル	-	-	-	-	3,547,868,520	-	3,541,475,000	6,393,520
イギリス・ポンド	-	-	-	-	549,431,458	-	550,939,350	1,507,892
イスラエル・シユケル	-	-	-	-	28,578,690	-	28,656,000	77,310
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	219,063,244	-	219,765,600	702,356
カナダ・ドル	-	-	-	-	138,340,290	-	138,190,250	150,040
シンガポール・ドル	-	-	-	-	8,172,895	-	8,172,150	745
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	7,421,940	-	7,482,000	60,060
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	9,469,795	-	9,503,000	33,205
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	16,961,448	-	17,118,690	157,242

ポーランド・ズ ロチ	-	-	-	-	49,476,408	-	49,704,000	227,592
マレーシア・リ ンギット	-	-	-	-	38,695,900	-	38,764,120	68,220
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	64,894,841	-	64,682,970	211,871
ユーロ	-	-	-	-	2,975,661,864	-	2,986,614,120	10,952,256
買 建	1,578,997,990	-	1,595,454,080	16,456,090	963,081,620	-	967,119,360	4,037,740
アメリカ・ドル	588,772,159	-	590,380,650	1,608,491	402,881,582	-	400,416,000	2,465,582
イギリス・ポ ンド	43,044,284	-	43,791,900	747,616	11,983,764	-	12,039,140	55,376
オーストラ リア・ドル	6,661,404	-	6,743,700	82,296	8,062,994	-	8,094,770	31,776
カナダ・ドル	23,091,495	-	23,351,100	259,605	-	-	-	-
ノルウェー・ク ローネ	33,540,812	-	34,129,920	589,108	-	-	-	-
ポーランド・ズ ロチ	27,444,600	-	28,238,070	793,470	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	42,179,712	-	43,596,500	1,416,788	-	-	-	-
ユーロ	775,178,992	-	785,154,240	9,975,248	540,153,280	-	546,569,450	6,416,170
南アフリカ・ラ ンド	39,084,532	-	40,068,000	983,468	-	-	-	-
合計	1,578,997,990	-	1,595,454,080	16,456,090	8,617,118,913	-	8,628,186,610	2,992,217

(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。

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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月18日現在	2020年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.8844円	3.0261円
(1万口当たり純資産額)	(28,844円)	(30,261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	2% United States Treasury Note/Bond 20220215	アメリカ・ドル 3,224,000.000	アメリカ・ドル 3,294,766.800	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,515,557.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,606,473.280	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,858,371.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,525,348.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,865,044.550	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,853,500.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,397,926.470	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,651,398.620	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,294,202.720	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	759,889.140	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,099,401.750			



6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	974,151.820	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	951,069.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	995,082.300	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	641,983.980	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,064,581.140	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,434,241.120	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,724,168.880	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,325,283.960	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	812,623.720	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	782,449.590	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,420,566.290	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,658,631.600	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,616,828.600	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,824,353.300	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,571,176.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,543,009.000	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,559,693.600	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,201,663.750	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,998,650.280	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	2,087,590.050	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,147,374.180	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,888,045.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,118,518.130	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,732,678.860	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,753,009.380	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	2,010,246.400	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,431,026.560	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,892,055.980	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,520,940.960	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,982,489.200	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,660,522.030	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,528,080.270	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,642,882.480	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,531,195.220	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,378,930.140	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,951,109.640	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,786,000.000	1,815,915.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,235,580.690	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,565,688.370	

2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,148,570.660	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	3,038,333.980	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,883,961.120	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,951,508.630	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,246,062.320	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,657,150.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,670,561.040	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,359,759.960	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,907,830.380	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,305,999.810	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,184,004.970	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	4,267,620.790	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,517,763.200	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,543,440.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,372,432.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	852,475.810	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,641,518.700	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,516,349.760	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,193,976.320	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,639,180.620	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,648,816.690	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,332,255.360	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,050,623.040	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,733,936.260	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,967,581.420	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,141,622.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	4,065,599.790	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,589,250.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,092,340.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,709,636.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,949,243.200	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,859,702.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,478,744.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,589,719.100	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,761,259.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,604,475.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	500,000.000	635,195.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,633,548.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	400,000.000	406,248.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,078,120.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,657,025.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	2,140,000.000	2,362,517.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,069,236.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,639,240.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,609,882.550	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,073,480.900	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,441,588.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,836,149.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,965,453.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,132,480.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,603,900.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,071,940.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,181,380.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,071,010.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,624,201.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,075,000.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,550,000.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,537,908.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,982,215.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,204,360.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,301,701.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,281,472.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,120,140.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,577,925.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,676,550.000	



2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,587,300.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,104,120.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,367,615.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,767,680.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,432,480.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,021,144.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,666,250.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,477,612.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,479,685.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,836,418.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,976,750.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,958,392.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,054,512.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,186,810.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,606,664.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,528,300.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,653,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,110,919.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,952,144.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,658,375.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,656,425.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,326,940.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,110,452.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,777,695.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,519,295.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,790,625.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,851,136.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	4,001,904.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,813,275.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,225,450.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,817,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,309,680.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,200,000.000	2,603,546.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,312,812.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,368,430.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,159,060.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,869,664.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,891,545.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,684,750.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,077,460.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,565,250.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,082,590.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,287,160.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,783,575.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	6,165,413.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,769,325.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,529,185.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,597,720.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,741,400.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,804,488.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,496,016.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,969,437.500	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,399,980.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,740,345.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,091,592.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,584,595.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,273,960.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,687,285.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	3,019,380.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,102,320.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,800,300.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,696,475.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,369,476.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,580,220.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,232,500.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,942,184.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,147,800.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,071,580.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,662,875.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,140,850.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,965,801.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,047,810.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,195,690.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,312,033.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,253,030.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,519,860.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,131,080.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,144,600.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,089,160.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,684,375.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,647,450.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,523,610.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,113,560.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,775,429.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,534,850.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,310,367.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,801,060.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,387,232.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,825,250.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	202,436.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	310,617.000	

1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,379,140.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	1,200,000.000	1,209,228.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,512,300.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,664.000	
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	1,606,736.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,614,750.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,497,655.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,706,939.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,200,000.000	3,200,608.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	5,700,000.000	5,675,946.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	5,039,552.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,725,750.000	



0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	500,015.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,482,220.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,990,370.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,511,770.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,500,165.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,471,275.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,479,490.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,860.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,385,108.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,500,105.000	
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	9,734,300.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,927,700.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	6,223,630.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,655,900.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,473,995.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	2,999,880.000	
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	6,466,460.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	2,999,880.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,933,120.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,483,585.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,193,910.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,000,000.000	3,006,420.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	2,800,000.000	2,786,196.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,499,860.000	

	0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,977,480.000	
	0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,962,160.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	2,100,000.000	2,075,535.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	3,000,000.000	2,951,250.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	3,000,090.000	
	0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	5,099,592.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 872,917,237.380 (90,137,433,931)	
イギリス・ポ ンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,621,000.000	1,776,275.590	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,802,497.940	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,587,986.750	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,341,367.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,255,133.600	

1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,350,000.000	2,758,148.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,510,000.000	1,981,029.400	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,010,000.000	2,165,031.300	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,042,600.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,675,725.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,060,000.000	1,501,627.800	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,863,702.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,110,000.000	1,371,149.700	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,056,091.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,800,000.000	1,904,256.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,676,050.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	940,000.000	1,027,683.200	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,307,107.000	

0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,321,137.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	650,000.000	593,580.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,507,380.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,000,000.000	999,660.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,042,316.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	900,000.000	903,663.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,304,849.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	300,000.000	296,688.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,387,343.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,641,908.800	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,786,154.240	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,555,640.780	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,305,163.040	

4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,927,980.520	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,465,028.960	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,589,514.080	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,243,969.760	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,637,579.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,537,155.310	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,353,697.580	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,450,671.580	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,931,491.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,074,000.000	2,251,243.620	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,613,025.920	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,829,652.960	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,312,712.680	

	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,286,731.720	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,681,444.520	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,349,536.840	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,205,382.360	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,376,798.910	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 100,782,562.560 (14,111,574,410)	
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	2,671,140.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,121,440.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,966,680.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,207,713.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,227,980.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,449,891.000	

	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,964,916.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,021,810.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,100,000.000	2,882,250.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	2,015,262.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,555,320.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,010,050.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,900,000.000	1,926,011.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	600,000.000	603,900.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	700,000.000	698,488.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	1,000,000.000	998,340.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 29,321,191.000 (933,879,933)	
オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	オーストラリア・ドル 3,162,000.000	オーストラリア・ドル 3,443,987.160	



5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,016,283.520	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,519,745.890	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	3,473,000.000	3,778,450.350	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,758,464.000	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,498,000.000	3,943,575.240	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,745,990.780	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,248,000.000	3,905,817.440	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,484,274.540	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,550,781.640	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	1,000,541.520	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,057,329.120	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	3,678,000.000	4,093,503.660	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,542,113.440	

2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	800,000.000	815,632.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,230,192.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,926,035.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	3,019,068.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	4,870,000.000	5,563,098.400	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,190,000.000	1,401,010.800	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,974,843.200	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	900,000.000	914,607.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,401,560.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,000,000.000	3,004,500.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,500,000.000	1,427,070.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,900,000.000	1,889,132.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,483,100.000	

	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	2,700,000.000	2,702,214.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 73,592,920.700 (5,785,139,497)	
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	602,445.600	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	862,381.040	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,393,068.280	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,755,544.220	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,620,394.160	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,389,932.940	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,816,154.710	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,173,734.240	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,291,078.670	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,509,855.150	

2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,803,786.810	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,250,248.680	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,022,236.860	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,276,890.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,445,875.200	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,773,695.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,323,612.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,442,588.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,360,359.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	2,160,000.000	2,551,435.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,379,490.600	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,274,196.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,459,738.000	

1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,610,149.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	725,466.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,116,654.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,090.550	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,900,317.300	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,302,001.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	700,448.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	900,000.000	874,989.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	500,000.000	494,545.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	500,000.000	498,985.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,500,510.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 51,507,895.210 (4,175,229,986)	
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	902,468.000	
3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	825,343.320	
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	682,496.500	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	956,699.130	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	511,600.000	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	711,125.800	
3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	721,644.000	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	728,875.000	
2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	568,487.600	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	910,224.000	
2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	486,765.000	
1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	509,000.000	
2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	650,000.000	751,972.000	

	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	463,185.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	621,500.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	514,647.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	417,529.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	410,000.000	483,554.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	150,000.000	149,928.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 11,917,043.350 (927,622,654)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	7,322,221.900	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	8,945,981.300	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,473,998.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,560,932.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,727,977.600	

	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,872,367.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,981,492.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	3,000,000.000	3,046,590.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 56,931,561.150 (709,936,567)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	26,194,152.600	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,150,668.020	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,719,166.720	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,482,151.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,443,701.800	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,373,659.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,200,000.000	2,417,976.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 63,781,475.140 (1,084,285,077)	



ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	ノルウェー・クローネ 8,204,000.000	ノルウェー・クローネ 8,539,789.720	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,435,540.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,668,364.650	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,489,665.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,664,590.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,797,080.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	4,129,741.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,997,904.000	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 38,722,674.970 (466,221,006)		
ポーランド・ズ ロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	ポーランド・ズロチ 2,309,000.000	ポーランド・ズロチ 2,542,555.350	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,818,157.830	

2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,505,322.600	
2.25% Poland Government Bond 20220425	3,320,000.000	3,421,924.000	
2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	4,050,354.000	
2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,095,409.800	
2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,499,208.000	
2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,658,026.000	
Poland Government Bond 20220725	1,600,000.000	1,599,648.000	
0.75% Poland Government Bond 20250425	1,000,000.000	1,014,210.000	
1.25% Poland Government Bond 20301025	1,000,000.000	1,000,540.000	
5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,148,703.000	
4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,919,367.500	
2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	4,111,323.500	
3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,179,153.010	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 47,563,902.590	

			(1,355,571,224)	
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	2,525,465.250	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,350,341.400	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,676,376.500	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,445,678.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	898,362.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	795,042.910	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,035,394.360	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,518,285.190	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,291,150.760	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	705,282.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,135,387.120	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,878,739.200	

3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,201,449.240	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,340,755.600	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,365,433.440	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,057,307.700	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	706,693.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	358,216.320	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	100,000.000	102,547.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	803,572.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,295,719.600	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,214,755.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,286,076.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	2,500,000.000	2,603,100.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,374,588.000	

	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	703,344.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	704,606.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,091,259.000	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,405,464.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	419,916.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,383,265.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,825,565.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	700,000.000	723,877.000	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	500,000.000	496,045.000	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 40,719,060.590 (1,041,593,570)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	23,290,000.000	24,262,823.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	16,300,000.000	18,948,750.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	29,000,000.000	29,797,210.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	26,581,506.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	7,200,000.000	7,559,136.000	

	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	32,951,606.940	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	28,587,510.420	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	31,621,459.840	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	12,331,221.660	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	35,788,715.280	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	20,724,714.500	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	15,015,000.000	17,507,039.550	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,479,277.220	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	22,327,926.700	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	9,274,858.320	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 347,743,755.730 (1,808,267,530)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	614,000.000	689,043.080	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	300,240.270	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	862,595.820	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,052.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	494,481.600	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	777,322.700	

0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	860,648.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	439,116.000	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	541,400.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	544,090.000	
Finland Government Bond 20240915	200,000.000	205,458.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	324,427.400	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	426,088.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	520,770.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,501,128.360	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,219,503.040	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	1,085,244.160	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	406,365.600	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	916,308.000	

0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,372,672.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	1,212,235.200	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	404,940.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	986,562.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,062,104.400	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	820,040.000	
Austria Government Bond 20300220	680,000.000	707,614.800	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,016,340.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	837,914.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	403,056.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,815,296.550	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	2,025,588.680	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,406,716.800	



1% Belgium Government Bond 20260622	2,283,000.000	2,494,474.290	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,659,632.840	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	1,081,977.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	1,490,000.000	1,529,350.900	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,202,443.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,099,749.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	480,000.000	782,529.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	497,260.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,477,457.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	350,000.000	415,758.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,677,105.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	831,216.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,277,803.600	

0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	697,026.000	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,247,760.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,186,137.200	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,736,204.250	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,160,822.380	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,354,776.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,212,028.850	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,640,238.400	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,443,814.850	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	6,199,220.290	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,505,190.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,935,775.850	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	5,179,580.280	

2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,858,806.690	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,308,080.280	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,720,332.240	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,708,050.240	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,479,865.500	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,917,734.480	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,718,349.360	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,687,487.830	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,479,000.000	4,282,968.300	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,719,240.580	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,309,378.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,312,388.240	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,397,067.960	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,525,661.440	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,525,415.200	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,462,626.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,492,349.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,370,000.000	3,348,336.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,068,207.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,724,192.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,368,718.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,170,160.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,750,000.000	1,840,737.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,850,747.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	2,012,214.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,098,580.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,000,000.000	1,057,740.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,273,200.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	805,688.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	302,685.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	101,071.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	101,289.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	101,474.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,171,101.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,128,644.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,833,884.900	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,942,541.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,969,785.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,750,864.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,480,544.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,385,215.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	103,735.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,418,722.500	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,023,159.250	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	5,020,654.240	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	5,060,548.840	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,564,838.250	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,829,679.280	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	4,092,063.800	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,685,861.810	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,564,000.000	6,759,054.720	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,954,371.190	

3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,857,184.760	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,811,209.600	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,199,000.000	6,406,155.810	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,899,090.880	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,475,738.960	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,549,460.030	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,609,807.140	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,887,000.000	7,528,001.250	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,380,032.810	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,678,298.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,525,658.250	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,874,381.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	4,024,558.510	

1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,660,984.300	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,971,658.260	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,944,732.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,041,560.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,398,850.700	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,753,260.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,000,000.000	2,917,580.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,439,360.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,824,072.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,710,335.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,447,079.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,479,798.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,411,872.000	



1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,750,000.000	3,668,362.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,250,000.000	3,517,215.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,221,239.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,800,000.000	2,904,608.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,437,344.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,870,000.000	2,085,723.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,098,850.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,200,000.000	1,295,304.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	2,000,000.000	2,069,060.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	642,491.640	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,644,135.110	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,685,000.000	2,893,566.250	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	865,085.060	

3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,479,000.000	2,766,499.080	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,505,701.040	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,591,423.360	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,474,789.550	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,827,388.980	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,664,158.520	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,872,597.960	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,748,401.200	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,209,120.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,407,196.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,431,990.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,271,141.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,285,788.000	

0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	1,034,352.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,468,712.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	832,176.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	600,000.000	620,358.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,150,928.040	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,578,697.500	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,417,235.120	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	2,009,131.980	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,146,341.240	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,668,128.580	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,671,187.220	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,296,837.550	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,087,550.540	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,554,985.600	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	2,096,815.700	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,401,332.850	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,943,168.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,775,390.520	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,144,297.920	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,595,802.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,305,299.600	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,810,455.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,710,905.500	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,395,030.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	2,050,000.000	2,094,464.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,734,910.500	

2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	3,036,663.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,738,046.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,706,032.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,701,518.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,364,474.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,958,045.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,391,936.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,050,000.000	1,256,020.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,375,406.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,747,935.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,695,551.600	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,984,687.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,586,642.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,323,529.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,356,816.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,344,860.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,675,062.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,059,676.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	747,755.200	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,330,160.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,458,100.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,250,000.000	1,570,012.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,616,880.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,052,480.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,507,184.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,093,120.000	

1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,667,000.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,323,972.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,786,564.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	800,000.000	822,320.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	800,000.000	888,360.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,300,000.000	1,347,086.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	100,000.000	100,980.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	800,000.000	855,320.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,922,604.820	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,411,562.540	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,866,285.850	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,545,676.120	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,970,040.800	

5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,402,871.640	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,559,026.840	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,581,947.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,771,761.510	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,558,996.100	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,144,590.800	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,825,284.920	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,177,266.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,225,977.800	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,116,639.700	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	3,106,194.770	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,533,762.840	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,527,496.340	



3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,838,000.000	3,625,289.580	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,635,549.030	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,473,836.480	
5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,674,804.320	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	929,926.950	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,926,401.760	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,278,327.050	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,433,347.720	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,165,187.400	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,439,179.560	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,550,260.140	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,682,906.050	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,071,033.660	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,298,245.510	

3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	689,002.080	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	688,004.150	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,214,925.030	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	525,571.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,117,845.300	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,166,833.850	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	704,957.000	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,609.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	882,688.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	890,542.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	879,150.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	1,200,000.000	1,355,124.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	799,866.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	250,000.000	267,732.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	837,192.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	525,320.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,206,067.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,353,390.650	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,134,017.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	843,241.940	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	941,201.920	

3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	827,146.840	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,096,461.310	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,026,599.910	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,051,775.070	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,017,818.560	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	812,419.340	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	488,642.350	
1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	324,948.000	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	469,334.720	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	649,388.850	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	577,567.490	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,986,062.080	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,235,594.000	

1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,441,408.040	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,476,192.800	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,086,267.580	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,943,830.720	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,844,017.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,235,151.800	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,109,224.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,126,005.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	2,200,000.000	2,787,224.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,294,729.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,631,056.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,129,216.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,922,947.000	

0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,458,344.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,134,840.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,812,496.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,550,000.000	1,885,265.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,368,517.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,972,368.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,428,544.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,494,636.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	1,500,000.000	1,532,010.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,251,636.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,575,560.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,250,262.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	900,000.000	1,003,302.000	

SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	511,210.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,265,765.590	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,964,805.560	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,922,186.580	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,966,190.720	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,552,702.180	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,715,301.270	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,669,059.500	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,120,692.920	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,207,664.580	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,174,458.850	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,517,134.700	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,199,000.000	2,380,230.820	

	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,262,210.100	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,366,946.810	
	ユーロ 小計		ユーロ 694,940,324.740 (87,930,799,290)	
国債証券 合計			210,467,554,675 [210,467,554,675]	
合計			210,467,554,675 [210,467,554,675]	

- (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%	43.0%
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シケル	国債証券 16銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	100%	2.7%
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	0.6%

マレーシア・リングgit	国債証券	34銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	329銘柄	100%	41.8%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月19日から2021年6月18日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### 【中間財務諸表】

## DCダイワ・ターゲットイヤー2040

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2021年6月18日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	634,774
親投資信託受益証券	171,477,317
流動資産合計	172,112,091
資産合計	172,112,091
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	23,756
未払委託者報酬	261,765
その他未払費用	5,865
流動負債合計	291,386
負債合計	291,386
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	189,260,938
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	82,559,767
（分配準備積立金）	10,999,325
元本等合計	171,820,705
純資産合計	171,820,705
負債純資産合計	172,112,091

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	15,235,482
<b>営業収益合計</b>	<b>15,235,482</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	8
受託者報酬	23,756
委託者報酬	261,765
その他費用	5,865
<b>営業費用合計</b>	<b>291,394</b>
営業利益又は営業損失（ ）	14,944,088
経常利益又は経常損失（ ）	14,944,088
中間純利益又は中間純損失（ ）	14,944,088
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,507,114
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	50,410,207
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,562,338
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,562,338
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,849,752
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,849,752
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	82,559,767

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年6月18日現在
1. 1 期首元本額	69,129,056円
期中追加設定元本額	34,626,381円
期中一部解約元本額	14,494,499円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	89,260,938口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年6月18日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9249円 (19,249円)

## (参考)

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

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

## 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年6月18日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,988,112,138
株式	174,086,041,200

未収配当金		1,040,932,225
未収利息		306,559
その他未収収益	4	18,189,932
流動資産合計		184,133,582,054
資産合計		184,133,582,054
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		38,715,350
前受金		12,480,000
未払金		322,200
未払解約金		128,459,050
受入担保金		5,241,154,915
流動負債合計		5,421,131,515
負債合計		5,421,131,515
純資産の部		
元本等		
元本	1	136,132,322,482
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		42,580,128,057
元本等合計		178,712,450,539
純資産合計		178,712,450,539
負債純資産合計		184,133,582,054

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年6月18日現在
1. 1 期首	2020年12月19日
期首元本額	133,497,261,446円
期中追加設定元本額	11,308,943,548円
期中一部解約元本額	8,673,882,512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	3,008,416,171円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	6,155,138,758円
デックスファンドVA	
適格機関投資家専用・ダイ	927,235円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドVA2	
ダイワ国内重視バランスファ	25,469,299円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	510,184,600円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	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)	756,509,896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)	175,088,858円
D-I's TOPIXイン デックス	31,723,418円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	82,629,355円
iFree TOPIXイン デックス	3,613,001,905円
iFree 8資産バランス	3,003,165,442円
iFree 年金バランス	372,595,305円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,356,872,657円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,831,831,789円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,788,254,563円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,586,002,528円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,715,522,099円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	47,094,552円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	44,191,603円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,115,761,138円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,004,291円
ダイワつみたてインデックス バランス50	8,324,391円
ダイワつみたてインデックス バランス70	14,322,451円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	117,698,161円



	ダイワ世界バランスファンド 60VA		130,882,312円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA		6,537,797,112円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)		580,569,028円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)		82,764,931円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)		149,390,769円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド		163,086,985円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス		10,051,969,047円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		2,229,818,371円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス		2,534,932,275円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX		1,218,830,839円
	ダイワライフスタイル25		157,133,622円
	ダイワライフスタイル50		607,071,577円
	ダイワライフスタイル75		500,212,436円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)		10,790,404,337円
	計		136,132,322,482円
2.	期末日における受益権の総数		136,132,322,482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	4,924,104,980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	945,690,000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17,707,600円が含まれております。
--------------	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2021年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	4,638,755,000	-	4,600,170,000	38,585,000
合計	4,638,755,000	-	4,600,170,000	38,585,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.3128円
（1万口当たり純資産額）	（13,128円）

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年6月18日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	704,345,654
コール・ローン	8,814,167,081
株式	200,444,643,287
投資証券	4,968,455,275
派生商品評価勘定	55,266,821
未収入金	2,898,639
未収配当金	191,502,868
差入委託証拠金	3,882,158,429
流動資産合計	219,063,438,054
資産合計	219,063,438,054
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	116,612,204
未払解約金	54,621,100
流動負債合計	171,233,304
負債合計	171,233,304
純資産の部	

元本等		
元本	1	58,611,778,672
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		160,280,426,078
元本等合計		218,892,204,750
純資産合計		218,892,204,750
負債純資産合計		219,063,438,054

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>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。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年6月18日現在
1. 1 期首	2020年12月19日
期首元本額	53,363,008,733円
期中追加設定元本額	7,454,477,093円
期中一部解約元本額	2,205,707,154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	383,074,716円
VA	

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	4,507,601円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	77,269,909円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	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)	267,789,945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)	28,474,428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)	506,565,003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)	2,480,816,724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 エマーシングプラス(為替 ヘッジなし)	501,832,155円
D-I's 外国株式インデッ クス	12,201,756円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	19,092,977円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	3,178,253,384円
iFree 8資産バランス	1,062,268,425円
iFree 年金バランス	132,006,845円
DCダイワ外国株式インデッ クス	35,999,629,446円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	527,821,640円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	936,384,825円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	716,131,197円

大和DC海外株式インデックス ファンド	1,637,584,146円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	11,410,104円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	8,750,915円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	626,318,463円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,770,834円
ダイワつみたてインデックス バランス50	2,040,718円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,812,471円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	123,939,186円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	229,713,162円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	1,740,567,991円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	90,149,674円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	211,630,253円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	234,082,341円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	859,105,999円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	241,487,857円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	2,881,630,740円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,752,052,138円
ダイワライフスタイル25	13,908,299円
ダイワライフスタイル50	54,350,029円
ダイワライフスタイル75	44,797,112円
計	58,611,778,672円

2. 期末日における受益権の総数	58,611,778,672口
------------------	-----------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2021年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	13,354,058,416	-	13,283,982,830	70,075,586
合計	13,354,058,416	-	13,283,982,830	70,075,586

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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



2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	2021年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	8,561,531,635	-	8,570,261,838	8,730,203
アメリカ・ドル	6,079,637,110	-	6,127,470,525	47,833,415
イギリス・ポンド	351,548,982	-	347,397,030	4,151,952
オーストラリア・ドル	287,276,469	-	282,366,321	4,910,148
カナダ・ドル	378,997,347	-	373,505,990	5,491,357
スイス・フラン	348,667,128	-	343,659,316	5,007,812
ユーロ	1,115,404,599	-	1,095,862,656	19,541,943
合計	8,561,531,635	-	8,570,261,838	8,730,203

## (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。

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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.7346円 (37,346円)

「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年6月18日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,597,835,107
投資証券	2	470,751,595,400
未収配当金		2,072,961,661
前払金		7,280,000
流動資産合計		483,429,672,168
資産合計		483,429,672,168
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		19,096,000
未払金		807,156,804
未払解約金		132,135,000
流動負債合計		958,387,804
負債合計		958,387,804
純資産の部		
元本等		
元本	1	140,306,617,255
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		342,164,667,109
元本等合計		482,471,284,364

純資産合計	482,471,284,364
負債純資産合計	483,429,672,168

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年6月18日現在
1. 1 期首	2020年12月19日
期首元本額	134,624,414,134円
期中追加設定元本額	17,646,341,619円
期中一部解約元本額	11,964,138,498円
期末元本額の内訳	
ファンド名	

	ダイワJ-REITオープン	5,364,002,189円
	ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	123,887,328,286円
	ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	330,589,486円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,786,836円
	iFree J-REITイ ンデックス	435,792,027円
	iFree 8資産バランス DC・ダイワJ-REIT オープン	1,137,138,029円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,408,517,089円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,714,086円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	3,462,201円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	103,223,698円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,747,304,843円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	381,011,222円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	473,849,325円
	計	1,024,897,938円
2.	期末日における受益権の総数	140,306,617,255円
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。  投資証券 5,668,800,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
--	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2021年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	11,722,480,000	-	11,704,000,000	18,480,000
合計	11,722,480,000	-	11,704,000,000	18,480,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年6月18日現在
1口当たり純資産額	3.4387円
（1万口当たり純資産額）	（34,387円）

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		110,903,352
コール・ローン		262,387,744
投資信託受益証券		622,644,597
投資証券		41,289,927,914
派生商品評価勘定		723,854
未収入金		1,984,014
未収配当金		66,784,686
差入委託証拠金		355,026,516
流動資産合計		42,710,382,677
資産合計		42,710,382,677
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		15,426,465
未払金		102,931,322
未払解約金		10,012,000
流動負債合計		128,369,787
負債合計		128,369,787
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,876,701,127
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,705,311,763
元本等合計		42,582,012,890
純資産合計		42,582,012,890
負債純資産合計		42,710,382,677

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年6月18日現在
1. 1 期首	2020年12月19日
期首元本額	13,140,962,393円
期中追加設定元本額	3,076,853,085円
期中一部解約元本額	1,341,114,351円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジあり）	6,111,866,480円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジなし）	1,107,156,133円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジあり）	334,253,172円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジなし）	280,894,664円
D-I's グローバルREI Tインデックス	2,302,307円



DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,908,555円
iFree 外国REITイン デックス	450,626,511円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,411,645,138円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	180,369,506円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	72,385,965円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,933,704,319円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,640,277円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,182,980円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	183,749,014円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	218,996,022円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	246,214,021円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	57,204,138円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	829,697,526円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	440,904,399円
計	14,876,701,127円
2. 期末日における受益権の総数	14,876,701,127口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありませぬ。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 不動産投信関連

種 類	2021年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	729,344,793	-	716,171,856	13,172,937
合計	729,344,793	-	716,171,856	13,172,937

#### （注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

### 2. 通貨関連

種 類	2021年6月18日 現在		
	契約額等	時価	評価損益

	(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	304,759,757	-	303,230,083	1,529,674
アメリカ・ドル	157,068,436	-	157,746,547	678,111
イギリス・ポンド	21,702,056	-	21,520,170	181,886
オーストラリア・ドル	14,398,082	-	14,159,963	238,119
カナダ・ドル	8,163,810	-	8,041,995	121,815
ニュージーランド・ドル	5,571,377	-	5,412,512	158,865
ユーロ	92,217,316	-	90,664,896	1,552,420
香港・ドル	5,638,680	-	5,684,000	45,320
合計	304,759,757	-	303,230,083	1,529,674

## (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。

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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年6月18日現在
--	--------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8623円 (28,623円)
---------------------------	----------------------

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2021年6月18日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,546,339
国債証券		276,233,070
未収利息		123,569
前払費用		104,892
流動資産合計		281,007,870
資産合計		281,007,870
負債の部		
流動負債		
未払解約金		171,000
流動負債合計		171,000
負債合計		171,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	268,458,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		12,378,414
元本等合計		280,836,870
純資産合計		280,836,870
負債純資産合計		281,007,870

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年6月18日現在
1. 1 期首	2020年12月19日
期首元本額	6,513,195円
期中追加設定元本額	285,732,826円
期中一部解約元本額	23,787,565円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	13,723,031円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	112,918,639円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	110,391,353円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	31,425,433円
計	268,458,456円
2. 期末日における受益権の総数	268,458,456口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年6月18日現在	
該当事項はありません。	

(1口当たり情報)

2021年6月18日現在	
1口当たり純資産額	1.0461円
(1万口当たり純資産額)	(10,461円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

2021年6月18日現在	
金額(円)	
資産の部	
流動資産	
預金	497,249,119
コール・ローン	917,962,462
国債証券	221,436,637,442
派生商品評価勘定	1,158,564
未収入金	290,803
未収利息	1,201,007,725
前払費用	27,735,982
流動資産合計	224,082,042,097
資産合計	224,082,042,097
負債の部	

流動負債		
派生商品評価勘定		9,025,010
未払金		1,156,380
未払解約金		91,601,040
流動負債合計		101,782,430
負債合計		101,782,430
純資産の部		
元本等		
元本	1	72,210,782,693
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		151,769,476,974
元本等合計		223,980,259,667
純資産合計		223,980,259,667
負債純資産合計		224,082,042,097

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
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

<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>
-----------------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年6月18日現在
1. 1 期首	2020年12月19日
期首元本額	70,392,881,865円
期中追加設定元本額	5,027,596,904円
期中一部解約元本額	3,209,696,076円



外国債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	154,660,845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)	498,835,041円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,128,733,242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)	808,494,807円
D-I's 外国債券インデッ クス	965,742円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	3,825,626円
iFree 外国債券イン デックス	1,271,496,221円
iFree 8資産バランス	1,269,561,547円
iFree 年金バランス	158,703,431円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,167,092,308円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	889,972,710円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	530,896,837円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	335,679,181円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	538,609,262円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	404,124,764円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	145,116,016円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	24,267,697円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,746,746円

ダイワつみたてインデックス 外国債券	325,640,908円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,168,968円
ダイワつみたてインデックス バランス50	1,161,957円
ダイワつみたてインデックス バランス70	1,347,304円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	171,725,827円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	136,407,366円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,132,616,270円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	245,616,231円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	145,270,353円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	36,956,559円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	1,772,936,363円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,815,466,388円
ダイワライフスタイル25	33,321,000円
ダイワライフスタイル50	63,785,425円
ダイワライフスタイル75	17,585,746円
計	72,210,782,693円
2. 期末日における受益権の総数	72,210,782,693口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
--	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	789,748,029	-	781,881,583	7,866,446
アメリカ・ドル	293,594,831	-	294,753,395	1,158,564
イギリス・ポンド	10,565,595	-	10,453,089	112,506
オーストラリア・ドル	20,163,888	-	19,741,033	422,855
スウェーデン・クローナ	22,289,608	-	21,688,800	600,808
デンマーク・クローネ	6,502,158	-	6,376,884	125,274
ユーロ	436,631,949	-	428,868,382	7,763,567
合計	789,748,029	-	781,881,583	7,866,446

（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。

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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年6月18日現在
1口当たり純資産額	3.1018円
(1万口当たり純資産額)	(31,018円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年6月30日

資産総額	175,260,890円
負債総額	26,654円
純資産総額（ - ）	175,234,236円
発行済数量	90,711,099口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.9318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

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

資産総額	223,475,107,172円
負債総額	186,307,130円
純資産総額（ - ）	223,288,800,042円
発行済数量	58,969,372,308口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.7865円

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年6月30日

資産総額	494,373,267,825円
負債総額	1,010,698,756円
純資産総額( - )	493,362,569,069円
発行済数量	140,612,011,488口
1単位当たり純資産額( / )	3.5087円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年6月30日

資産総額	43,007,405,254円
負債総額	296,822,968円
純資産総額( - )	42,710,582,286円
発行済数量	15,004,298,930口
1単位当たり純資産額( / )	2.8466円

(参考) ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年6月30日

資産総額	284,131,701円
負債総額	178,000円
純資産総額( - )	283,953,701円
発行済数量	271,471,017口
1単位当たり純資産額( / )	1.0460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

資産総額	225,871,791,136円
負債総額	573,034,705円
純資産総額( - )	225,298,756,431円

発行済数量 72,541,954,676口

1 単位当たり純資産額 ( / ) 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

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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。

(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て）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて



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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2021年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

###### 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。

###### 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)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>流動資産計</b>	<b>36,088</b>	<b>37,539</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>利益剰余金</b>		
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						
残余金の配当	-	-	-	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
	其他有価 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			
残余金の配当	-	-	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よう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。

剰余金の配当の総額	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
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。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
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係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

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 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。

##### ( ) 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。

#### 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いません。

#### 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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

（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、記載を省略していません。

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せん。

(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(株)	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	(株)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(株)	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せん。

(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いません。

(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。

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。）。

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。）。

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。

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。

上記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】

	名 称	資本金の額 (2020年03月末日現在)	事業の内容	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)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	第一生命保険株式会社	60,000百万円	(注9)	
	株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	(注3)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

## 第3【その他】

## (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
  - ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
  - ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
  - ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
    - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
    - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
  - ・ 使用開始日を記載することがあります。
  - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
    - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
    - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
  - ・ 次の事項を記載することがあります。
    - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
    - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
    - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
  - ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
  - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
  - ・ 図案を採用することがあります。
  - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
  - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
  - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年1月29日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の2019年12月19日から2020年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の2020年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2021年7月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 深井 康治 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の2020年12月19日から2021年6月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の2021年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月19日から2021年6月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。