【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】	2022年2月21日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワライフスタイル２５
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル２５

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2022年2月22日から2022年8月24日まで（継続申込期間）

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信		目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産		目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合		目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分固定型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分変更型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回		目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

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

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

＜信託金の限度額＞

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

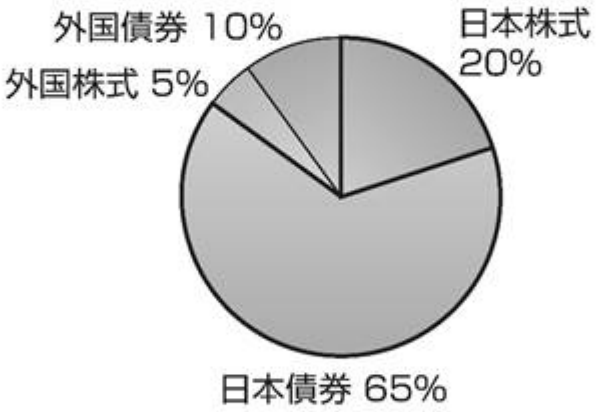
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国内	海外	合計
株式	20%	5%	25%
債券	65%	10%	75%
合計	85%	15%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

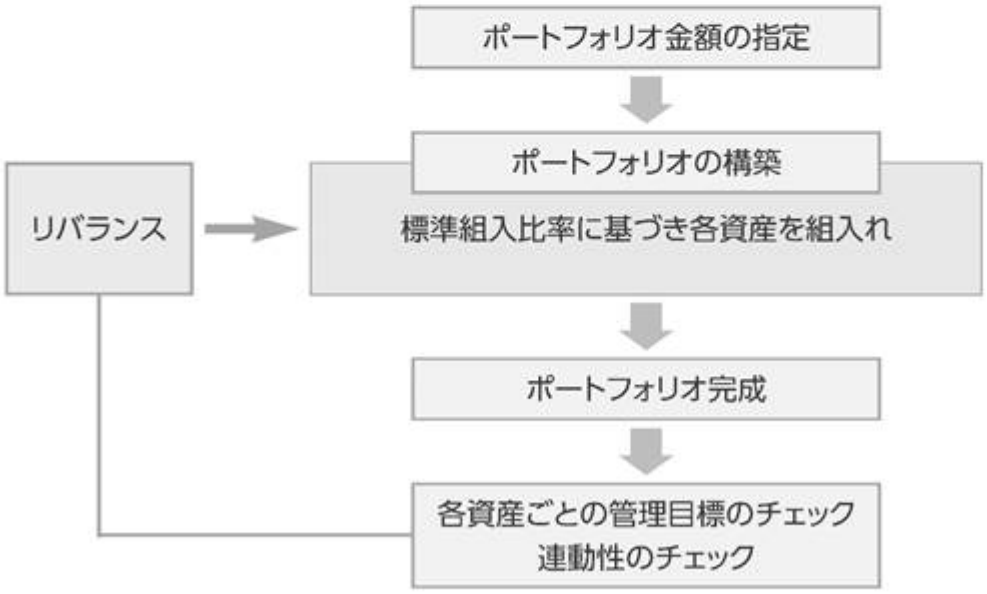
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

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

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

〈分配方針〉

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。

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

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

2．日本債券インデックスマザーファンド

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

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

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

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

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

3. 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

(2)【ファンドの沿革】

2000年 4月28日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2000年12月 1日	ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル２５」）

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

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

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（2021年11月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の65%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

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

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

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

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

(2)【投資対象】

① 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の5．から25．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

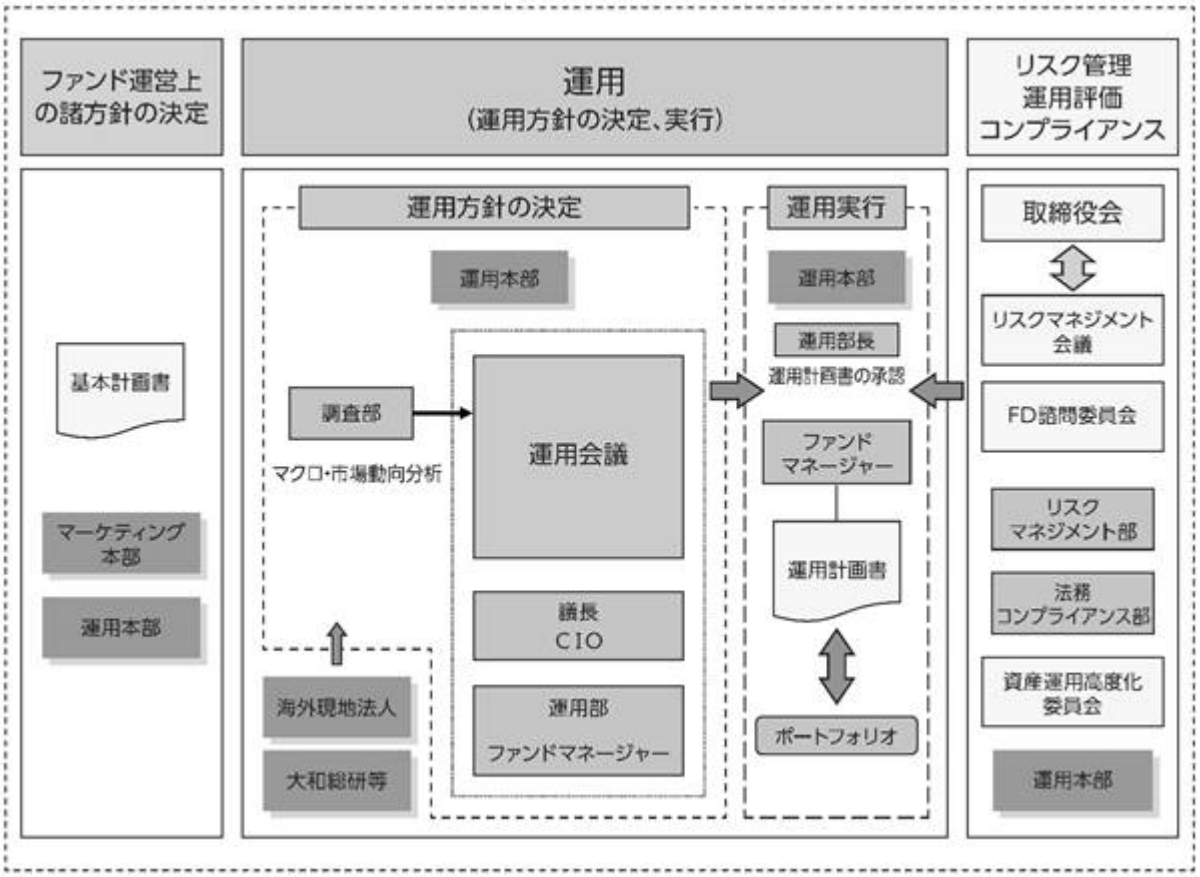
③　前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

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

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（3名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は45～55名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．FD諮問委員会

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

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤　受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

※　上記の運用体制は2021年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券、新株予約権証券および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券、新株予約権証券および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

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

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥ 信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

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

⑦　先物取引等（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産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。

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

※2022年3月12日に信託約款を変更し、下記とします。

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

2．日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

②　株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　外貨建資産への投資は、行ないません。

3．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー
11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17．外国法人が発行する譲渡性預金証書
18．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、こ

れを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換

金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

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

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

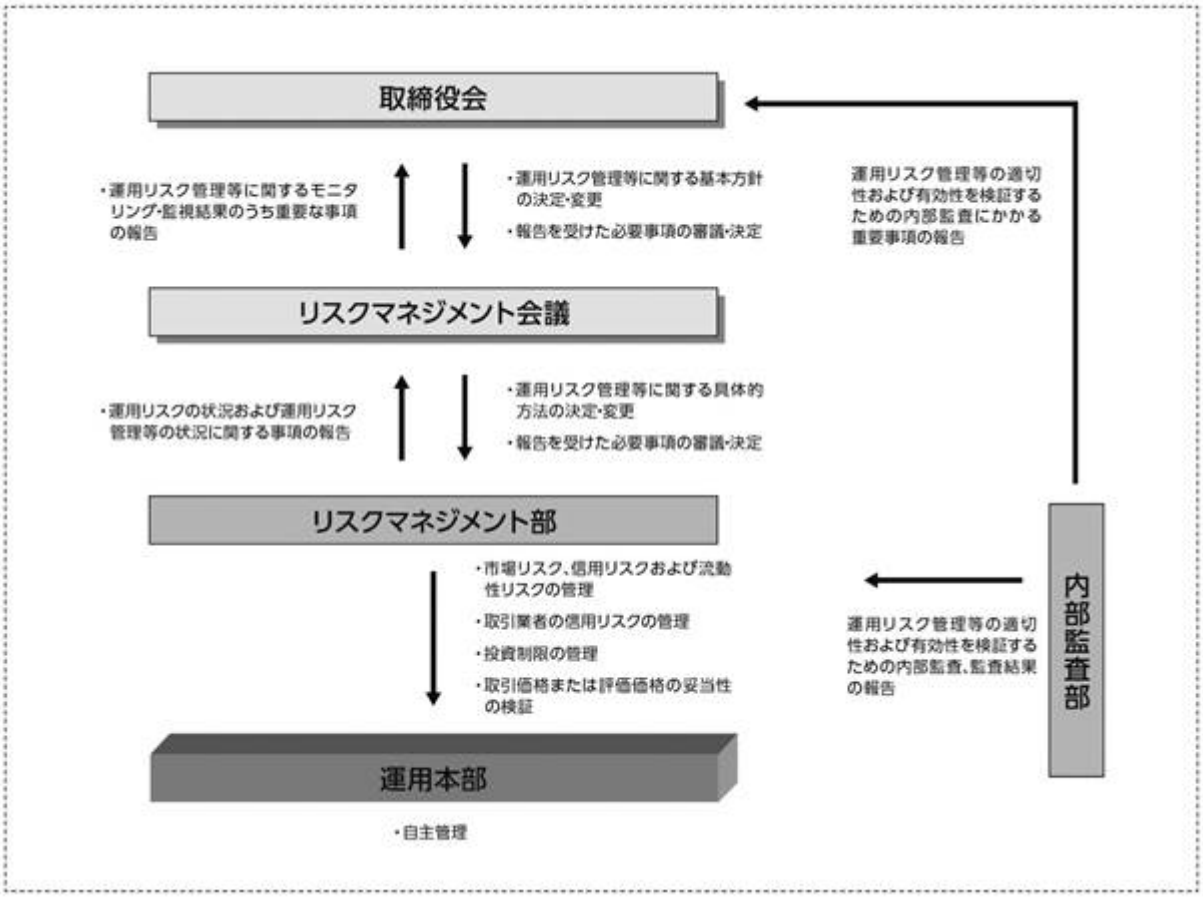
※　流動性リスクに関する事項

・　当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(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

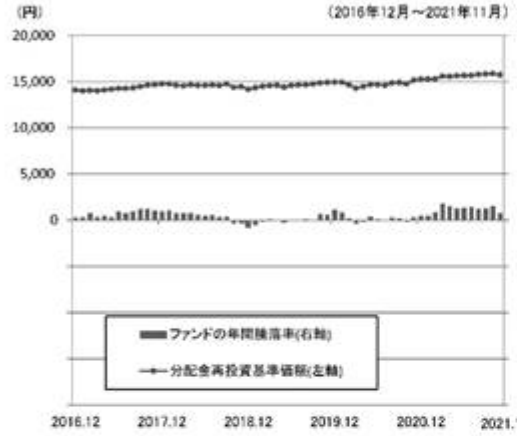
・　委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。

・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

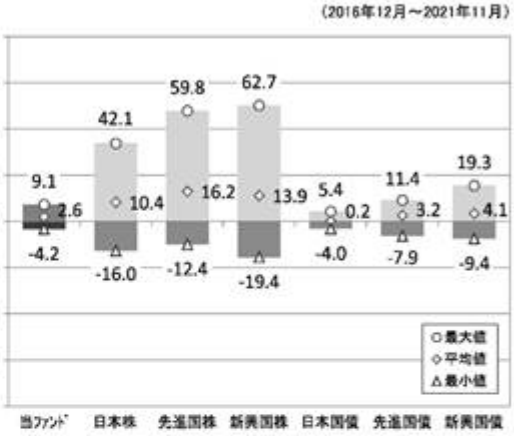
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.77%（税抜0.70%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.27%（税抜）	年率0.35%（税抜）	年率0.08%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）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。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2021年11月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2021年11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		1,029,155,730	99.71
	内 日本	1,029,155,730	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,022,178	0.29
純資産総額		1,032,177,908	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11月30日現在）

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	日本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	477,075,499	1.4183 676,675,606	1.4199 677,399,501	65.63
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	150,358,577	1.1805 177,503,945	1.3132 197,450,883	19.13
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	33,014,942	3.0163 99,584,481	3.1370 103,567,873	10.03
4	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,346,386	3.0351 37,473,702	4.1095 50,737,473	4.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.71%
合計	99.71%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第13計算期間末 (2012年11月30日)	501,136,922	501,136,922	1.0771	1.0771
第14計算期間末 (2013年12月2日)	638,027,220	638,027,220	1.2646	1.2646
第15計算期間末 (2014年12月1日)	744,594,681	744,594,681	1.3560	1.3560
第16計算期間末 (2015年11月30日)	875,628,369	875,628,369	1.3947	1.3947
第17計算期間末 (2016年11月30日)	915,556,581	915,556,581	1.3963	1.3963
第18計算期間末 (2017年11月30日)	973,218,082	973,218,082	1.4690	1.4690
第19計算期間末 (2018年11月30日)	971,801,470	971,801,470	1.4474	1.4474
第20計算期間末 (2019年12月2日)	1,002,408,072	1,002,408,072	1.4912	1.4912
第21計算期間末 (2020年11月30日)	1,019,086,041	1,019,086,041	1.5163	1.5163
2020年12月末日	1,013,624,959	－	1.5280	－
2021年1月末日	1,014,459,736	－	1.5269	－
2月末日	1,020,407,646	－	1.5284	－
3月末日	1,038,963,152	－	1.5601	－

4月末日	1,034,442,028	－	1.5558	－
5月末日	1,038,572,186	－	1.5628	－
6月末日	1,041,841,725	－	1.5677	－
7月末日	1,040,645,952	－	1.5672	－
8月末日	1,040,178,936	－	1.5769	－
9月末日	1,052,940,756	－	1.5835	－
10月末日	1,047,919,200	－	1.5859	－
第22計算期間末 (2021年11月30日)	1,032,177,908	1,032,177,908	1.5740	1.5740

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第13計算期間	5.7
第14計算期間	17.4
第15計算期間	7.2
第16計算期間	2.9
第17計算期間	0.1
第18計算期間	5.2
第19計算期間	△1.5
第20計算期間	3.0
第21計算期間	1.7
第22計算期間	3.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）

第13計算期間	80,200,699	30,963,750
第14計算期間	101,371,018	62,138,972
第15計算期間	86,587,089	41,997,530
第16計算期間	123,911,245	45,185,630
第17計算期間	91,543,767	63,659,698
第18計算期間	122,551,851	115,777,012
第19計算期間	76,475,000	67,569,021
第20計算期間	73,083,883	72,276,002
第21計算期間	84,740,001	84,860,395
第22計算期間	77,998,681	94,311,573

（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11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	177,548,758,040	97.20
内 日本	177,548,758,040	97.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,114,533,662	2.80
純資産総額	182,663,291,702	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）	5,536,320,000	3.03
内 日本	5,536,320,000	3.03

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

(注2) 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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	3,409,900	1,985.83 6,771,512,900	2,001.00 6,823,209,900	3.74
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	421,700	12,341.45 5,204,389,600	13,825.00 5,830,002,500	3.19
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	61,000	71,630.00 4,369,430,000	70,330.00 4,290,130,000	2.35
4	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	496,200	7,015.67 3,481,178,400	6,901.00 3,424,276,200	1.87
5	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	4,258,400	632.50 2,693,438,000	601.40 2,561,001,760	1.40
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	42,700	53,941.40 2,303,298,000	59,840.00 2,555,168,000	1.40
7	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	772,600	3,225.94 2,492,365,600	3,125.00 2,414,375,000	1.32
8	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	396,100	6,329.00 2,506,916,900	6,030.00 2,388,483,000	1.31
9	HOYA	日本	株式	精密機器	131,400	18,410.21 2,419,101,800	18,020.00 2,367,828,000	1.30
10	日本電産	日本	株式	電気機器	174,500	13,274.47 2,316,395,900	13,000.00 2,268,500,000	1.24
11	日 立	日本	株式	電気機器	323,800	6,443.57 2,086,430,600	6,688.00 2,165,574,400	1.19
12	信越化学	日本	株式	化学	113,200	21,150.00 2,394,180,000	19,000.00 2,150,800,000	1.18
13	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,800	26,672.59 2,288,508,600	23,150.00 1,986,270,000	1.09
14	任 天 堂	日本	株式	その他製品	38,000	52,660.00 2,001,080,000	50,100.00 1,903,800,000	1.04
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	459,700	3,928.20 1,805,795,900	3,703.00 1,702,269,100	0.93
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	497,900	3,538.11 1,761,629,200	3,391.00 1,688,378,900	0.92
17	村田製作所	日本	株式	電気機器	197,700	10,011.36 1,979,247,500	8,380.00 1,656,726,000	0.91
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	529,900	3,338.09 1,768,855,500	3,101.00 1,643,219,900	0.90

19	武田薬品	日本	株式	医薬品	529,200	3,759.00 1,989,262,800	3,031.00 1,604,005,200	0.88
20	KDDI	日本	株式	情報･通信業	481,600	3,786.00 1,823,337,600	3,300.00 1,589,280,000	0.87
21	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	1,000,600	1,552.78 1,553,721,600	1,562.50 1,563,437,500	0.86
22	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	465,300	3,453.51 1,606,922,700	3,260.00 1,516,878,000	0.83
23	第一三共	日本	株式	医薬品	529,200	3,019.43 1,597,885,500	2,824.50 1,494,725,400	0.82
24	SMC	日本	株式	機械	19,800	77,236.12 1,529,275,200	72,650.00 1,438,470,000	0.79
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	76,100	17,327.22 1,318,601,500	17,840.00 1,357,624,000	0.74
26	三井物産	日本	株式	卸売業	516,000	2,445.70 1,261,986,000	2,557.00 1,319,412,000	0.72
27	ファナック	日本	株式	電気機器	59,100	25,563.75 1,510,817,900	22,245.00 1,314,679,500	0.72
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	218,700	6,000.00 1,312,200,600	5,708.00 1,248,339,600	0.68
29	デンソー	日本	株式	輸送用機器	148,200	7,740.93 1,147,206,000	8,331.00 1,234,654,200	0.68
30	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	849,700	1,602.00 1,361,219,400	1,402.00 1,191,279,400	0.65

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.20%
合計	97.20%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.22%
建設業	2.12%
食料品	3.16%
繊維製品	0.45%

パルプ・紙	0.20%
化学	6.62%
医薬品	4.70%
石油・石炭製品	0.39%
ゴム製品	0.64%
ガラス・土石製品	0.77%
鉄鋼	0.69%
非鉄金属	0.67%
金属製品	0.62%
機械	5.23%
電気機器	19.27%
輸送用機器	7.85%
精密機器	2.94%
その他製品	2.12%
電気・ガス業	1.05%
陸運業	2.90%
海運業	0.42%
空運業	0.36%
倉庫・運輸関連業	0.16%
情報・通信業	8.38%
卸売業	4.98%
小売業	4.10%
銀行業	4.54%
証券、商品先物取引業	0.71%
保険業	1.86%
その他金融業	1.10%
不動産業	1.79%
サービス業	6.07%
合計	97.20%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率

株価指数先物取引	日本	ＴＯＰＩＸ先物　０３１２月	買建	292	5,890,975,350	5,536,320,000	3.03%

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2021年11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		85,097,080,600	89.50
	内 日本	85,097,080,600	89.50
地方債証券		3,514,853,500	3.70
	内 日本	3,514,853,500	3.70
特殊債券		2,703,089,900	2.84
	内 日本	2,703,089,900	2.84
社債券		2,976,109,700	3.13
	内 日本	2,976,109,700	3.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		788,477,271	0.83
純資産総額		95,079,610,971	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率(%)
1	135　5年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	100.54 1,558,463,000	100.29 1,554,526,000	0.100000 2023/03/20	1.63
2	138　5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.75 1,209,010,000	100.47 1,205,676,000	0.100000 2023/12/20	1.27

3	141 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.87 1,129,786,400	100.63 1,127,078,400	0.100000 2024/09/20	1.19
4	145 5年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.97 1,110,680,900	100.82 1,109,031,000	0.100000 2025/09/20	1.17
5	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.38 1,064,532,000	101.18 1,062,453,000	0.100000 2027/12/20	1.12
6	148 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.52 1,005,249,700	100.50 1,005,020,000	0.005000 2026/06/20	1.06
7	136 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.60 955,709,500	100.35 953,391,500	0.100000 2023/06/20	1.00
8	134 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.49 954,681,100	100.23 952,251,500	0.100000 2022/12/20	1.00
9	359 10年国債	日本	国債証券	930,000,000	100.85 937,962,440	101.11 940,360,200	0.100000 2030/06/20	0.99
10	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	102.60 923,436,000	101.85 916,695,000	0.600000 2024/06/20	0.96
11	345 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	101.16 910,499,300	101.01 909,135,000	0.100000 2026/12/20	0.96
12	360 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.62 905,654,300	101.01 909,117,000	0.100000 2030/09/20	0.96
13	139 5年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.78 907,109,500	100.53 904,770,000	0.100000 2024/03/20	0.95
14	144 5年国債	日本	国債証券	890,000,000	100.97 898,635,100	100.78 896,977,600	0.100000 2025/06/20	0.94
15	342 10年国債	日本	国債証券	880,000,000	101.06 889,357,000	100.90 887,981,600	0.100000 2026/03/20	0.93
16	142 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.88 857,493,700	100.68 855,856,500	0.100000 2024/12/20	0.90
17	147 5年国債	日本	国債証券	840,000,000	100.49 844,129,840	100.47 843,981,600	0.005000 2026/03/20	0.89
18	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.36 810,936,000	101.21 809,744,000	0.100000 2028/06/20	0.85
19	137 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.66 805,293,600	100.42 803,392,000	0.100000 2023/09/20	0.84
20	346 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.24 789,739,600	101.06 788,307,000	0.100000 2027/03/20	0.83
21	344 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.16 789,102,600	100.96 787,527,000	0.100000 2026/09/20	0.83
22	343 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.08 788,437,800	100.96 787,488,000	0.100000 2026/06/20	0.83

23	340 10年国債	日本	国債証券	760,000,000	102.46 778,711,200	101.98 775,093,600	0.400000 2025/09/20	0.82
24	362 10年国債	日本	国債証券	710,000,000	100.22 711,604,520	100.74 715,268,200	0.100000 2031/03/20	0.75
25	333 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	102.43 717,045,000	101.67 711,697,000	0.600000 2024/03/20	0.75
26	352 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.27 708,930,200	101.26 708,855,000	0.100000 2028/09/20	0.75
27	143 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.98 706,878,000	100.74 705,215,000	0.100000 2025/03/20	0.74
28	140 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.85 705,968,000	100.57 704,025,000	0.100000 2024/06/20	0.74
29	363 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.72 705,058,800	100.57 703,990,000	0.100000 2031/06/20	0.74
30	335 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	102.40 706,608,300	101.75 702,123,300	0.500000 2024/09/20	0.74

(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	89.50%
地方債証券	3.70%
特殊債券	2.84%
社債券	3.13%
合計	99.17%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2021年11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		229,141,995,703	91.37
	内 香港	2,019,819,006	0.81
	内 シンガポール	746,104,406	0.30
	内 イスラエル	469,391,562	0.19
	内 ノルウェー	470,097,377	0.19
	内 スウェーデン	2,677,537,778	1.07
	内 デンマーク	1,959,025,386	0.78
	内 イギリス	9,729,339,111	3.88
	内 アイルランド	449,002,965	0.18
	内 オランダ	3,364,990,639	1.34
	内 ベルギー	593,517,776	0.24
	内 フランス	7,642,465,645	3.05
	内 ドイツ	5,954,384,514	2.37
	内 スイス	6,862,594,012	2.74
	内 ポルトガル	133,039,143	0.05
	内 スペイン	1,527,490,004	0.61
	内 イタリア	1,654,205,960	0.66
	内 フィンランド	682,716,253	0.27
	内 オーストリア	143,240,392	0.06
	内 カナダ	8,006,114,675	3.19
	内 アメリカ	169,868,567,833	67.74
	内 オーストラリア	4,018,864,747	1.60
	内 ニュージーランド	169,486,519	0.07
投資証券		5,638,901,536	2.25
	内 香港	91,958,582	0.04
	内 シンガポール	96,607,210	0.04
	内 イギリス	142,764,491	0.06
	内 フランス	93,942,606	0.04
	内 カナダ	26,584,306	0.01
	内 アメリカ	4,673,546,263	1.86
	内 オーストラリア	492,115,558	0.20
	内 その他	21,382,520	0.01

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,996,314,124	6.38
純資産総額	250,777,211,363	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）		16,312,448,690	6.50
	内 イギリス	722,494,098	0.29
	内 ドイツ	2,658,197,441	1.06
	内 カナダ	683,428,116	0.27
	内 アメリカ	11,720,545,581	4.67
	内 オーストラリア	527,783,454	0.21
為替予約取引（買建）		9,748,917,290	3.89
	内 日本	9,748,917,290	3.89

(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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	605,600	13,434.07 8,135,698,275	18,230.50 11,040,393,707	4.40
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	259,600	25,009.14 6,492,383,120	38,298.39 9,942,263,368	3.96
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	16,470	367,119.97 6,046,467,316	405,199.81 6,673,641,017	2.66
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	29,620	68,843.59 2,039,149,848	129,355.35 3,831,505,535	1.53

5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	10,900	210,512.84 2,294,590,837	331,140.09 3,609,427,087	1.44
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	10,557	209,309.83 2,209,684,222	332,467.79 3,509,862,518	1.40
7	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	90,380	15,633.70 1,412,976,618	37,971.87 3,431,898,081	1.37
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	86,900	32,153.10 2,794,112,699	38,457.67 3,341,971,792	1.33
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	109,770	14,160.38 1,554,390,748	18,343.13 2,013,526,159	0.80
10	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	38,550	31,706.56 1,222,291,408	46,283.91 1,784,244,784	0.71
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	34,216	39,028.00 1,335,385,221	51,424.04 1,759,524,953	0.70
12	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	95,500	16,641.02 1,589,225,256	18,174.75 1,735,689,341	0.69
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	48,850	26,702.72 1,304,429,651	32,096.79 1,567,928,309	0.63
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	102,700	12,680.45 1,302,293,066	14,802.32 1,520,198,778	0.61
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	88,667	15,730.29 1,394,761,366	16,954.00 1,503,260,797	0.60
16	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	279,401	3,404.22 951,163,389	5,186.77 1,449,189,926	0.58
17	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	61,250	24,192.16 1,481,776,773	22,331.91 1,367,829,690	0.55
18	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	15,010	49,159.84 737,890,041	90,503.36 1,358,455,554	0.54
19	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	17,320	55,040.78 953,307,341	78,215.73 1,354,696,570	0.54

20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	16,070	56,462.57 907,354,136	75,525.07 1,213,687,984	0.48
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	203,113	4,261.02 865,470,574	5,961.54 1,210,867,899	0.48
22	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	35,216	27,926.09 983,447,265	33,760.10 1,188,896,027	0.47
23	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	32,050	38,878.39 1,246,053,979	36,748.84 1,177,800,569	0.47
24	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	65,862	17,161.86 1,130,314,741	16,816.34 1,107,558,029	0.44
25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	25,000	37,553.78 938,846,945	44,061.87 1,101,546,875	0.44
26	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	153,605	4,766.39 732,158,638	7,007.09 1,076,324,720	0.43
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	14,240	52,009.50 740,616,783	73,810.56 1,051,062,416	0.42
28	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	16,060	44,226.03 710,271,434	63,128.69 1,013,846,883	0.40
29	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	166,090	5,946.53 987,662,456	5,862.56 973,713,936	0.39
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	152,950	4,966.28 759,596,554	6,343.81 970,286,535	0.39

(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	91.37%
投資証券	2.25%
合計	93.62%

(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	3.06%

素材	3.77%
資本財・サービス	8.62%
一般消費財・サービス	11.35%
生活必需品	6.33%
ヘルスケア	11.64%
金融	12.62%
情報技術	22.96%
コミュニケーション・サービス	8.06%
公益事業	2.61%
不動産	0.35%
合計	91.37%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI FUT 202112	買建	443	11,321,468,692	11,720,545,581	4.67%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202112	買建	67	719,861,387	722,494,098	0.29%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202112	買建	36	538,055,421	527,783,454	0.21%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202112	買建	30	664,563,818	683,428,116	0.27%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202112	買建	42	622,790,939	633,551,835	0.25%
		EURO STOXX 50 202112	買建	384	2,048,077,093	2,024,645,606	0.81%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2021年12月	買建	1,990,000	308,287,051	301,604,400	0.12%
		米ドル買/円売 2021年12月	買建	61,780,000	7,046,626,660	7,027,555,314	2.80%
		スイス・フラン買/円売 2021年12月	買建	3,570,000	443,805,440	440,052,480	0.18%
		ユーロ買/円売 2021年12月	買建	9,940,000	1,304,068,477	1,276,557,422	0.51%

		豪ドル買/円売 2021年12月	買建	3,380,000	286,703,319	274,744,314	0.11%
		カナダ・ドル買/円売 2021年12月	買建	4,800,000	439,283,847	428,403,360	0.17%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2021年11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		230,341,773,379	98.59
	内 ユーロ	90,406,985,121	38.70
	内 中国	482,437,093	0.21
	内 シンガポール	962,856,749	0.41
	内 マレーシア	1,064,579,152	0.46
	内 イスラエル	1,101,379,217	0.47
	内 ノルウェー	535,815,360	0.23
	内 スウェーデン	653,106,093	0.28
	内 デンマーク	1,093,665,528	0.47
	内 イギリス	14,166,718,339	6.06
	内 ポーランド	1,108,694,362	0.47
	内 カナダ	4,512,686,869	1.93
	内 アメリカ	108,759,849,422	46.55
	内 メキシコ	1,505,707,605	0.64
	内 オーストラリア	3,987,292,469	1.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,290,341,223	1.41
純資産総額		233,632,114,602	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）	1,706,004,527	0.73

	内 日本	1,706,004,527	0.73

(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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	95.68 1,164,779,180	96.91 1,179,723,224	1.125000 2031/02/15	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	99.33 1,107,549,806	94.91 1,058,273,294	0.875000 2030/11/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,000,000	98.10 1,116,095,077	93.01 1,058,186,147	0.625000 2030/08/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	98.28 1,039,884,450	97.59 1,032,635,794	1.250000 2031/08/15	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.99 1,009,498,826	101.16 1,001,280,668	1.625000 2031/05/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	105.20 925,086,040	102.16 898,356,995	1.625000 2026/05/15	0.38
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,700,000	99.74 873,815,630	99.52 871,885,382	0.250000 2023/11/15	0.37
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,699,000	122.83 898,925,986	118.93 870,339,956	2.750000 2027/10/25	0.37
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.56 849,541,921	98.95 844,375,341	0.375000 2024/09/15	0.36
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	116.60 888,801,616	109.49 834,612,624	2.875000 2028/08/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.60 849,938,694	97.44 831,439,692	0.250000 2025/06/30	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	98.33 872,630,690	93.24 827,435,102	0.625000 2030/05/15	0.35
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,664,000	189.40 891,159,719	175.35 825,044,584	4.500000 2041/04/25	0.35

14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	115.31 865,857,051	108.20 812,476,850	2.625000 2029/02/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	116.28 859,962,969	109.25 807,909,212	2.875000 2028/05/15	0.35
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,900,000	100.16 786,288,154	102.65 805,862,945	2.000000 2051/08/15	0.34
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	128.09 836,744,298	122.73 801,757,745	2.500000 2030/05/25	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,420,000	119.01 828,336,056	114.59 797,553,842	1.500000 2031/05/25	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.27 790,621,422	99.37 791,412,562	1.250000 2028/03/31	0.34
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	98.66 785,770,147	98.95 788,051,796	1.250000 2028/09/30	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	114.92 830,290,059	108.34 782,712,627	2.750000 2028/02/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,100,000	108.16 750,666,454	111.27 772,231,281	2.375000 2051/05/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	111.71 813,391,788	105.91 771,189,489	2.375000 2027/05/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,668,000	102.86 780,337,603	101.36 768,958,328	1.625000 2022/11/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.94 772,022,776	96.50 768,516,350	0.750000 2028/01/31	0.33
26	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,571,000	173.86 797,270,797	165.72 759,935,484	4.000000 2037/01/04	0.33
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	101.88 749,673,644	101.14 744,206,729	— 2023/04/14	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	107.84 756,034,149	104.36 731,637,583	2.375000 2024/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	103.67 741,586,846	101.78 728,039,595	2.000000 2022/11/30	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,800,000	97.71 755,948,993	93.96 726,908,385	1.625000 2050/11/15	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	98.59%
合計	98.59%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2022年1月	買建	441,000	66,758,721	66,834,123	0.03%
		米ドル買/円売 2021年12月	買建	2,771,000	315,253,899	315,249,188	0.13%
		デンマーク・クローネ買/円売 2021年12月	買建	3,029,000	53,986,987	52,312,950	0.02%
		米ドル買/円売 2022年1月	買建	3,878,000	440,553,720	440,847,549	0.19%
		ユーロ買/円売 2021年12月	買建	4,757,000	614,074,844	610,863,913	0.26%
		ユーロ買/円売 2022年1月	買建	1,000,000	128,502,900	128,493,100	0.05%
		カナダ・ドル買/円売 2021年12月	買建	672,000	61,806,931	59,980,905	0.03%
		シンガポール・ドル買/円売 2022年1月	買建	378,000	31,361,148	31,422,799	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワライフスタイル25

2021年11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	15,740円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.8%
3カ月間	-0.2%
6カ月間	0.7%
1年間	3.8%
3年間	8.7%
5年間	12.7%
設定来	57.4%

※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11期 10年11月	第12期 11年11月	第13期 12年11月	第14期 13年12月	第15期 14年12月	第16期 15年11月	第17期 16年11月	第18期 17年11月	第19期 18年11月	第20期 19年12月	第21期 20年11月	第22期 21年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	344	65.1%
国内株式・先物	2,124	19.2%
外国債券	846	9.9%
外国株式・先物	1,226	4.8%
外国リート	57	0.1%
外国投資証券	6	0.0%
コール・ローン、その他		1.8%
合計	4,603	-

通貨別構成	比率
日本円	85.0%
米ドル	8.4%
ユーロ	4.4%
英ポンド	0.8%
カナダ・ドル	0.4%
豪ドル	0.3%
スイス・フラン	0.1%
デンマーク・クローネ	0.1%
スウェーデン・クローネ	0.1%
その他	0.4%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	0.9
最終利回り(%)	0.2
修正デュレーション	9.2
残存年数	10.1

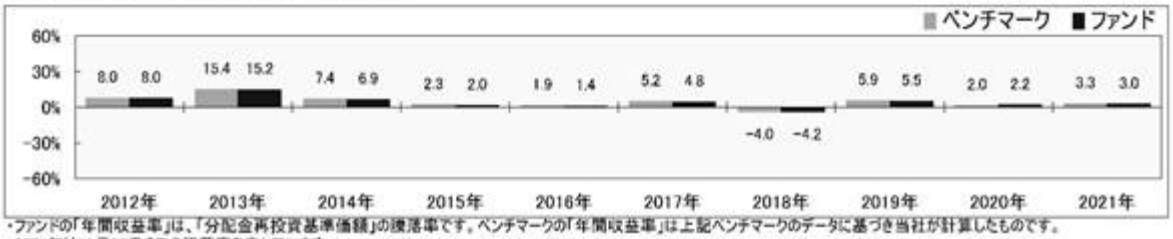
債券格付別構成	比率
AAA	90.6%
AA	4.7%
A	3.2%
BBB	-
BB以下・無格付	1.5%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	0.7%
ソニーグループ	日本	0.6%
TOPIX先物 0312月	日本	0.6%
キーエンス	日本	0.4%
リクルートホールディングス	日本	0.4%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
東京エレクトロン	日本	0.3%
日本電信電話	日本	0.3%
ソフトバンクグループ	日本	0.3%
HOYA	日本	0.2%
合計		4.0%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.5%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2021年は11月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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

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

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

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

② 信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワライフスタイル２５

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2020年11月30日現在	第22期 2021年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,939,140	7,509,815
親投資信託受益証券	1,016,129,441	1,029,155,730
未収入金	281,000	173,000
流動資産合計	1,023,349,581	1,036,838,545
資産合計	1,023,349,581	1,036,838,545
負債の部		
流動負債		
未払解約金	455,721	587,795
未払受託者報酬	430,531	460,509
未払委託者報酬	3,337,011	3,569,247
その他未払費用	40,277	43,086
流動負債合計	4,263,540	4,660,637
負債合計	4,263,540	4,660,637
純資産の部		
元本等		
元本	※1 672,077,735	※1 655,764,843
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	347,008,306	376,413,065
（分配準備積立金）	142,793,758	158,244,099
元本等合計	1,019,086,041	1,032,177,908
純資産合計	1,019,086,041	1,032,177,908
負債純資産合計	1,023,349,581	1,036,838,545

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30日	第22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
営業収益		
受取利息	17	－
有価証券売買等損益	23,643,839	46,439,289
営業収益合計	23,643,856	46,439,289
営業費用		
支払利息	1,709	1,181
受託者報酬	858,706	911,192
委託者報酬	6,655,694	7,062,345
その他費用	80,368	85,244
営業費用合計	7,596,477	8,059,962
営業利益	16,047,379	38,379,327
経常利益	16,047,379	38,379,327
当期純利益	16,047,379	38,379,327
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（△）	△ 1,865,473	3,994,095
期首剰余金又は期首欠損金（△）	330,209,943	347,008,306
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,501,136	43,903,753
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,501,136	43,903,753
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,615,625	48,884,226
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,615,625	48,884,226
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	347,008,306	376,413,065

(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22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30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21期 2020年11月30日現在	第22期 2021年11月30日現在
1.　※1　期首元本額	672,198,129円	672,077,735円
期中追加設定元本額	84,740,001円	77,998,681円
期中一部解約元本額	84,860,395円	94,311,573円
2.　計算期間末日における受益権の総数	672,077,735口	655,764,843口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第21期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30日	第22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（17,912,173円）、投資信託約款に規定される収益調整金（231,332,698円）及び分配準備積立金（124,881,585円）より分配対象額は374,126,456円（1万口当たり5,566.71円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（34,384,945円）、投資信託約款に規定される収益調整金（241,186,519円）及び分配準備積立金（123,859,154円）より分配対象額は399,430,618円（1万口当たり6,091.06円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第22期 2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第21期 2020年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第22期 2021年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	23,475,640	37,917,996
合計	23,475,640	37,917,996

（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21期 2020年11月30日現在	第22期 2021年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第21期 2020年11月30日現在	第22期 2021年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5163円 (15,163円)	1.5740円 (15,740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	150,358,577	197,450,883	
	日本債券インデックスマザーファンド	477,075,499	677,399,501	
	外国株式インデックスマザーファンド	12,346,386	50,737,473	
	外国債券インデックスマザーファンド	33,014,942	103,567,873	
親投資信託受益証券　合計			1,029,155,730	
合計			1,029,155,730	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		

流動資産			
コール・ローン		12,212,008,294	8,845,838,998
株式	※2※3	163,479,342,460	177,548,758,040
派生商品評価勘定		89,140,900	－
未収配当金		1,010,955,223	1,233,193,430
未収利息		814,653	551,974
前払金		－	211,095,600
その他未収収益	※4	33,720,594	21,961,225
差入委託証拠金		－	18,795,000
流動資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267
資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		23,231,250	355,476,200
前受金		102,752,600	－
未払解約金		189,585,900	44,822,370
受入担保金		9,568,784,085	4,816,603,995
流動負債合計		9,884,353,835	5,216,902,565
負債合計		9,884,353,835	5,216,902,565
純資産の部			
元本等			
元本	※1	142,709,508,970	139,094,932,448
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		24,232,119,319	43,568,359,254
元本等合計		166,941,628,289	182,663,291,702
純資産合計		166,941,628,289	182,663,291,702
負債純資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1．※1　期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	147,704,616,967円	142,709,508,970円
期中追加設定元本額	28,551,522,466円	20,968,397,493円
期中一部解約元本額	33,546,630,463円	24,582,974,015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	3,193,110,083円	2,975,507,036円

ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	6,674,458,363円	5,686,561,941円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	930,834円	924,307円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	32,952,471円	24,862,174円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	668,546,231円	418,851,032円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	35,731,278円	21,795,176円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	908,394,726円	711,622,184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）	126,217,518円	242,143,159円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	38,327,788円	48,516,772円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	10,549,517円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	23,213,652円	150,899,876円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	2,041,017,760円	4,912,109,453円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,619,294,575円	3,289,496,110円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	125,857,474円	524,441,173円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	64,944,239,094円	66,361,817,159円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,972,314,135円	2,933,677,304円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,751,798,888円	4,117,458,139円
ダイワ・ライフ・バランス７０	3,333,100,735円	4,042,208,265円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,191,048,366円	6,020,854,667円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	11,676,676円	－円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	46,996,347円	53,651,007円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	34,721,962円	58,568,334円
ダイワつみたてインデックス日本株式	817,787,252円	1,539,852,892円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	10,918,252円	10,210,048円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	7,976,371円	9,943,370円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	11,268,546円	19,590,190円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	－円	721,071円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	141,666,674円	108,723,511円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	149,563,586円	125,845,796円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,748,159,579円	5,927,962,438円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	659,469,668円	524,674,963円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	99,902,437円	75,481,125円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	178,714,272円	141,439,467円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	149,232,217円	200,182,570円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	10,242,225,102円	10,416,484,453円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	9,426,768,765円	1,750,254,771円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,261,893,318円	2,681,477,325円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,247,128,871円	1,175,509,780円
ダイワライフスタイル２５	180,844,569円	150,358,577円
ダイワライフスタイル５０	655,627,347円	597,518,476円

	ダイワライフスタイル７５	519,251,046円	479,645,847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）	11,416,612,625円	10,563,090,510円
	計	142,709,508,970円	139,094,932,448円
2.	期末日における受益権の総数	142,709,508,970口	139,094,932,448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　9,033,368,760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　4,435,964,100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　740,845,000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　952,550,000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32,214,780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21,209,315円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2020年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	9,890,799,472	△12,356,661,736
合計	9,890,799,472	△12,356,661,736

（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（2020年9月24日から2020年11月30日まで、及び2021年9月22日から2021年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

	2020年11月30日 現在	2021年11月30日 現在

種 類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	2,900,792,400	－	2,966,795,000	66,002,600	5,891,635,600	－	5,536,320,000	△355,315,600
合計	2,900,792,400	－	2,966,795,000	66,002,600	5,891,635,600	－	5,536,320,000	△355,315,600

（注） 1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1698円	1.3132円
（1万口当たり純資産額）	(11,698円)	(13,132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	3,200	2,900.00	9,280,000	貸付株式数 400株
日本水産	91,400	573.00	52,372,200	
マルハニチロ	14,300	2,277.00	32,561,100	
ホウスイ	600	879.00	527,400	貸付株式数 100株
カネコ種苗	2,800	1,348.00	3,774,400	
サカタのタネ	10,900	3,125.00	34,062,500	
ホクト	7,900	1,842.00	14,551,800	
ホクリヨウ	1,500	677.00	1,015,500	

ヒノキヤグループ	2,300	2,118.00	4,871,400		
ショーボンドＨＤ	13,200	4,885.00	64,482,000	貸付株式数	3,200株
ミライト・ホールディングス	29,400	1,965.00	57,771,000	貸付株式数	3,400株
タマホーム	5,900	2,290.00	13,511,000	貸付株式数	2,200株
サンヨーホームズ	1,500	713.00	1,069,500	貸付株式数	300株
日本アクア	4,400	672.00	2,956,800		
ファーストコーポレーション	2,500	689.00	1,722,500	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,900	1,276.00	2,424,400	貸付株式数	700株
キャンディル	1,700	494.00	839,800	貸付株式数	600株
スペースバリューＨＤ	9,600	1,146.00	11,001,600		
住石ホールディングス	21,600	126.00	2,721,600	貸付株式数	6,400株
日鉄鉱業	2,300	6,160.00	14,168,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,600	1,293.00	4,654,800	貸付株式数	1,400株
ＩＮＰＥＸ	367,200	937.00	344,066,400		
石油資源開発	10,700	2,291.00	24,513,700	貸付株式数	1,800株
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,400	1,502.00	6,608,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,658.00	2,984,400		
第一カッター興業	2,300	1,269.00	2,918,700		
明豊ファシリティワークス	2,900	841.00	2,438,900	貸付株式数	1,100株
安藤・間	50,300	841.00	42,302,300	貸付株式数	20,000株
東急建設	29,000	645.00	18,705,000		
コムシスホールディングス	29,500	2,476.00	73,042,000		
ビーアールホールディングス	12,700	353.00	4,483,100	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクショングループ	5,700	1,869.00	10,653,300	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	8,950.00	25,060,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,000	984.00	984,000	貸付株式数	100株
ヤマウラ	4,400	924.00	4,065,600	貸付株式数	1,600株
オリエンタル白石	32,300	227.00	7,332,100		
大成建設	61,000	3,310.00	201,910,000		
大　林　組	211,100	836.00	176,479,600		
清水建設	197,800	717.00	141,822,600		
飛島建設	5,500	977.00	5,373,500	貸付株式数	600株
長谷工コーポレーシヨン	62,700	1,354.00	84,895,800		
松井建設	8,400	703.00	5,905,200		
錢　高　組	900	3,765.00	3,388,500		

鹿島建設	154,700	1,251.00	193,529,700		
不動テトラ	4,400	1,612.00	7,092,800		
大末建設	2,200	1,118.00	2,459,600	貸付株式数	600株
鉄建建設	4,500	1,717.00	7,726,500		
西松建設	12,800	3,385.00	43,328,000		
三井住友建設	47,600	414.00	19,706,400	貸付株式数	5,100株
大豊建設	3,100	3,620.00	11,222,000	貸付株式数	1,800株
佐田建設	4,600	478.00	2,198,800	貸付株式数	500株
ナカノフドー建設	5,000	333.00	1,665,000		
奥　村　組	12,400	3,140.00	38,936,000		
東鉄工業	9,800	2,273.00	22,275,400	貸付株式数	3,400株
イチケン	1,500	1,810.00	2,715,000		
富士ピー・エス	2,900	495.00	1,435,500	貸付株式数	700株
淺沼組	2,400	5,260.00	12,624,000	貸付株式数	200株
戸田建設	87,300	668.00	58,316,400		
熊　谷　組	10,700	2,628.00	28,119,600		
北野建設	1,200	2,050.00	2,460,000		
植　木　組	1,700	1,361.00	2,313,700	貸付株式数	700株
矢作建設	9,300	691.00	6,426,300		
ピーエス三菱	6,900	593.00	4,091,700	貸付株式数	1,000株
日本ハウスＨＬＤＧＳ	14,700	347.00	5,100,900	貸付株式数	5,600株
大東建託	21,600	12,290.00	265,464,000		
新日本建設	8,900	745.00	6,630,500		
ＮＩＰＰＯ	17,700	4,010.00	70,977,000		
東亜道路	1,100	4,650.00	5,115,000	貸付株式数	300株
日本道路	2,000	7,800.00	15,600,000		
東亜建設	5,100	2,379.00	12,132,900	貸付株式数	2,600株
日本国土開発	20,300	532.00	10,799,600		
若築建設	3,500	1,900.00	6,650,000		
東洋建設	24,200	524.00	12,680,800		
五洋建設	83,700	651.00	54,488,700	貸付株式数	8,900株
世紀東急	10,200	824.00	8,404,800		
福　田　組	2,400	4,110.00	9,864,000	貸付株式数	800株
日本ドライケミカル	1,600	1,772.00	2,835,200	貸付株式数	200株
住友林業	54,400	2,287.00	124,412,800		
日本基礎技術	5,800	551.00	3,195,800		
巴コーポレーション	9,000	432.00	3,888,000		
大和ハウス	194,900	3,316.00	646,288,400		
ライト工業	13,300	2,025.00	26,932,500		
積水ハウス	228,800	2,210.00	505,648,000		

日特建設	4,300	641.00	2,756,300	貸付株式数	1,300株
北陸電気工事	3,800	1,051.00	3,993,800		
ユアテック	12,100	601.00	7,272,100		
日本リーテック	4,500	1,393.00	6,268,500	貸付株式数	500株
四電工	2,400	1,627.00	3,904,800		
中電工	10,100	2,027.00	20,472,700		
関　電　工	34,900	810.00	28,269,000		
きんでん	47,100	1,643.00	77,385,300		
東京エネシス	6,700	1,032.00	6,914,400		
トーエネック	2,100	3,120.00	6,552,000		
住友電設	5,200	1,926.00	10,015,200	貸付株式数	1,200株
日本電設工業	11,600	1,549.00	17,968,400	貸付株式数	400株
エクシオグループ	32,300	2,406.00	77,713,800		
新日本空調	5,700	2,093.00	11,930,100	貸付株式数	1,400株
日本工営	3,800	3,170.00	12,046,000		
九電工	16,300	3,360.00	54,768,000		
三機工業	13,600	1,373.00	18,672,800	貸付株式数	1,900株
日揮ホールディングス	64,700	957.00	61,917,900		
中外炉工業	2,000	1,552.00	3,104,000	貸付株式数	200株
ヤマト	6,200	738.00	4,575,600		
太平電業	4,900	2,706.00	13,259,400		
高砂熱学	19,100	1,908.00	36,442,800		
三晃金属	900	2,300.00	2,070,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	22,300	1,809.00	40,340,700		
朝日工業社	1,300	2,809.00	3,651,700	貸付株式数	200株
明星工業	13,600	652.00	8,867,200		
大　氣　社	10,200	2,900.00	29,580,000	貸付株式数	2,200株
ダイダン	4,700	2,050.00	9,635,000		
日比谷総合設備	7,000	1,864.00	13,048,000	貸付株式数	400株
ニップン	19,800	1,567.00	31,026,600		
日清製粉Ｇ本社	76,400	1,636.00	124,990,400		
日東富士製粉	1,000	3,455.00	3,455,000		
昭和産業	6,400	2,617.00	16,748,800		
鳥越製粉	6,400	710.00	4,544,000	貸付株式数	2,400株
中部飼料	7,800	944.00	7,363,200	貸付株式数	3,100株
フィード・ワン	9,300	714.00	6,640,200		
東洋精糖	1,300	1,127.00	1,465,100		
日本甜菜糖	3,500	1,595.00	5,582,500		
ＤＭ三井製糖ホールディ	6,100	1,862.00	11,358,200	貸付株式数	400株
塩水港精糖	10,300	213.00	2,193,900	貸付株式数	900株

日新製糖	3,300	1,629.00	5,375,700		
ＬＩＦＵＬＬ	22,500	258.00	5,805,000	貸付株式数	7,600株
ミクシィ	14,800	2,021.00	29,910,800	貸付株式数	6,600株
ジェイエイシーリクルートメント	5,500	1,988.00	10,934,000	貸付株式数	500株
日本M&Aセンターホールデ	105,500	3,335.00	351,842,500		
メンバーズ	2,000	2,333.00	4,666,000	貸付株式数	700株
中広	1,100	386.00	424,600	貸付株式数	400株
ＵＴグループ	9,400	4,050.00	38,070,000	貸付株式数	2,900株
アイティメディア	3,100	2,006.00	6,218,600	貸付株式数	200株
Ｅ・Ｊホールディングス	3,300	1,179.00	3,890,700	貸付株式数	1,300株
夢真ビーネックスグループ	17,600	1,666.00	29,321,600		
コシダカホールディングス	18,600	598.00	11,122,800	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,300	825.00	1,072,500		
パソナグループ	7,300	3,545.00	25,878,500		
ＣＤＳ	1,500	1,638.00	2,457,000		
リンクアンドモチベーション	14,500	707.00	10,251,500	貸付株式数	5,600株
エス・エム・エス	22,200	4,235.00	94,017,000		
サニーサイドアップG	2,100	730.00	1,533,000	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,200	3,280.00	210,576,000		
リニカル	3,400	851.00	2,893,400	貸付株式数	1,400株
クックパッド	21,700	256.00	5,555,200	貸付株式数	7,800株
エスクリ	3,100	412.00	1,277,200	貸付株式数	700株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	3,400	608.00	2,067,200	貸付株式数	1,200株
森永製菓	15,900	3,530.00	56,127,000		
中　村　屋	1,600	3,605.00	5,768,000		
江崎グリコ	18,600	3,505.00	65,193,000		
名糖産業	3,000	1,650.00	4,950,000	貸付株式数	400株
井村屋グループ	3,800	2,162.00	8,215,600		
不　二　家	4,100	2,232.00	9,151,200	貸付株式数	1,600株
山崎製パン	50,700	1,475.00	74,782,500		
第一屋製パン	1,300	529.00	687,700	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,290.00	5,819,000		
亀田製菓	3,800	4,325.00	16,435,000		
寿スピリッツ	6,600	6,160.00	40,656,000	貸付株式数	1,400株
カルビー	30,800	2,548.00	78,478,400	貸付株式数	4,700株
森永乳業	12,600	5,440.00	68,544,000		

六甲バター	5,000	1,528.00	7,640,000	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	50,100	5,670.00	284,067,000		
明治ホールディングス	44,700	6,660.00	297,702,000		
雪印メグミルク	16,300	1,920.00	31,296,000	貸付株式数	100株
プリマハム	8,500	2,371.00	20,153,500	貸付株式数	2,700株
日本ハム	25,900	3,870.00	100,233,000		
林兼産業	2,200	531.00	1,168,200		
丸大食品	6,600	1,433.00	9,457,800		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,100	3,285.00	20,038,500	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,300	2,590.00	5,957,000	貸付株式数	900株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	43,800	642.00	28,119,600	貸付株式数	1,400株
学情	2,800	1,079.00	3,021,200	貸付株式数	200株
スタジオアリス	3,000	2,022.00	6,066,000	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,700	1,482.00	2,519,400	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,600	1,546.00	5,565,600		
エプコ	1,500	809.00	1,213,500	貸付株式数	500株
システナ	96,000	472.00	45,312,000		
ＮＪＳ	1,300	1,943.00	2,525,900		
デジタルアーツ	3,500	9,430.00	33,005,000	貸付株式数	500株
日鉄ソリューションズ	9,700	3,440.00	33,368,000		
綜合警備保障	25,500	4,840.00	123,420,000		
キューブシステム	3,100	898.00	2,783,800		
いちご	74,300	284.00	21,101,200	貸付株式数	4,800株
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	900	1,396.00	1,256,400	貸付株式数	300株
日本駐車場開発	73,500	136.00	9,996,000		
コア	2,600	1,530.00	3,978,000		
カカクコム	47,800	3,175.00	151,765,000		
アイロムグループ	2,400	1,709.00	4,101,600	貸付株式数	100株
セントケア・ホールディング	4,300	744.00	3,199,200	貸付株式数	800株
サイネックス	1,300	625.00	812,500	貸付株式数	200株
ルネサンス	4,700	1,129.00	5,306,300	貸付株式数	1,500株
ディップ	11,400	3,980.00	45,372,000	貸付株式数	4,500株
ＳＢＳホールディングス	5,400	3,465.00	18,711,000		
デジタルホールディングス	4,900	1,390.00	6,811,000	貸付株式数	1,100株
新日本科学	8,100	1,615.00	13,081,500		
キャリアデザインセンター	1,600	965.00	1,544,000		
ベネフィット・ワン	23,500	5,320.00	125,020,000		
エムスリー	113,600	6,119.00	695,118,400		

ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,900	283.00	1,386,700	貸付株式数	1,600株
ブラス	1,400	642.00	898,800	貸付株式数	300株
アウトソーシング	37,400	1,504.00	56,249,600	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	449.00	2,828,700	貸付株式数	1,900株
ワールドホールディングス	2,600	2,529.00	6,575,400		
ディー・エヌ・エー	24,600	1,680.00	41,328,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	89,300	1,693.00	151,184,900		
ぐるなび	10,700	469.00	5,018,300	貸付株式数	900株
タカミヤ	7,500	430.00	3,225,000		
ジャパンベストレスキューＳ	5,000	955.00	4,775,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	404.00	6,625,600	貸付株式数	6,300株
ライク	1,900	1,645.00	3,125,500		
ビジネス・ブレークスルー	2,600	412.00	1,071,200	貸付株式数	1,000株
エスプール	19,100	1,275.00	24,352,500		
ＷＤＢホールディングス	2,900	3,125.00	9,062,500	貸付株式数	800株
手間いらず	1,000	5,160.00	5,160,000	貸付株式数	300株
ティア	4,200	434.00	1,822,800		
ＣＤＧ	500	1,390.00	695,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	5,300	4,520.00	23,956,000		
インフォマート	71,500	1,026.00	73,359,000		
サッポロホールディングス	23,000	2,180.00	50,140,000		
アサヒグループホールディン	159,000	4,194.00	666,846,000		
キリンＨＤ	248,500	1,817.00	451,524,500		
宝ホールディングス	46,000	1,220.00	56,120,000		
オエノンホールディングス	19,900	356.00	7,084,400	貸付株式数	7,700株
養　命　酒	2,100	1,770.00	3,717,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	47,400	1,265.00	59,961,000		
サントリー食品インター	45,200	4,005.00	181,026,000		
ダイドーグループＨＤ	3,500	4,910.00	17,185,000	貸付株式数	1,500株
伊　藤　園	20,500	6,670.00	136,735,000	貸付株式数	500株
キーコーヒー	6,900	1,941.00	13,392,900		
ユニカフェ	2,000	1,012.00	2,024,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	900	1,214.00	1,092,600	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,500	2,778.00	23,613,000		
不二製油グループ	14,600	2,236.00	32,645,600	貸付株式数	3,200株

かどや製油	800	4,040.00	3,232,000	貸付株式数	200株
Ｊ－オイルミルズ	6,300	1,651.00	10,401,300	貸付株式数	1,400株
ローソン	14,600	5,540.00	80,884,000	貸付株式数	3,400株
サンエー	5,000	3,990.00	19,950,000	貸付株式数	2,000株
カワチ薬品	5,100	2,159.00	11,010,900	貸付株式数	2,000株
エービーシー・マート	10,300	5,340.00	55,002,000	貸付株式数	4,100株
ハードオフコーポレーション	3,000	699.00	2,097,000		
高千穂交易	2,500	1,246.00	3,115,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	11,200	1,419.00	15,892,800	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	8,900	1,189.00	10,582,100	貸付株式数	1,900株
アダストリア	7,200	1,863.00	13,413,600	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,100	384.00	1,574,400	貸付株式数	1,600株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	380.00	380,000	貸付株式数	400株
オルバヘルスケアＨＬＤＧＳ	1,000	1,495.00	1,495,000		
伊藤忠食品	1,600	4,905.00	7,848,000		
くら寿司	7,100	3,740.00	26,554,000	貸付株式数	2,800株
キャンドゥ	1,800	2,315.00	4,167,000	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,800	1,009.00	5,852,200		
パルグループＨＬＤＧＳ	5,900	1,546.00	9,121,400		
ＪＡＬＵＸ	1,700	2,552.00	4,338,400	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	999.00	30,369,600	貸付株式数	12,100株
あらた	5,300	3,850.00	20,405,000	貸付株式数	2,000株
サーラコーポレーション	13,600	569.00	7,738,400	貸付株式数	5,400株
ワッツ	3,300	740.00	2,442,000	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,000	6,720.00	6,720,000	貸付株式数	300株
ハローズ	3,000	2,647.00	7,941,000	貸付株式数	1,200株
ＪＰホールディングス	17,600	245.00	4,312,000	貸付株式数	7,200株
フジオフードＧ本社	5,700	1,344.00	7,660,800	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,600	2,870.00	4,592,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,000	6,770.00	13,540,000	貸付株式数	300株
ひらまつ	14,200	194.00	2,754,800	貸付株式数	100株
フィールズ	5,900	532.00	3,138,800		
双日	74,200	1,606.00	119,165,200		
アルフレッサホールディングス	73,800	1,538.00	113,504,400		
大黒天物産	2,100	6,120.00	12,852,000	貸付株式数	800株

ハニーズホールディングス	5,300	1,000.00	5,300,000		
ファーマライズＨＤ	1,900	751.00	1,426,900	貸付株式数	600株
キッコーマン	48,600	8,660.00	420,876,000		
味　の　素	149,200	3,407.00	508,324,400		
キユーピー	35,500	2,309.00	81,969,500		
ハウス食品Ｇ本社	25,300	2,789.00	70,561,700	貸付株式数	300株
カ　ゴ　メ	25,700	2,765.00	71,060,500		
焼津水産化工	3,400	931.00	3,165,400	貸付株式数	700株
アリアケジャパン	6,200	6,400.00	39,680,000		
ピエトロ	900	1,770.00	1,593,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,500	2,307.00	3,460,500		
やまみ	800	1,767.00	1,413,600		
ニチレイ	32,200	2,601.00	83,752,200		
横浜冷凍	18,200	803.00	14,614,600	貸付株式数	6,900株
東洋水産	32,500	4,600.00	149,500,000	貸付株式数	3,500株
イートアンドＨＬＤＧＳ	2,600	2,079.00	5,405,400	貸付株式数	1,000株
大冷	800	1,910.00	1,528,000	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,600	627.00	2,257,200	貸付株式数	1,400株
日清食品ＨＤ	26,500	8,340.00	221,010,000		
永谷園ホールディングス	3,000	1,933.00	5,799,000		
一正蒲鉾	2,800	853.00	2,388,400		
フジッコ	7,500	1,808.00	13,560,000		
ロックフィールド	7,500	1,438.00	10,785,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	362,200	2,273.50	823,461,700		
ケンコーマヨネーズ	3,900	1,271.00	4,956,900	貸付株式数	1,500株
わらべや日洋ＨＤ	4,500	1,842.00	8,289,000	貸付株式数	1,700株
なとり	3,800	1,901.00	7,223,800	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,500	927.00	1,390,500	貸付株式数	300株
ピックルスコーポレーション	3,400	1,765.00	6,001,000	貸付株式数	1,200株
北の達人コーポ	24,000	356.00	8,544,000	貸付株式数	9,400株 (2,500株)
ユーグレナ	35,300	795.00	28,063,500	貸付株式数	13,600株
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	3,500	1,239.00	4,336,500	貸付株式数	100株
ＡＤワークスグループ	13,100	157.00	2,056,700	貸付株式数	5,200株
片倉工業	8,800	2,191.00	19,280,800	貸付株式数	1,200株
グ　ン　ゼ	4,700	3,945.00	18,541,500	貸付株式数	600株
ヒューリック	157,900	1,076.00	169,900,400	貸付株式数	54,800株

神　栄	1,200	821.00	985,200		
ラサ商事	4,400	857.00	3,770,800		
アルペン	5,300	2,174.00	11,522,200	貸付株式数	2,000株
ハブ	2,200	660.00	1,452,000	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	4,700	1,533.00	7,205,100	貸付株式数	1,800株
クオールホールディングス	8,200	1,381.00	11,324,200	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	7,500	1,175.00	8,812,500		
神戸物産	51,600	4,280.00	220,848,000	貸付株式数	20,500株
ソリトンシステムズ	3,600	1,197.00	4,309,200		
ジンズホールディングス	4,500	6,450.00	29,025,000	貸付株式数	1,700株
ビックカメラ	39,300	937.00	36,824,100	貸付株式数	15,700株 (300株)
ＤＣＭホールディングス	40,900	1,051.00	42,985,900		
ペッパーフードサービス	9,200	391.00	3,597,200	貸付株式数	3,600株 (300株)
ハイパー	1,700	549.00	933,300	貸付株式数	600株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	84,200	2,256.00	189,955,200		
東京一番フーズ	1,700	585.00	994,500	貸付株式数	600株
ＤＤホールディングス	3,500	459.00	1,606,500	貸付株式数	1,400株
あい　ホールディングス	9,500	1,938.00	18,411,000		
ディーブイエックス	2,100	1,005.00	2,110,500	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	463.00	648,200	貸付株式数	500株
アークランドサービスＨＤ	5,500	2,254.00	12,397,000	貸付株式数	2,000株
Ｊ．　フロント　リテイリング	79,400	932.00	74,000,800		
ドトール・日レスＨＤ	11,400	1,517.00	17,293,800	貸付株式数	4,500株
マツキヨココカラ＆カンパニー	40,800	4,450.00	181,560,000		
ブロンコビリー	3,800	2,278.00	8,656,400	貸付株式数	1,500株
ＺＯＺＯ	45,600	3,615.00	164,844,000		
トレジャー・ファクトリー	2,100	871.00	1,829,100		
物語コーポレーション	3,500	7,250.00	25,375,000	貸付株式数	1,400株
三越伊勢丹ＨＤ	116,500	776.00	90,404,000		
東洋紡	27,200	1,195.00	32,504,000		
ユニチカ	18,500	289.00	5,346,500		
富士紡ホールディングス	2,900	3,765.00	10,918,500	貸付株式数	400株
日清紡ホールディングス	40,900	819.00	33,497,100		
倉敷紡績	5,600	1,822.00	10,203,200	貸付株式数	400株
ダイワボウＨＤ	32,200	1,809.00	58,249,800		
シキボウ	3,100	894.00	2,771,400	貸付株式数	400株

日東紡績	10,300	2,666.00	27,459,800		
トヨタ紡織	27,200	2,239.00	60,900,800		
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	16,000	2,558.00	40,928,000	貸付株式数	1,400株
Ｈａｍｅｅ	1,900	1,109.00	2,107,100	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,336.00	7,008,000	貸付株式数	100株
ウエルシアＨＤ	35,200	4,025.00	141,680,000		
クリエイトＳＤＨ	9,800	3,120.00	30,576,000	貸付株式数	3,700株
バイタルＫＳＫＨＤ	11,800	765.00	9,027,000		
八洲電機	4,600	900.00	4,140,000	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	3,900	903.00	3,521,700	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,100	1,852.00	11,297,200	貸付株式数	1,000株
ジューテックＨＤ	1,600	1,033.00	1,652,800	貸付株式数	500株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	7,700	362.00	2,787,400	貸付株式数	2,500株
大光	2,500	689.00	1,722,500	貸付株式数	1,100株
ＯＣＨＩホールディングス	2,000	1,256.00	2,512,000	貸付株式数	700株
ＴＯＫＡＩホールディングス	31,500	826.00	26,019,000		
黒谷	1,500	588.00	882,000	貸付株式数	700株
ミサワ	1,900	653.00	1,240,700	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,400	1,310.00	1,834,000	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	500	721.00	360,500	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	441.00	749,700	貸付株式数	400株
三洋貿易	7,700	969.00	7,461,300		
チムニー	2,000	1,229.00	2,458,000	貸付株式数	800株
シュッピン	5,500	973.00	5,351,500	貸付株式数	2,200株
ビューティガレージ	1,100	3,735.00	4,108,500	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,500	3,340.00	31,730,000	貸付株式数	2,500株
ウイン・パートナーズ	4,600	940.00	4,324,000		
ネクステージ	13,700	2,290.00	31,373,000		
ジョイフル本田	19,400	1,560.00	30,264,000	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,600	1,655.00	4,303,000	貸付株式数	900株
ホットランド	4,900	1,300.00	6,370,000	貸付株式数	1,900株 (200株)
すかいらーくＨＤ	92,600	1,469.00	136,029,400	貸付株式数	34,200株
ＳＦＰホールディングス	3,300	1,301.00	4,293,300	貸付株式数	1,300株
綿半ホールディングス	5,000	1,215.00	6,075,000	貸付株式数	1,400株
日本毛織	20,200	841.00	16,988,200	貸付株式数	8,000株

ダイトウボウ	12,100	100.00	1,210,000	貸付株式数	4,400株
トーア紡コーポレーション	2,300	427.00	982,100	貸付株式数	300株
ダイドーリミテツド	7,600	160.00	1,216,000	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,300	1,972.00	2,563,600	貸付株式数	500株
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,000	1,000.00	19,000,000	貸付株式数	7,600株
三栄建築設計	2,500	1,621.00	4,052,500		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	33,900	2,465.00	83,563,500		
三重交通グループＨＤ	13,000	456.00	5,928,000	貸付株式数	5,100株
サムティ	10,400	2,286.00	23,774,400	貸付株式数	4,100株
日本商業開発	4,600	1,691.00	7,778,600	貸付株式数	1,700株
プレサンスコーポレーション	8,500	1,714.00	14,569,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,192.00	2,630,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	700	1,255.00	878,500		
日本管理センター	3,700	1,022.00	3,781,400		
サンセイランディック	1,000	778.00	778,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	613.00	674,300		
フージャースＨＤ	7,300	630.00	4,599,000	貸付株式数	3,600株
オープンハウス	21,200	6,440.00	136,528,000		
東急不動産ＨＤ	194,500	586.00	113,977,000		
飯田ＧＨＤ	55,300	2,348.00	129,844,400		
イーグランド	800	1,558.00	1,246,400		
帝国繊維	7,600	1,973.00	14,994,800	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	58,300	122.00	7,112,600		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,009.00	3,935,100	貸付株式数	1,400株
ミタチ産業	1,100	890.00	979,000	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,600	2,732.00	9,835,200		
あさひ	5,600	1,284.00	7,190,400	貸付株式数	2,100株
日本調剤	4,200	1,267.00	5,321,400	貸付株式数	1,500株
コスモス薬品	6,700	17,610.00	117,987,000	貸付株式数	2,600株
シップヘルスケアＨＤ	21,200	2,530.00	53,636,000	貸付株式数	3,200株
トーエル	3,100	774.00	2,399,400	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	4,385.00	12,716,500		
オンリー	1,100	759.00	834,900		
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	259,400	4,554.00	1,181,307,600		
クリエイト・レストランツ・ホール	31,700	680.00	21,556,000	貸付株式数	14,200株
明治電機工業	1,700	1,226.00	2,084,200	貸付株式数	300株

ツルハホールディングス	14,500	12,800.00	185,600,000		
デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,800	591.00	1,654,800	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディングス	1,600	1,134.00	1,814,400	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,200	1,408.00	7,321,600	貸付株式数	300株
フェリシモ	1,600	1,321.00	2,113,600	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	16,600	2,421.00	40,188,600	貸付株式数	6,400株
帝　人	61,900	1,301.00	80,531,900		
東　レ	477,800	660.80	315,730,240		
ク　ラ　レ	96,300	944.00	90,907,200		
旭　化　成	436,700	1,071.50	467,924,050		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	6,900	669.00	4,616,100	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,700	1,308.00	4,839,600	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングＧ	2,000	2,906.00	5,812,000	貸付株式数	200株
トーカロ	16,800	1,484.00	24,931,200		
アルファＣＯ	2,500	1,070.00	2,675,000	貸付株式数	1,000株
ＳＵＭＣＯ	102,400	2,488.00	254,771,200	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,400	3,695.00	5,173,000	貸付株式数	100株
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	2,200	6,440.00	14,168,000	貸付株式数	600株
信和	5,600	748.00	4,188,800		
ビーロット	3,900	503.00	1,961,700	貸付株式数	1,500株
ファーストブラザーズ	1,500	923.00	1,384,500	貸付株式数	600株 (200株)
ハウスドゥ	2,900	905.00	2,624,500	貸付株式数	600株
シーアールイー	1,900	1,673.00	3,178,700	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	700	1,740.00	1,218,000	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	3,000	8,530.00	25,590,000		
アグレ都市デザイン	900	1,698.00	1,528,200	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,400	2,734.00	3,827,600	貸付株式数	500株
テンポイノベーション	1,600	831.00	1,329,600	貸付株式数	600株
グロバルリンクマネジメント	800	932.00	745,600	貸付株式数	400株
住江織物	1,300	1,534.00	1,994,200		
日本フエルト	4,100	431.00	1,767,100		
イチカワ	800	1,355.00	1,084,000		
エコナックホールディングス	13,500	94.00	1,269,000		

日東製網	900	1,451.00	1,305,900	貸付株式数	200株
芦森工業	1,200	904.00	1,084,800		
アツギ	5,200	666.00	3,463,200		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,000	883.00	883,000	貸付株式数	400株
ＪＭホールディングス	4,900	1,722.00	8,437,800		
コメダホールディングス	14,600	1,944.00	28,382,400	貸付株式数	5,700株
サツドラホールディングス	3,000	680.00	2,040,000		
アレンザホールディングス	5,100	1,021.00	5,207,100	貸付株式数	2,000株
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,800	1,933.00	3,479,400		
バロックジャパン	4,900	824.00	4,037,600	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,600	7,190.00	47,454,000		
ダイニック	2,500	685.00	1,712,500		
共和レザー	3,800	605.00	2,299,000		
ピーバンドットコム	1,200	586.00	703,200	貸付株式数	300株
力の源ＨＤ	3,300	596.00	1,966,800	貸付株式数	1,300株
ＦＯＯＤ＆ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮ	38,900	4,825.00	187,692,500		
アセンテック	2,200	1,167.00	2,567,400	貸付株式数	600株
セーレン	13,400	2,273.00	30,458,200	貸付株式数	6,400株
ソトー	1,800	825.00	1,485,000	貸付株式数	400株
東海染工	800	1,129.00	903,200	貸付株式数	100株
小松マテーレ	10,900	1,177.00	12,829,300		
ワコールホールディングス	16,500	2,013.00	33,214,500		
ホギメディカル	8,800	3,000.00	26,400,000	貸付株式数	800株
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,000	240.00	240,000	貸付株式数	600株
ＴＳＩホールディングス	22,100	345.00	7,624,500	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,100	1,217.00	2,555,700	貸付株式数	800株
ワールド	8,600	1,189.00	10,225,400		
ＴＩＳ	62,800	3,510.00	220,428,000		
ＪＮＳホールディングス	2,900	526.00	1,525,400	貸付株式数	1,300株
グリー	42,600	998.00	42,514,800		
コーエーテクモＨＤ	21,100	4,755.00	100,330,500		
三菱総合研究所	2,700	3,710.00	10,017,000		
ボルテージ	2,000	344.00	688,000	貸付株式数	900株
電算	800	2,355.00	1,884,000	貸付株式数	100株
ＡＧＳ	3,100	821.00	2,545,100	貸付株式数	200株
ファインデックス	6,100	1,014.00	6,185,400	貸付株式数	1,600株
ブレインパッド	1,700	5,640.00	9,588,000	貸付株式数	200株
ＫＬａｂ	12,100	556.00	6,727,600	貸付株式数	4,800株

ポールトゥウィン・ピットクル	9,400	964.00	9,061,600		
イーブックイニシアティブ	300	4,720.00	1,416,000		
ネクソン	148,800	2,254.00	335,395,200		
アイスタイル	21,600	275.00	5,940,000	貸付株式数	8,000株
エムアップホールディングス	2,000	4,300.00	8,600,000		
エイチーム	4,600	1,058.00	4,866,800	貸付株式数	1,700株
エニグモ	7,200	975.00	7,020,000		
テクノスジャパン	5,300	520.00	2,756,000		
ｅｎｉｓｈ	4,100	366.00	1,500,600	貸付株式数	1,600株
コロプラ	21,700	693.00	15,038,100		
オルトプラス	5,100	333.00	1,698,300	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	33,800	480.00	16,224,000	貸付株式数	13,200株
クロス・マーケティングＧ	3,300	1,105.00	3,646,500	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,000	2,478.00	7,434,000		
システム情報	5,400	880.00	4,752,000	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,400	4,575.00	10,980,000	貸付株式数	900株
じげん	18,300	309.00	5,654,700		
ブイキューブ	7,000	1,135.00	7,945,000	貸付株式数	2,600株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	611.00	672,100	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,600	1,047.00	2,722,200		
ディー・エル・イー	4,300	296.00	1,272,800		
フィックスターズ	7,100	831.00	5,900,100	貸付株式数	2,800株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,700	2,130.00	5,751,000	貸付株式数	1,200株
オプティム	4,600	1,437.00	6,610,200	貸付株式数	1,800株
セレス	2,600	2,252.00	5,855,200	貸付株式数	900株
ＳＨＩＦＴ	3,400	25,320.00	86,088,000		
特種東海製紙	4,000	4,025.00	16,100,000		
ティーガイア	5,900	1,616.00	9,534,400	貸付株式数	1,400株
セック	800	2,262.00	1,809,600	貸付株式数	300株
テクマトリックス	11,100	1,955.00	21,700,500	貸付株式数	4,000株
プロシップ	2,200	1,537.00	3,381,400		
ガンホー・オンライン・エンター	17,900	3,040.00	54,416,000		
GMOペイメントゲートウェイ	12,900	15,230.00	196,467,000		
ザッパラス	4,100	533.00	2,185,300		
システムリサーチ	2,100	1,826.00	3,834,600	貸付株式数	600株

インターネットイニシアティブ	18,000	4,860.00	87,480,000		
さくらインターネット	7,800	531.00	4,141,800	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,700	824.00	1,400,800	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,500	3,995.00	5,992,500	貸付株式数	500株 (400株)
ＳＲＡホールディングス	3,000	2,758.00	8,274,000		
システムインテグレータ	1,800	544.00	979,200	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,200	602.00	3,732,400		
ｅＢＡＳＥ	8,600	644.00	5,538,400	貸付株式数	3,100株
アバント	7,700	1,341.00	10,325,700		
アドソル日進	2,700	1,708.00	4,611,600	貸付株式数	900株
フリービット	4,000	1,220.00	4,880,000	貸付株式数	100株 (100株)
コムチュア	7,400	3,535.00	26,159,000		
サイバーコム	800	1,160.00	928,000	貸付株式数	400株
アステリア	4,700	803.00	3,774,100	貸付株式数	1,900株
アイル	3,600	1,551.00	5,583,600		
王子ホールディングス	275,000	525.00	144,375,000		
日本製紙	30,900	1,066.00	32,939,400	貸付株式数	10,400株
三菱製紙	7,800	313.00	2,441,400		
北越コーポレーション	42,700	780.00	33,306,000		
中越パルプ	2,300	970.00	2,231,000		
巴川製紙	2,100	845.00	1,774,500	貸付株式数	200株
大王製紙	31,800	1,799.00	57,208,200		
阿波製紙	1,200	366.00	439,200		
マークラインズ	3,600	2,648.00	9,532,800		
メディカル・データ・ビジ	8,900	1,329.00	11,828,100	貸付株式数	3,300株
ｇｕｍｉ	9,500	816.00	7,752,000		
ショーケース	1,900	500.00	950,000	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	2,100	969.00	2,034,900	貸付株式数	600株
テラスカイ	2,500	2,049.00	5,122,500	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,800	1,391.00	3,894,800	貸付株式数	1,100株
ＰＣＩホールディングス	2,900	1,140.00	3,306,000	貸付株式数	1,200株
パイプドHD	1,600	2,472.00	3,955,200		
アイビーシー	900	739.00	665,100	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,800	1,303.00	2,345,400	貸付株式数	700株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,800	3,185.00	5,733,000	貸付株式数	500株
ラクス	22,700	3,070.00	69,689,000		

ランドコンピュータ	1,500	818.00	1,227,000		
ダブルスタンダード	2,000	3,745.00	7,490,000		
オープンドア	3,900	1,827.00	7,125,300	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,600	601.00	1,562,600	貸付株式数	1,000株
アカツキ	3,000	2,738.00	8,214,000	貸付株式数	400株
ベネフィットジャパン	700	2,648.00	1,853,600		
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,700	2,860.00	4,862,000	貸付株式数	700株
カナミックネットワーク	7,500	491.00	3,682,500	貸付株式数	1,500株
ノムラシステムコーポレーション	3,900	246.00	959,400	貸付株式数	1,400株
レンゴー	61,500	767.00	47,170,500	貸付株式数	3,200株
トーモク	4,100	1,761.00	7,220,100		
ザ・パック	5,100	2,680.00	13,668,000	貸付株式数	1,900株
チェンジ	12,600	2,110.00	26,586,000		
シンクロ・フード	3,700	354.00	1,309,800	貸付株式数	400株
オークネット	3,900	1,686.00	6,575,400	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	2,000	735.00	1,470,000		
エイトレッド	900	2,261.00	2,034,900	貸付株式数	500株
マクロミル	13,500	919.00	12,406,500	貸付株式数	1,500株
ビーグリー	1,700	1,785.00	3,034,500		
オロ	2,100	3,400.00	7,140,000	貸付株式数	200株
ユーザーローカル	2,000	1,626.00	3,252,000	貸付株式数	800株
テモナ	2,000	483.00	966,000	貸付株式数	600株
ニーズウェル	1,800	569.00	1,024,200		
マネーフォワード	10,000	7,820.00	78,200,000		
サインポスト	2,100	1,439.00	3,021,900	貸付株式数	800株
昭和電工	57,200	2,502.00	143,114,400		
住友化学	483,500	524.00	253,354,000		
住友精化	2,800	3,020.00	8,456,000	貸付株式数	400株
日産化学	36,000	6,540.00	235,440,000		
ラサ工業	2,200	1,658.00	3,647,600		
クレハ	5,200	7,900.00	41,080,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,600	5,450.00	14,170,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,600	1,163.00	5,349,800		
石原産業	10,800	1,166.00	12,592,800	貸付株式数	1,300株
片倉コープアグリ	1,100	1,154.00	1,269,400	貸付株式数	200株
日本曹達	8,300	3,215.00	26,684,500	貸付株式数	900株
東ソー	94,900	1,631.00	154,781,900		
トクヤマ	21,000	1,784.00	37,464,000		

セントラル硝子	11,500	1,944.00	22,356,000	貸付株式数	2,800株
東亞合成	39,000	1,176.00	45,864,000	貸付株式数	2,300株
大阪ソーダ	6,000	2,555.00	15,330,000	貸付株式数	800株
関東電化	14,000	1,008.00	14,112,000	貸付株式数	1,800株
デンカ	24,000	3,345.00	80,280,000		
イビデン	35,400	7,070.00	250,278,000		
信越化学	113,200	19,000.00	2,150,800,000		
日本カ－バイド	1,900	1,255.00	2,384,500	貸付株式数	300株
電算システムＨＤ	2,700	2,255.00	6,088,500		
堺　化　学	4,400	2,096.00	9,222,400	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,000	1,278.00	7,668,000	貸付株式数	800株
エア・ウォーター	62,200	1,677.00	104,309,400	貸付株式数	2,500株
日本酸素ＨＬＤＧＳ	63,300	2,403.00	152,109,900		
日本化学工業	2,000	2,520.00	5,040,000		
東邦アセチレン	1,200	1,194.00	1,432,800	貸付株式数	400株
日本パ－カライジング	32,800	1,060.00	34,768,000		
高圧ガス	10,100	736.00	7,433,600		
チタン工業	600	1,676.00	1,005,600	貸付株式数	300株
四国化成	8,400	1,366.00	11,474,400		
戸田工業	1,500	3,440.00	5,160,000		
ステラ　ケミファ	3,200	2,500.00	8,000,000	貸付株式数	1,400株
保土谷化学	2,100	4,625.00	9,712,500		
日本触媒	11,000	5,070.00	55,770,000	貸付株式数	1,300株
大日精化	5,300	2,200.00	11,660,000		
カネカ	17,000	3,700.00	62,900,000		
協和キリン	79,100	3,170.00	250,747,000		
三菱瓦斯化学	61,100	1,889.00	115,417,900	貸付株式数	2,500株
三井化学	59,800	3,045.00	182,091,000		
ＪＳＲ	61,400	4,240.00	260,336,000		
東京応化工業	11,400	7,120.00	81,168,000		
大阪有機化学	6,100	3,650.00	22,265,000		
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	440,000	892.20	392,568,000		
ＫＨネオケム	11,100	3,080.00	34,188,000		
ダイセル	95,000	783.00	74,385,000		
住友ベ－クライト	10,400	5,310.00	55,224,000		
積水化学	137,800	1,845.00	254,241,000		
日本ゼオン	60,300	1,203.00	72,540,900		
アイカ工業	18,300	3,315.00	60,664,500		
宇部興産	32,100	1,900.00	60,990,000		
積水樹脂	10,200	2,019.00	20,593,800		

タキロンシーアイ	16,400	522.00	8,560,800		
旭有機材	5,000	1,490.00	7,450,000		
ニチバン	3,900	1,747.00	6,813,300	貸付株式数	1,200株
リケンテクノス	16,200	481.00	7,792,200	貸付株式数	700株
大倉工業	3,300	2,052.00	6,771,600	貸付株式数	1,300株
積水化成品	14,700	476.00	6,997,200		
群栄化学	1,400	3,275.00	4,585,000		
タイガース　ポリマー	9,600	427.00	4,099,200		
ミライアル	2,100	1,627.00	3,416,700		
ダイキアクシス	2,600	835.00	2,171,000	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	16,500	537.00	8,860,500	貸付株式数	6,200株
竹本容器	2,900	774.00	2,244,600	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,500	1,710.00	5,985,000		
日本化薬	51,600	1,114.00	57,482,400		
カーリットホールディングス	6,300	653.00	4,113,900		
ソルクシーズ	6,000	463.00	2,778,000		
レッグス	1,300	1,453.00	1,888,900	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	23,800	690.00	16,422,000	貸付株式数	8,000株
フェイス	1,900	633.00	1,202,700	貸付株式数	400株
プロトコーポレーション	7,100	1,271.00	9,024,100	貸付株式数	3,000株
ハイマックス	1,600	1,094.00	1,750,400	貸付株式数	100株
アミューズ	3,600	1,895.00	6,822,000		
野村総合研究所	127,500	4,880.00	622,200,000		
ドリームインキュベータ	1,800	827.00	1,488,600	貸付株式数	700株
サイバネットシステム	5,300	682.00	3,614,600		
クイック	4,300	1,403.00	6,032,900		
ＴＡＣ	4,200	217.00	911,400		
ＣＥホールディングス	3,300	468.00	1,544,400	貸付株式数	1,400株
日本システム技術	1,300	2,819.00	3,664,700		
電通グループ	66,200	3,610.00	238,982,000		
インテージホールディングス	8,800	1,751.00	15,408,800	貸付株式数	3,200株
テイクアンドギヴニーズ	3,100	900.00	2,790,000	貸付株式数	1,000株
東邦システムサイエンス	1,500	991.00	1,486,500	貸付株式数	600株
ぴあ	2,300	3,770.00	8,671,000	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	2,500	1,738.00	4,345,000	貸付株式数	900株
ソースネクスト	28,000	185.00	5,180,000	貸付株式数	11,200株
シーティーエス	7,300	779.00	5,686,700	貸付株式数	2,600株
ネクシィーズグループ	2,300	792.00	1,821,600	貸付株式数	800株

インフォコム	7,200	1,909.00	13,744,800		
メディカルシステムネットワーク	6,500	620.00	4,030,000		
日本精化	5,300	2,000.00	10,600,000		
扶桑化学工業	5,900	4,720.00	27,848,000		
トリケミカル	6,800	3,500.00	23,800,000	貸付株式数	2,400株
ＨＥＲＯＺ	1,800	1,440.00	2,592,000	貸付株式数	700株
ラクスル	7,400	6,260.00	46,324,000	貸付株式数	2,800株
ＦＩＧ	6,800	329.00	2,237,200	貸付株式数	2,700株
システムサポート	1,900	1,209.00	2,297,100		
ＡＤＥＫＡ	30,200	2,411.00	72,812,200		
日油	22,500	5,600.00	126,000,000	貸付株式数	1,800株
ミヨシ油脂	2,400	1,267.00	3,040,800	貸付株式数	900株
新日本理化	13,000	244.00	3,172,000	貸付株式数	4,200株
ハリマ化成グループ	4,700	791.00	3,717,700		
イーソル	4,000	666.00	2,664,000	貸付株式数	1,600株
アルテリア・ネットワークス	8,600	1,539.00	13,235,400	貸付株式数	3,100株
東海ソフト	900	1,031.00	927,900	貸付株式数	400株
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,500	2,416.00	3,624,000	貸付株式数	600株
トビラシステムズ	1,300	925.00	1,202,500	貸付株式数	200株
Ｓａｎｓａｎ	24,000	3,130.00	75,120,000	貸付株式数	500株
花　王	148,900	5,787.00	861,684,300	貸付株式数	47,000株
第一工業製薬	2,400	3,095.00	7,428,000		
石原ケミカル	3,400	1,265.00	4,301,000		
日華化学	2,100	818.00	1,717,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,250.00	3,150,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,800	5,090.00	19,342,000		
武田薬品	529,200	3,031.00	1,604,005,200		
アステラス製薬	583,800	1,779.50	1,038,872,100		
大日本住友製薬	41,600	1,382.00	57,491,200		
塩野義製薬	84,700	7,923.00	671,078,100		
わかもと製薬	8,500	287.00	2,439,500	貸付株式数	3,100株
日本新薬	17,600	8,400.00	147,840,000	貸付株式数	800株
中外製薬	210,700	3,680.00	775,376,000		
科研製薬	10,600	4,045.00	42,877,000	貸付株式数	500株
エーザイ	80,600	6,873.00	553,963,800		
理研ビタミン	7,100	1,603.00	11,381,300	貸付株式数	800株
ロート製薬	34,600	3,235.00	111,931,000		

小野薬品	154,800	2,505.50	387,851,400		
久光製薬	17,800	3,990.00	71,022,000	貸付株式数	7,700株
有機合成薬品	4,300	266.00	1,143,800	貸付株式数	1,900株
持田製薬	8,600	3,180.00	27,348,000	貸付株式数	1,300株
参天製薬	125,700	1,504.00	189,052,800		
扶桑薬品	2,400	2,369.00	5,685,600		
日本ケミファ	900	2,041.00	1,836,900		
ツムラ	20,900	3,235.00	67,611,500	貸付株式数	2,400株
日医工	21,000	672.00	14,112,000	貸付株式数	8,200株
テ　ル　モ	190,400	4,628.00	881,171,200		
ＨＵグループＨＤ	16,900	2,862.00	48,367,800	貸付株式数	1,800株
キッセイ薬品工業	11,900	2,284.00	27,179,600		
生化学工業	12,000	938.00	11,256,000		
栄研化学	12,000	1,893.00	22,716,000		
日水製薬	2,700	939.00	2,535,300		
鳥居薬品	3,700	2,778.00	10,278,600		
ＪＣＲファーマ	19,300	2,499.00	48,230,700		
東和薬品	9,800	2,626.00	25,734,800		
富士製薬工業	4,500	1,080.00	4,860,000		
ゼリア新薬工業	12,300	1,919.00	23,603,700	貸付株式数	4,900株
第一三共	529,200	2,824.50	1,494,725,400		
キョーリン製薬ＨＤ	13,600	1,688.00	22,956,800	貸付株式数	2,000株
大幸薬品	10,500	808.00	8,484,000	貸付株式数	4,000株
ダイト	4,400	2,841.00	12,500,400		
大塚ホールディングス	140,000	4,146.00	580,440,000		
大正製薬ＨＤ	16,100	5,580.00	89,838,000	貸付株式数	800株
ペプチドリーム	35,400	2,862.00	101,314,800		
大日本塗料	7,800	791.00	6,169,800		
日本ペイントＨＯＬＤ	247,700	1,193.00	295,506,100		
関西ペイント	68,200	2,550.00	173,910,000	貸付株式数	3,100株
神東塗料	5,800	183.00	1,061,400		
中国塗料	16,400	862.00	14,136,800		
日本特殊塗料	4,900	793.00	3,885,700		
藤倉化成	7,500	490.00	3,675,000	貸付株式数	1,000株
太陽ホールディングス	9,800	3,225.00	31,605,000		
ＤＩＣ	27,600	2,845.00	78,522,000		
サカタインクス	13,700	972.00	13,316,400	貸付株式数	3,100株
東洋インキＳＣホールディン	13,500	1,875.00	25,312,500		
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,900	746.00	3,655,400		

アルプス技研	5,500	1,870.00	10,285,000		
サニックス	11,300	246.00	2,779,800	貸付株式数	4,400株
ダイオーズ	800	991.00	792,800	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,300	779.00	4,907,700		
オリエンタルランド	76,100	17,840.00	1,357,624,000		
フォーカスシステムズ	4,200	1,023.00	4,296,600	貸付株式数	1,300株
ダスキン	15,000	2,617.00	39,255,000		
パーク２４	35,800	1,610.00	57,638,000		
明光ネットワークジャパン	8,100	541.00	4,382,100	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,693.00	4,909,700	貸付株式数	400株
クレスコ	4,700	1,920.00	9,024,000		
フジ・メディア・ＨＤ	63,700	1,128.00	71,853,600	貸付株式数	7,400株
秀英予備校	2,200	410.00	902,000	貸付株式数	600株
田谷	1,600	530.00	848,000	貸付株式数	600株
ラウンドワン	18,000	1,309.00	23,562,000	貸付株式数	6,100株
リゾートトラスト	29,800	1,860.00	55,428,000	貸付株式数	11,200株
オービック	20,800	20,990.00	436,592,000		
ジャストシステム	9,500	5,190.00	49,305,000		
ＴＤＣソフト	5,900	1,193.00	7,038,700		
Ｚホールディングス	960,600	752.00	722,371,200		
ビー・エム・エル	8,400	3,530.00	29,652,000		
トレンドマイクロ	35,300	6,550.00	231,215,000		
りらいあコミュニケーショ	9,900	1,009.00	9,989,100		
ＩＤホールディングス	3,700	833.00	3,082,100		
リソー教育	29,700	405.00	12,028,500	貸付株式数	5,000株
日本オラクル	13,500	11,160.00	150,660,000		
早稲田アカデミー	3,800	977.00	3,712,600	貸付株式数	400株
アルファシステムズ	1,700	3,810.00	6,477,000	貸付株式数	700株
フューチャー	7,900	4,055.00	32,034,500		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,600	1,497.00	5,389,200	貸付株式数	100株
ＳＢテクノロジー	2,900	2,696.00	7,818,400	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,700	713.00	1,212,100	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	71,800	1,666.00	119,618,800		
オービックビジネスＣ	6,500	5,100.00	33,150,000	貸付株式数	2,500株
伊藤忠テクノソリュー	30,500	3,695.00	112,697,500		
アイティフォー	7,500	792.00	5,940,000	貸付株式数	500株
東京個別指導学院	5,900	624.00	3,681,600	貸付株式数	2,200株
東計電算	900	5,150.00	4,635,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	159,100	2,093.00	332,996,300		
楽天グループ	330,500	1,161.00	383,710,500		

エックスネット	900	984.00	885,600	貸付株式数	100株
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,999.00	6,996,500		
テー・オー・ダブリュー	10,800	312.00	3,369,600	貸付株式数	4,200株
大塚商会	35,900	5,190.00	186,321,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,200	2,163.00	19,899,600		
山田コンサルティングＧＰ	3,200	1,113.00	3,561,600	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,500	2,343.00	5,857,500	貸付株式数	900株
パラカ	1,900	1,506.00	2,861,400	貸付株式数	600株
電通国際情報Ｓ	9,800	3,680.00	36,064,000		
ＡＣＣＥＳＳ	7,300	763.00	5,569,900	貸付株式数	500株
デジタルガレージ	10,900	4,980.00	54,282,000		
イーエムシステムズ	11,700	695.00	8,131,500	貸付株式数	2,800株
ウェザーニューズ	2,000	9,620.00	19,240,000	貸付株式数	700株
ＣＩＪ	4,000	805.00	3,220,000	貸付株式数	1,600株
ビジネスエンジニアリング	800	3,400.00	2,720,000	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	8,400	178.00	1,495,200	貸付株式数	400株
WOWOW	3,300	2,034.00	6,712,200	貸付株式数	1,300株
スカラ	6,500	608.00	3,952,000	貸付株式数	400株
インテリジェント　ウェイブ	3,300	522.00	1,722,600		
フルキャストホールディングス	5,700	2,648.00	15,093,600	貸付株式数	500株
エン・ジャパン	10,400	3,540.00	36,816,000	貸付株式数	1,500株
あすか製薬ＨＤ	7,800	962.00	7,503,600		
サワイグループＨＤ	14,800	4,200.00	62,160,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	118,300	8,931.00	1,056,537,300		
コニカミノルタ	146,700	469.00	68,802,300		
資　生　堂	125,400	6,503.00	815,476,200		
ライオン	81,300	1,611.00	130,974,300		
高砂香料	4,500	2,750.00	12,375,000		
マンダム	14,500	1,424.00	20,648,000	貸付株式数	5,300株
ミルボン	8,500	5,760.00	48,960,000	貸付株式数	3,200株
ファンケル	27,300	3,425.00	93,502,500		
コーセー	12,800	13,670.00	174,976,000		
コタ	4,700	1,505.00	7,073,500		
シーボン	800	1,686.00	1,348,800	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスＨＤ	28,900	2,022.00	58,435,800		
ノエビアホールディングス	5,700	5,250.00	29,925,000	貸付株式数	2,200株
アジュバンホールディング	1,900	1,090.00	2,071,000	貸付株式数	500株

エステー	4,400	1,537.00	6,762,800		
アグロカネショウ	2,500	1,172.00	2,930,000	貸付株式数	900株
コ　ニ　シ	11,500	1,598.00	18,377,000		
長谷川香料	11,500	2,812.00	32,338,000	貸付株式数	2,400株
星光ＰＭＣ	3,500	691.00	2,418,500		
小林製薬	18,900	8,920.00	168,588,000		
荒川化学工業	5,100	1,129.00	5,757,900	貸付株式数	1,900株
メック	5,200	4,120.00	21,424,000	貸付株式数	1,900株
日本高純度化学	1,700	2,560.00	4,352,000		
タカラバイオ	17,700	2,639.00	46,710,300	貸付株式数	100株
ＪＣＵ	7,500	4,800.00	36,000,000		
新田ゼラチン	4,100	600.00	2,460,000		
ＯＡＴアグリオ	1,300	2,118.00	2,753,400	貸付株式数	500株
デクセリアルズ	17,400	3,345.00	58,203,000	貸付株式数	2,000株
アース製薬	5,600	6,140.00	34,384,000	貸付株式数	2,200株
北興化学	6,400	846.00	5,414,400		
大成ラミック	2,000	2,740.00	5,480,000		
クミアイ化学	27,100	798.00	21,625,800		
日本農薬	12,100	465.00	5,626,500		
富士興産	2,100	1,032.00	2,167,200		
ニチレキ	8,700	1,307.00	11,370,900		
ユシロ化学	3,400	1,038.00	3,529,200	貸付株式数	500株
ビーピー・カストロール	2,400	1,365.00	3,276,000		
富士石油	18,900	242.00	4,573,800		
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,800	1,077.00	1,938,600	貸付株式数	700株
出光興産	74,500	2,931.00	218,359,500		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,010,700	423.40	427,930,380		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	19,400	2,225.00	43,165,000	貸付株式数	1,100株
インフロニアＨＤ	90,000	939.00	84,510,000		
横浜ゴム	39,200	1,766.00	69,227,200		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	35,700	1,726.00	61,618,200		
ブリヂストン	193,800	4,605.00	892,449,000		
住友ゴム	60,900	1,139.00	69,365,100		
藤倉コンポジット	6,200	788.00	4,885,600	貸付株式数	2,400株
オカモト	4,500	3,770.00	16,965,000		
アキレス	4,500	1,209.00	5,440,500	貸付株式数	500株
フ　コ　ク	2,700	920.00	2,484,000		
ニッタ	8,200	2,602.00	21,336,400		

クリエートメディック	1,800	976.00	1,756,800		
住友理工	15,500	574.00	8,897,000		
三ツ星ベルト	9,600	1,932.00	18,547,200		
バンドー化学	11,100	850.00	9,435,000	貸付株式数	1,500株
ＡＧＣ	62,000	5,550.00	344,100,000		
日本板硝子	34,200	502.00	17,168,400		
石塚硝子	1,000	1,905.00	1,905,000	貸付株式数	400株
有沢製作所	9,300	925.00	8,602,500	貸付株式数	3,600株
日本山村硝子	2,400	760.00	1,824,000		
日本電気硝子	28,000	2,939.00	82,292,000		
オハラ	2,800	1,363.00	3,816,400	貸付株式数	1,000株 (100株)
住友大阪セメント	13,300	3,450.00	45,885,000		
太平洋セメント	39,100	2,199.00	85,980,900		
リソルホールディングス	800	4,035.00	3,228,000	貸付株式数	200株
日本ヒユーム	6,400	666.00	4,262,400		
日本コンクリート	13,300	252.00	3,351,600	貸付株式数	1,800株
三谷セキサン	3,100	7,080.00	21,948,000	貸付株式数	1,200株
アジアパイルＨＤ	10,300	412.00	4,243,600		
東海カーボン	57,600	1,177.00	67,795,200		
日本カーボン	4,200	4,145.00	17,409,000		
東洋炭素	5,100	3,110.00	15,861,000		
ノリタケ	3,900	4,630.00	18,057,000		
ＴＯＴＯ	48,100	5,030.00	241,943,000		
日本碍子	73,300	1,797.00	131,720,100		
日本特殊陶業	51,500	1,888.00	97,232,000		
ダントーホールディングス	6,200	198.00	1,227,600	貸付株式数	1,800株
ＭＡＲＵＷＡ	2,400	13,400.00	32,160,000		
品川リフラクトリーズ	1,900	3,475.00	6,602,500		
黒崎播磨	1,400	3,900.00	5,460,000		
ヨータイ	5,000	1,211.00	6,055,000	貸付株式数	800株
イソライト	4,300	927.00	3,986,100		
東京窯業	14,700	294.00	4,321,800	貸付株式数	3,000株
ニッカトー	4,300	660.00	2,838,000		
フジミインコーポレーテッド	5,600	7,350.00	41,160,000		
クニミネ工業	3,000	1,014.00	3,042,000		
エーアンドエーマテリアル	900	886.00	797,400	貸付株式数	200株
ニチアス	15,600	2,566.00	40,029,600	貸付株式数	800株
日本製鉄	297,600	1,699.50	505,771,200		

神戸製鋼所	123,700	549.00	67,911,300		
中山製鋼所	9,100	413.00	3,758,300		
合同製鐵	3,500	1,314.00	4,599,000		
ＪＦＥホールディングス	179,700	1,316.00	236,485,200		
東京製鐵	22,400	1,203.00	26,947,200	貸付株式数	4,900株
共英製鋼	7,400	1,251.00	9,257,400	貸付株式数	2,800株
大和工業	12,600	3,485.00	43,911,000	貸付株式数	2,100株
東京鐵鋼	2,700	1,241.00	3,350,700		
大阪製鐵	3,300	1,013.00	3,342,900		
淀川製鋼所	8,400	2,280.00	19,152,000	貸付株式数	400株
丸一鋼管	23,200	2,427.00	56,306,400		
モリ工業	1,900	2,574.00	4,890,600		
大同特殊鋼	11,000	3,930.00	43,230,000		
日本高周波	2,300	349.00	802,700		
日本冶金工	4,600	2,043.00	9,397,800		
山陽特殊製鋼	6,500	1,818.00	11,817,000	貸付株式数	1,700株
愛知製鋼	3,800	2,427.00	9,222,600		
日立金属	71,500	2,102.00	150,293,000		
日本金属	1,700	901.00	1,531,700	貸付株式数	500株
大平洋金属	3,900	2,030.00	7,917,000		
新日本電工	44,300	292.00	12,935,600	貸付株式数	6,900株
栗本鉄工所	2,700	1,473.00	3,977,100		
虹　技	400	998.00	399,200	貸付株式数	200株
日本鋳鉄管	700	1,115.00	780,500		
日本製鋼所	20,300	3,425.00	69,527,500		
三菱製鋼	4,400	970.00	4,268,000	貸付株式数	1,800株
日亜鋼業	7,200	262.00	1,886,400		
日本精線	1,100	4,375.00	4,812,500	貸付株式数	100株
エンビプロＨＤ	2,800	1,897.00	5,311,600	貸付株式数	1,100株
大紀アルミニウム	10,100	1,462.00	14,766,200		
日本軽金属ＨＤ	16,200	1,669.00	27,037,800		
三井金属	18,000	2,930.00	52,740,000		
東邦亜鉛	3,600	2,122.00	7,639,200		
三菱マテリアル	43,900	1,954.00	85,780,600		
住友鉱山	85,000	4,233.00	359,805,000		
ＤＯＷＡホールディングス	18,000	4,220.00	75,960,000		
古河機金	10,300	1,198.00	12,339,400		
エス・サイエンス	23,300	29.00	675,700	貸付株式数	3,100株
大阪チタニウム	7,100	780.00	5,538,000	貸付株式数	2,800株
東邦チタニウム	12,500	948.00	11,850,000	貸付株式数	2,200株

ＵＡＣＪ	10,000	2,295.00	22,950,000		
ＣＫサンエツ	1,400	3,355.00	4,697,000		
古河電工	21,400	2,255.00	48,257,000		
住友電工	248,700	1,489.50	370,438,650		
フジクラ	74,100	573.00	42,459,300		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	5,800	1,878.00	10,892,400	貸付株式数	1,000株
東京特殊電線	1,100	2,656.00	2,921,600	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,500	461.00	5,762,500		
カナレ電気	800	1,703.00	1,362,400	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,700	1,102.00	4,077,400	貸付株式数	1,400株
リョービ	7,800	1,007.00	7,854,600	貸付株式数	3,000株
アーレステイ	6,600	362.00	2,389,200	貸付株式数	1,700株
アサヒＨＤ	26,500	1,914.00	50,721,000		
東洋製罐グループＨＤ	43,500	1,386.00	60,291,000		
ホッカンホールディングス	5,100	1,410.00	7,191,000		
コロナ	3,700	890.00	3,293,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11,600	2,121.00	24,603,600		
駒井ハルテック	1,200	1,720.00	2,064,000	貸付株式数	200株
高田機工	600	2,636.00	1,581,600	貸付株式数	100株
三和ホールディングス	62,800	1,213.00	76,176,400		
文化シヤッター	21,100	1,009.00	21,289,900	貸付株式数	7,700株
三協立山	9,400	684.00	6,429,600		
アルインコ	4,600	934.00	4,296,400	貸付株式数	1,800株
東洋シヤッター	1,600	615.00	984,000		
ＬＩＸＩＬ	104,800	2,789.00	292,287,200		
日本フイルコン	7,900	515.00	4,068,500	貸付株式数	1,600株
ノーリツ	13,600	1,629.00	22,154,400	貸付株式数	400株
長府製作所	6,900	2,001.00	13,806,900	貸付株式数	2,600株
リンナイ	12,600	10,720.00	135,072,000		
ユニプレス	9,600	710.00	6,816,000	貸付株式数	1,600株
ダイニチ工業	3,800	776.00	2,948,800		
日東精工	9,500	593.00	5,633,500		
三洋工業	900	1,851.00	1,665,900	貸付株式数	100株
岡　部	13,100	674.00	8,829,400	貸付株式数	5,100株
ジーテクト	8,000	1,333.00	10,664,000		
東　プ　レ	12,400	1,091.00	13,528,400		
高周波熱錬	11,800	553.00	6,525,400	貸付株式数	4,700株
東京製綱	2,900	760.00	2,204,000		
サンコール	5,400	447.00	2,413,800		
モリテックスチル	5,400	354.00	1,911,600	貸付株式数	2,100株

パイオラックス	9,300	1,610.00	14,973,000		
エイチワン	6,400	621.00	3,974,400		
日本発条	61,500	847.00	52,090,500	貸付株式数	7,600株
中央発條	4,400	838.00	3,687,200		
アドバネクス	1,100	1,119.00	1,230,900	貸付株式数	300株
三浦工業	28,800	3,985.00	114,768,000		
タ　ク　マ	22,900	1,370.00	31,373,000		
テクノプロ・ホールディング	38,600	3,120.00	120,432,000		
アトラグループ	1,900	280.00	532,000	貸付株式数	600株
インターワークス	1,300	417.00	542,100		
アイ・アールジャパンＨＤ	3,000	7,090.00	21,270,000		
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,400	2,574.00	11,325,600		
ファーストロジック	1,500	731.00	1,096,500		
三機サービス	1,300	974.00	1,266,200	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,800	546.00	2,620,800		
デザインワン・ジャパン	2,100	193.00	405,300	貸付株式数	700株
イー・ガーディアン	3,200	3,485.00	11,152,000		
リブセンス	4,400	193.00	849,200	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	19,700	1,552.00	30,574,400		
ベクトル	9,000	1,249.00	11,241,000	貸付株式数	3,600株
ウチヤマホールディングス	3,000	293.00	879,000	貸付株式数	1,200株
チャームケアコーポレーション	5,400	1,482.00	8,002,800	貸付株式数	1,900株
キャリアリンク	2,500	1,264.00	3,160,000	貸付株式数	100株
ＩＢＪ	5,900	1,020.00	6,018,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	2,700	1,689.00	4,560,300	貸付株式数	900株
バリューＨＲ	2,700	2,506.00	6,766,200	貸付株式数	1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,500	5,500.00	30,250,000	貸付株式数	300株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,600	1,713.00	4,453,800		
ＥＲＩホールディングス	1,700	1,386.00	2,356,200	貸付株式数	300株
アビスト	900	2,753.00	2,477,700	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス・ホールディンク	3,900	2,801.00	10,923,900		
ウィルグループ	4,700	1,360.00	6,392,000	貸付株式数	1,600株
エスクローＡＪ	8,300	177.00	1,469,100	貸付株式数	3,800株

リクルートホールディングス	496,200	6,901.00	3,424,276,200		
エラン	9,700	1,239.00	12,018,300		
ツ　ガ　ミ	16,000	1,411.00	22,576,000	貸付株式数	5,700株
オークマ	7,600	4,745.00	36,062,000		
芝浦機械	7,300	3,370.00	24,601,000		
アマダ	104,400	1,063.00	110,977,200		
アイダエンジニア	16,900	922.00	15,581,800		
滝澤鉄工所	1,100	1,116.00	1,227,600		
ＦＵＪＩ	30,500	2,489.00	75,914,500		
牧野フライス	7,100	3,455.00	24,530,500	貸付株式数	700株
オーエスジー	30,500	1,646.00	50,203,000		
ダイジェット	500	1,074.00	537,000		
旭ダイヤモンド	17,000	634.00	10,778,000	貸付株式数	1,600株
ＤＭＧ森精機	39,700	1,774.00	70,427,800		
ソディツク	16,100	767.00	12,348,700		
ディスコ	9,800	32,600.00	319,480,000		
日東工器	4,100	1,740.00	7,134,000		
日進工具	5,100	1,429.00	7,287,900	貸付株式数	600株
パンチ工業	5,800	510.00	2,958,000		
冨士ダイス	2,800	643.00	1,800,400		
土木管理総合試験	2,500	332.00	830,000	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	4,600	448.00	2,060,800	貸付株式数	1,200株
日本郵政	496,300	856.00	424,832,800		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	9,100	1,255.00	11,420,500	貸付株式数	4,300株
鎌倉新書	7,300	775.00	5,657,500	貸付株式数	2,900株 (1,800株)
ＳＭＮ	2,100	645.00	1,354,500	貸付株式数	500株
一蔵	1,000	391.00	391,000		
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,700	759.00	1,290,300	貸付株式数	400株
エアトリ	4,600	3,155.00	14,513,000	貸付株式数	1,500株
アトラエ	4,900	2,481.00	12,156,900		
ストライク	2,600	5,660.00	14,716,000		
ソラスト	16,200	1,234.00	19,990,800		
セラク	2,000	1,758.00	3,516,000	貸付株式数	800株
インソース	6,700	2,453.00	16,435,100	貸付株式数	2,400株
豊田自動織機	54,400	9,320.00	507,008,000		
豊和工業	3,700	776.00	2,871,200		
ＯＫＫ	2,900	742.00	2,151,800		

石川製作所	1,700	1,360.00	2,312,000	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,300	497.00	1,640,100	貸付株式数	700株
津田駒工業	800	655.00	524,000		
エンシュウ	900	628.00	565,200		
島精機製作所	9,500	1,908.00	18,126,000	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,300	2,243.00	18,616,900		
ＮＣホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600	貸付株式数	100株
イワキポンプ	4,000	1,004.00	4,016,000		
フリュー	6,000	1,272.00	7,632,000	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	14,800	523.00	7,740,400	貸付株式数	5,700株
日阪製作所	8,100	788.00	6,382,800		
やまびこ	12,600	1,248.00	15,724,800		
平田機工	3,100	5,970.00	18,507,000		
ペガサスミシン製造	6,600	436.00	2,877,600		
マルマエ	2,800	2,993.00	8,380,400	貸付株式数	100株
タツモ	3,100	1,669.00	5,173,900		
ナブテスコ	39,000	3,285.00	128,115,000		
三井海洋開発	7,300	1,398.00	10,205,400		
レオン自動機	6,900	1,309.00	9,032,100	貸付株式数	2,500株
ＳＭＣ	19,800	72,650.00	1,438,470,000		
ホソカワミクロン	4,600	2,842.00	13,073,200		
ユニオンツール	2,600	3,745.00	9,737,000	貸付株式数	900株
オイレス工業	11,600	1,643.00	19,058,800	貸付株式数	3,500株
日精エーエスビー	2,200	2,844.00	6,256,800	貸付株式数	800株
サト－ホールディングス	8,800	2,126.00	18,708,800		
技研製作所	5,900	4,130.00	24,367,000		
日本エアーテック	3,000	1,210.00	3,630,000	貸付株式数	900株
カ　ワ　タ	2,000	857.00	1,714,000		
日精樹脂工業	4,500	980.00	4,410,000	貸付株式数	700株
オカダアイヨン	1,800	1,417.00	2,550,600	貸付株式数	700株
ワイエイシイホールディングス	2,600	927.00	2,410,200		
小松製作所	304,800	2,592.00	790,041,600		
住友重機械	38,500	2,521.00	97,058,500		
日立建機	26,900	3,300.00	88,770,000		
日　工	8,500	610.00	5,185,000	貸付株式数	2,200株
巴工業	3,400	2,288.00	7,779,200	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,300	1,409.00	8,876,700		
ＴＯＷＡ	5,800	3,200.00	18,560,000	貸付株式数	800株
丸山製作所	1,200	1,456.00	1,747,200		

北川鉄工所	3,000	1,393.00	4,179,000		
シンニッタン	14,200	213.00	3,024,600		
ローツェ	3,300	11,950.00	39,435,000		
タカキタ	2,300	634.00	1,458,200	貸付株式数	900株
クボタ	328,200	2,369.00	777,505,800		
荏原実業	3,100	2,510.00	7,781,000		
東洋エンジニア	9,100	710.00	6,461,000	貸付株式数	3,100株
三菱化工機	2,100	2,265.00	4,756,500		
月島機械	12,000	1,068.00	12,816,000		
帝国電機製作所	4,500	1,391.00	6,259,500		
東京機械	3,400	1,222.00	4,154,800		
新東工業	13,600	677.00	9,207,200	貸付株式数	1,700株
渋谷工業	5,900	2,858.00	16,862,200		
アイチ　コーポレーション	9,100	779.00	7,088,900	貸付株式数	2,500株
小森コーポレーション	16,800	630.00	10,584,000	貸付株式数	6,700株
鶴見製作所	5,000	1,530.00	7,650,000		
住友精密	900	2,082.00	1,873,800		
日本ギア工業	2,400	274.00	657,600	貸付株式数	900株
酒井重工業	1,100	2,753.00	3,028,300		
荏原製作所	28,000	6,100.00	170,800,000	貸付株式数	11,100株
石井鉄工所	700	2,996.00	2,097,200		
酉島製作所	5,500	863.00	4,746,500	貸付株式数	900株
北越工業	6,000	946.00	5,676,000	貸付株式数	1,000株
ダイキン工業	85,800	23,150.00	1,986,270,000		
オルガノ	1,900	6,820.00	12,958,000	貸付株式数	400株
トーヨーカネツ	2,600	2,494.00	6,484,400		
栗田工業	36,700	5,300.00	194,510,000		
椿本チエイン	9,500	2,875.00	27,312,500	貸付株式数	1,200株
大同工業	2,800	852.00	2,385,600	貸付株式数	400株
日　機　装	21,500	848.00	18,232,000		
木村化工機	6,300	986.00	6,211,800	貸付株式数	2,100株
レイズネクスト	9,800	1,121.00	10,985,800		
アネスト岩田	10,100	854.00	8,625,400	貸付株式数	3,600株
ダイフク	37,000	9,090.00	336,330,000		
サムコ	1,700	2,911.00	4,948,700	貸付株式数	700株
加藤製作所	2,600	765.00	1,989,000	貸付株式数	700株
油研工業	700	1,715.00	1,200,500	貸付株式数	200株
タダノ	34,900	1,008.00	35,179,200		
フジテック	24,800	2,382.00	59,073,600		
ＣＫＤ	20,300	2,223.00	45,126,900		

キトー	5,600	1,754.00	9,822,400		
平和	18,700	1,848.00	34,557,600		
理想科学工業	5,700	2,022.00	11,525,400		
ＳＡＮＫＹＯ	14,500	2,894.00	41,963,000	貸付株式数	6,300株
日本金銭機械	6,600	688.00	4,540,800	貸付株式数	2,600株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,200	1,590.00	6,678,000		
フクシマガリレイ	4,700	4,180.00	19,646,000	貸付株式数	300株
オーイズミ	2,300	347.00	798,100	貸付株式数	200株
ダイコク電機	3,100	1,190.00	3,689,000	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	10,100	2,718.00	27,451,800	貸付株式数	900株
ア　マ　ノ	17,600	2,491.00	43,841,600	貸付株式数	6,700株
ＪＵＫＩ	9,200	919.00	8,454,800		
サンデンホールディングス	8,900	251.00	2,233,900	貸付株式数	100株
ジャノメ	5,600	622.00	3,483,200	貸付株式数	2,400株
ブラザー工業	82,100	1,954.00	160,423,400		
マックス	8,800	1,795.00	15,796,000	貸付株式数	100株
モリタホールディングス	10,500	1,273.00	13,366,500		
グローリー	17,400	2,075.00	36,105,000	貸付株式数	6,700株
新晃工業	6,500	1,831.00	11,901,500		
大和冷機工業	10,900	1,206.00	13,145,400		
セガサミーホールディングス	66,700	1,845.00	123,061,500		
日本ピストンリング	2,700	1,219.00	3,291,300	貸付株式数	900株
リ　ケ　ン	2,700	2,437.00	6,579,900	貸付株式数	700株
ＴＰＲ	8,800	1,368.00	12,038,400	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	15,000	1,370.00	20,550,000		
ホシザキ	19,700	8,620.00	169,814,000		
大豊工業	6,000	728.00	4,368,000		
日本精工	127,500	771.00	98,302,500		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	154,300	210.00	32,403,000		
ジェイテクト	66,400	992.00	65,868,800		
不　二　越	6,000	3,860.00	23,160,000		
ミネベアミツミ	116,000	3,000.00	348,000,000		
日本トムソン	21,600	691.00	14,925,600		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	40,000	2,711.00	108,440,000		
ユーシン精機	4,600	728.00	3,348,800		
前澤給装工業	5,100	1,001.00	5,105,100		
イーグル工業	8,500	1,025.00	8,712,500		
前澤工業	4,900	580.00	2,842,000		
日本ピラー工業	7,400	3,200.00	23,680,000	貸付株式数	2,600株

キッツ	26,500	701.00	18,576,500	貸付株式数	4,100株
日　立	323,800	6,688.00	2,165,574,400		
東　芝	117,600	4,527.00	532,375,200		
三菱電機	673,700	1,424.50	959,685,650		
富士電機	40,700	5,940.00	241,758,000		
東洋電機製造	3,200	1,050.00	3,360,000		
安川電機	72,400	5,090.00	368,516,000		
シンフォニア　テクノロジー	8,300	1,261.00	10,466,300	貸付株式数	3,000株
明　電　舎	11,600	2,588.00	30,020,800		
オリジン	1,300	1,262.00	1,640,600	貸付株式数	200株
山洋電気	3,000	5,670.00	17,010,000	貸付株式数	400株
デンヨー	6,100	1,657.00	10,107,700		
ベイカレントコンサルティング	4,500	47,300.00	212,850,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,200	3,970.00	4,764,000	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,600	1,281.00	3,330,600	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,300	1,073.00	2,467,900	貸付株式数	400株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,000	935.00	2,805,000	貸付株式数	900株
船場	1,200	790.00	948,000		
グレイステクノロジー	8,400	422.00	3,544,800	貸付株式数	3,300株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	20,400	2,125.00	43,350,000		
フルテック	1,600	1,410.00	2,256,000	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,800	488.00	1,366,400	貸付株式数	900株
ツナググループＨＬＤＧＳ	2,100	289.00	606,900	貸付株式数	600株
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	1,700	504.00	856,800	貸付株式数	100株
ソウルドアウト	1,500	997.00	1,495,500	貸付株式数	600株
ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	800	671.00	536,800	貸付株式数	100株
ミダックホールディングス	2,800	4,965.00	13,902,000	貸付株式数	1,100株
日総工産	5,300	808.00	4,282,400	貸付株式数	1,900株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,100	1,653.00	5,124,300		
ＲＰＡホールディングス	9,000	372.00	3,348,000	貸付株式数	3,600株
三桜工業	9,500	937.00	8,901,500	貸付株式数	3,600株
マキタ	81,900	4,984.00	408,189,600	貸付株式数	3,000株
東芝テック	7,300	4,355.00	31,791,500		
芝浦メカトロニクス	1,200	8,250.00	9,900,000		

マブチモーター	15,700	3,730.00	58,561,000	貸付株式数	6,200株
日本電産	174,500	13,000.00	2,268,500,000		
ユーエムシーエレクトロニクス	2,900	481.00	1,394,900	貸付株式数	600株
トレックス・セミコンダクター	3,400	3,785.00	12,869,000	貸付株式数	300株
東光高岳	4,000	1,304.00	5,216,000	貸付株式数	1,300株
ダブル・スコープ	19,300	829.00	15,999,700	貸付株式数	6,200株
宮越ホールディングス	2,700	1,203.00	3,248,100	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,500	4,300.00	32,250,000		
ヤーマン	11,500	1,008.00	11,592,000	貸付株式数	4,300株
ＪＶＣケンウッド	54,900	165.00	9,058,500	貸付株式数	5,100株
ミマキエンジニアリング	6,200	882.00	5,468,400		
Ｉ－ＰＥＸ	3,200	1,940.00	6,208,000	貸付株式数	500株
日新電機	16,000	1,417.00	22,672,000		
大崎電気	13,200	441.00	5,821,200	貸付株式数	1,900株
オムロン	56,300	10,965.00	617,329,500		
日東工業	9,500	1,487.00	14,126,500	貸付株式数	1,400株
ＩＤＥＣ	8,200	2,688.00	22,041,600	貸付株式数	1,000株
正興電機製作所	2,300	1,181.00	2,716,300	貸付株式数	800株
不二電機工業	1,000	1,257.00	1,257,000	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサ　コーポ	22,400	2,306.00	51,654,400		
サクサホールディングス	1,500	1,348.00	2,022,000		
メルコホールディングス	1,900	3,900.00	7,410,000	貸付株式数	700株
テクノメディカ	1,400	1,600.00	2,240,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリクＨＤ	1,900	1,291.00	2,452,900	貸付株式数	700株
日本電気	85,500	5,120.00	437,760,000		
富　士　通	60,600	18,795.00	1,138,977,000		
沖　電　気	27,400	838.00	22,961,200		
岩崎通信機	2,500	854.00	2,135,000		
電気興業	3,500	2,518.00	8,813,000		
サンケン電気	7,500	5,780.00	43,350,000		
ナカヨ	1,100	1,299.00	1,428,900		
アイホン	3,800	2,087.00	7,930,600		
ルネサスエレクトロニクス	364,400	1,442.00	525,464,800		
セイコーエプソン	83,500	1,830.00	152,805,000		
ワコム	52,200	874.00	45,622,800	貸付株式数	20,800株
アルバック	12,500	6,500.00	81,250,000		
アクセル	2,800	813.00	2,276,400	貸付株式数	1,100株

ＥＩＺＯ	5,200	3,940.00	20,488,000	貸付株式数	700株
ジャパンディスプレイ	61,700	37.00	2,282,900		
日本信号	18,000	861.00	15,498,000		
京三製作所	15,200	431.00	6,551,200		
能美防災	9,300	1,999.00	18,590,700		
ホーチキ	5,400	1,246.00	6,728,400		
星和電機	4,400	498.00	2,191,200		
エレコム	15,600	1,325.00	20,670,000		
パナソニック	718,200	1,242.50	892,363,500		
シャープ	76,800	1,270.00	97,536,000	貸付株式数	28,400株
アンリツ	43,300	1,765.00	76,424,500	貸付株式数	16,100株
富士通ゼネラル	18,300	2,580.00	47,214,000	貸付株式数	3,500株
ソニーグループ ※	421,700	13,825.00	5,830,002,500		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	97,500	4,500.00	438,750,000		
帝国通信工業	2,700	1,225.00	3,307,500	貸付株式数	1,000株
タムラ製作所	25,800	689.00	17,776,200	貸付株式数	9,800株
アルプスアルパイン	59,400	1,023.00	60,766,200		
池上通信機	2,000	703.00	1,406,000	貸付株式数	800株
日本電波工業	6,000	1,684.00	10,104,000	貸付株式数	100株
鈴木	2,900	914.00	2,650,600	貸付株式数	1,100株
日本トリム	1,300	3,360.00	4,368,000		
ローランド　ディー.ジー.	4,000	2,584.00	10,336,000	貸付株式数	1,500株
フオスター電機	6,600	703.00	4,639,800		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,500	2,281.00	3,421,500	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,900	2,684.00	13,151,600		
ティアック	11,200	123.00	1,377,600		
ホシデン	15,800	1,174.00	18,549,200	貸付株式数	2,000株
ヒロセ電機	10,400	19,050.00	198,120,000		
日本航空電子	15,800	1,815.00	28,677,000		
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,400	725.00	5,365,000	貸付株式数	1,000株
マクセル	13,400	1,309.00	17,540,600		
古野電気	8,000	1,146.00	9,168,000	貸付株式数	400株
ユニデンホールディングス	1,400	3,350.00	4,690,000		
スミダコーポレーション	6,200	1,122.00	6,956,400		
アイコム	2,400	2,310.00	5,544,000	貸付株式数	400株
リオン	2,600	2,135.00	5,551,000	貸付株式数	400株
本多通信工業	4,700	426.00	2,002,200	貸付株式数	1,700株
横河電機	67,200	2,135.00	143,472,000		
新電元工業	2,700	3,380.00	9,126,000		

アズビル	39,600	5,020.00	198,792,000		
東亜ディーケーケー	2,800	840.00	2,352,000	貸付株式数	1,100株
日本光電工業	27,800	3,345.00	92,991,000		
チ　ノ　ー	1,900	1,431.00	2,718,900	貸付株式数	700株
共和電業	6,600	388.00	2,560,800		
日本電子材料	3,300	2,194.00	7,240,200	貸付株式数	1,200株
堀場製作所	12,400	6,750.00	83,700,000		
アドバンテスト	50,000	9,990.00	499,500,000		
小野測器	2,300	488.00	1,122,400		
エスペック	5,300	2,103.00	11,145,900	貸付株式数	800株
キーエンス ※	61,000	70,330.00	4,290,130,000		
日置電機	3,300	8,860.00	29,238,000	貸付株式数	100株
シスメックス	56,900	14,160.00	805,704,000		
日本マイクロニクス	11,700	1,794.00	20,989,800	貸付株式数	3,400株
メガチップス	6,300	4,755.00	29,956,500	貸付株式数	1,700株
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,900	3,320.00	9,628,000	貸付株式数	1,400株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,600	787.00	4,407,200		
澤藤電機	800	1,692.00	1,353,600	貸付株式数	300株
デンソー	148,200	8,331.00	1,234,654,200		
原田工業	2,900	972.00	2,818,800		
コーセル	8,200	898.00	7,363,600		
イリソ電子工業	5,700	4,575.00	26,077,500	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	11,300	1,485.00	16,780,500		
千代田インテグレ	2,700	2,169.00	5,856,300		
アイ・オー・データ	2,400	775.00	1,860,000	貸付株式数	900株
レーザーテック	29,600	29,745.00	880,452,000		
スタンレー電気	46,900	2,952.00	138,448,800		
岩崎電気	2,600	2,246.00	5,839,600		
ウシオ電機	35,000	2,107.00	73,745,000		
岡谷電機	4,600	321.00	1,476,600	貸付株式数	200株
ヘリオステクノＨ	6,200	272.00	1,686,400		
エノモト	1,800	1,695.00	3,051,000		
日本セラミック	6,700	2,862.00	19,175,400	貸付株式数	2,400株
遠藤照明	3,300	1,023.00	3,375,900	貸付株式数	500株
古河電池	4,900	1,463.00	7,168,700	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	635.00	2,095,500		
山一電機	4,700	2,305.00	10,833,500		
図　研	4,600	3,735.00	17,181,000	貸付株式数	1,700株
日本電子	14,000	9,470.00	132,580,000		

カ　シ　オ	48,800	1,474.00	71,931,200		
ファナック	59,100	22,245.00	1,314,679,500		
日本シイエムケイ	12,800	504.00	6,451,200	貸付株式数	5,500株
エンプラス	1,700	2,521.00	4,285,700	貸付株式数	600株
大真空	10,000	1,570.00	15,700,000		
ロ　ー　ム	30,100	10,630.00	319,963,000		
浜松ホトニクス	48,300	6,980.00	337,134,000		
三井ハイテック	6,700	9,160.00	61,372,000		
新光電気工業	19,700	5,350.00	105,395,000	貸付株式数	100株
京　セ　ラ	94,700	6,731.00	637,425,700		
協栄産業	500	1,491.00	745,500		
太陽誘電	32,600	6,260.00	204,076,000		
村田製作所	197,700	8,380.00	1,656,726,000		
双葉電子工業	10,800	689.00	7,441,200		
日東電工	40,800	7,900.00	322,320,000		
北陸電気工業	2,200	1,266.00	2,785,200		
東海理化電機	17,500	1,484.00	25,970,000		
ニチコン	21,800	1,162.00	25,331,600		
日本ケミコン	6,300	1,801.00	11,346,300	貸付株式数	700株
Ｋ　Ｏ　Ａ	9,900	1,530.00	15,147,000		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	379.00	8,224,300		
日立造船	56,700	841.00	47,684,700		
三菱重工業	105,800	2,561.00	270,953,800		
川崎重工業	49,000	1,908.00	93,492,000		
ＩＨＩ	41,900	2,141.00	89,707,900		
名村造船所	21,900	201.00	4,401,900	貸付株式数	8,100株
サノヤスホールディングス	9,800	121.00	1,185,800	貸付株式数	1,300株
スプリックス	1,900	1,494.00	2,838,600		
マネジメントソリューションズ	3,400	3,260.00	11,084,000	貸付株式数	1,200株
プロレド・パートナーズ	1,700	1,152.00	1,958,400	貸付株式数	500株
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	1,200	419.00	502,800	貸付株式数	600株
ギークス	1,200	2,011.00	2,413,200		
カーブスホールディングス	18,200	774.00	14,086,800	貸付株式数	6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,300	829.00	3,564,700		
日本車輌	2,200	2,008.00	4,417,600		
三菱ロジスネクスト	9,100	1,027.00	9,345,700	貸付株式数	1,900株
近畿車輌	600	996.00	597,600	貸付株式数	200株
一家ホールディングス	1,500	541.00	811,500		

フルサト・マルカＨＤ	6,300	1,999.00	12,593,700	貸付株式数	2,500株
ヤマエグループＨＤ	4,500	1,003.00	4,513,500	貸付株式数	600株
ＦＰＧ	22,700	551.00	12,507,700	貸付株式数	2,900株
島根銀行	2,200	538.00	1,183,600	貸付株式数	300株
じもとホールディングス	5,000	585.00	2,925,000		
全国保証	15,900	4,960.00	78,864,000	貸付株式数	6,400株
めぶきフィナンシャルＧ	344,200	224.00	77,100,800		
東京きらぼしＦＧ	8,800	1,393.00	12,258,400		
九州フィナンシャルＧ	135,700	380.00	51,566,000		
かんぽ生命保険	66,800	1,758.00	117,434,400	貸付株式数	23,900株
ゆうちょ銀行	156,700	928.00	145,417,600	貸付株式数	37,600株
富山第一銀行	16,100	266.00	4,282,600		
コンコルディア・フィナンシャル	379,000	413.00	156,527,000		
ジェイリース	2,500	2,055.00	5,137,500	貸付株式数	500株
西日本フィナンシャルＨＤ	43,300	682.00	29,530,600		
イントラスト	3,100	725.00	2,247,500	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,900	1,038.00	4,048,200		
Ｃａｓａ	2,600	878.00	2,282,800	貸付株式数	900株
アルヒ	10,100	1,001.00	10,110,100	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,400	3,500.00	11,900,000		
日産自動車	793,500	562.90	446,661,150		
いすゞ自動車	211,000	1,532.00	323,252,000		
トヨタ自動車	3,409,900	2,001.00	6,823,209,900		
日野自動車	84,600	944.00	79,862,400		
三菱自動車工業	250,800	366.00	91,792,800	貸付株式数	19,800株
エフテック	5,300	496.00	2,628,800		
レシップホールディングス	2,900	550.00	1,595,000		
ＧＭＢ	1,600	703.00	1,124,800	貸付株式数	400株
ファルテック	1,000	665.00	665,000		
武蔵精密工業	15,400	1,772.00	27,288,800		
日産車体	9,500	676.00	6,422,000	貸付株式数	3,700株
新明和工業	19,500	845.00	16,477,500		
極東開発工業	12,100	1,402.00	16,964,200		
トピー工業	5,400	1,051.00	5,675,400		
ティラド	2,000	2,855.00	5,710,000	貸付株式数	300株
タチエス	11,600	1,144.00	13,270,400	貸付株式数	3,900株
Ｎ　Ｏ　Ｋ	32,400	1,214.00	39,333,600		
フタバ産業	16,300	385.00	6,275,500		
ＫＹＢ	6,900	2,904.00	20,037,600	貸付株式数	800株

市光工業	9,800	496.00	4,860,800		
大同メタル工業	12,200	568.00	6,929,600	貸付株式数	5,200株
プレス工業	33,300	373.00	12,420,900		
ミクニ	9,000	287.00	2,583,000		
太平洋工業	14,100	1,051.00	14,819,100		
河西工業	7,200	266.00	1,915,200	貸付株式数	1,200株
アイシン	49,200	4,170.00	205,164,000		
マ　ツ　ダ	211,900	918.00	194,524,200		
今仙電機製作所	4,100	551.00	2,259,100	貸付株式数	2,000株
本田技研 ※	529,900	3,101.00	1,643,219,900		
スズキ	153,900	4,585.00	705,631,500		
ＳＵＢＡＲＵ	192,600	2,142.50	412,645,500		
安永	3,200	963.00	3,081,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	87,800	2,859.00	251,020,200		
小糸製作所	36,900	6,530.00	240,957,000	貸付株式数	2,200株
ＴＢＫ	6,500	393.00	2,554,500	貸付株式数	900株
エクセディ	9,900	1,610.00	15,939,000		
ミツバ	12,700	459.00	5,829,300		
豊田合成	22,000	2,269.00	49,918,000		
愛三工業	10,600	761.00	8,066,600		
盟和産業	400	979.00	391,600	貸付株式数	300株
日本プラスト	4,700	495.00	2,326,500	貸付株式数	600株
ヨ　ロ　ズ	6,000	1,054.00	6,324,000	貸付株式数	2,200株
エフ・シー・シー	10,600	1,436.00	15,221,600		
新家工業	1,600	1,705.00	2,728,000		
シマノ	27,100	31,400.00	850,940,000		
テイ・エス　テック	28,000	1,333.00	37,324,000	貸付株式数	1,900株
３３ＦＧ	6,000	1,355.00	8,130,000		
第四北越フィナンシャルＧ	10,800	2,300.00	24,840,000	貸付株式数	600株
ひろぎんＨＬＤＧＳ	98,700	622.00	61,391,400	貸付株式数	600株
マーキュリアホールディングス	2,200	727.00	1,599,400		
おきなわＦＧ	5,800	2,066.00	11,982,800		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,600	4,190.00	23,464,000		
十六ＦＧ	8,900	1,976.00	17,586,400		
北國ＦＨＤ	6,200	2,114.00	13,106,800		
ジャムコ	3,800	827.00	3,142,600	貸付株式数	1,500株
小　野　建	6,100	1,572.00	9,589,200		
はるやまＨＬＤＧＳ	3,100	558.00	1,729,800		
南　陽	1,200	1,895.00	2,274,000		

ノ　ジ　マ	10,800	2,225.00	24,030,000	貸付株式数	700株
佐鳥電機	4,000	931.00	3,724,000		
カッパ・クリエイト	9,300	1,327.00	12,341,100	貸付株式数	3,700株
エコートレーディング	1,300	591.00	768,300	貸付株式数	400株
伯東	4,400	2,225.00	9,790,000		
コンドーテック	5,300	960.00	5,088,000		
中山福	3,300	358.00	1,181,400	貸付株式数	300株
ライトオン	5,000	695.00	3,475,000	貸付株式数	1,800株
ナガイレーベン	8,900	2,342.00	20,843,800	貸付株式数	2,300株
三菱食品	6,400	2,690.00	17,216,000	貸付株式数	1,400株
良品計画	76,300	1,835.00	140,010,500		
三城ホールディングス	7,900	235.00	1,856,500	貸付株式数	2,800株
松田産業	5,200	2,701.00	14,045,200		
第一興商	12,900	3,580.00	46,182,000	貸付株式数	1,300株
メディパルＨＤ	71,600	2,040.00	146,064,000		
アドヴァングループ	6,800	883.00	6,004,400	貸付株式数	400株
ＳＰＫ	2,500	1,300.00	3,250,000	貸付株式数	300株
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,400	1,992.00	4,780,800		
アルビス	2,100	2,114.00	4,439,400	貸付株式数	700株
アズワン	4,800	14,050.00	67,440,000		
スズデン	2,200	1,623.00	3,570,600		
尾家産業	1,800	1,046.00	1,882,800	貸付株式数	400株
シモジマ	4,200	1,079.00	4,531,800		
ドウシシャ	7,100	1,468.00	10,422,800	貸付株式数	500株
小津産業	1,200	1,901.00	2,281,200		
コナカ	7,800	311.00	2,425,800		
高速	3,900	1,473.00	5,744,700		
ハウス　ローゼ	800	1,661.00	1,328,800		
Ｇ－７ホールディングス	7,800	1,654.00	12,901,200		
たけびし	3,000	1,387.00	4,161,000		
イオン北海道	11,600	1,334.00	15,474,400	貸付株式数	4,600株
コ　ジ　マ	12,300	556.00	6,838,800	貸付株式数	4,400株
ヒマラヤ	2,200	914.00	2,010,800		
コーナン商事	9,600	3,320.00	31,872,000		
ネットワンシステムズ	25,200	3,410.00	85,932,000	貸付株式数	2,700株
エコス	2,500	1,748.00	4,370,000	貸付株式数	900株
ワタミ	8,200	850.00	6,970,000	貸付株式数	3,400株
マルシェ	1,500	402.00	603,000	貸付株式数	600株
リックス	3,400	1,443.00	4,906,200		
システムソフト	18,400	118.00	2,171,200	貸付株式数	2,700株

パンパシフィックＨＤ	132,600	1,936.00	256,713,600		
丸文	5,600	856.00	4,793,600		
西松屋チェーン	14,900	1,497.00	22,305,300	貸付株式数	5,800株
ゼンショーホールディングス	32,400	2,581.00	83,624,400	貸付株式数	300株
ハピネット	6,000	1,429.00	8,574,000	貸付株式数	100株
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,413.00	5,934,600	貸付株式数	1,600株
ハークスレイ	3,200	448.00	1,433,600		
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,400	1,910.00	2,674,000	貸付株式数	500株
日本ライフライン	19,500	1,058.00	20,631,000	貸付株式数	1,100株
サイゼリヤ	10,200	2,926.00	29,845,200	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,100	715.00	3,646,500	貸付株式数	2,000株
ＶＴホールディングス	25,200	421.00	10,609,200	貸付株式数	9,500株
アルゴグラフィックス	5,300	2,841.00	15,057,300		
魚力	1,900	1,952.00	3,708,800	貸付株式数	700株
ＩＤＯＭ	20,100	689.00	13,848,900	貸付株式数	3,300株
日本エム・ディ・エム	3,900	1,936.00	7,550,400		
ポプラ	1,800	174.00	313,200	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	3,600	1,164.00	4,190,400		
ユナイテッドアローズ	7,000	1,903.00	13,321,000	貸付株式数	2,100株
進和	3,700	1,940.00	7,178,000	貸付株式数	1,500株
エスケイジャパン	2,600	437.00	1,136,200		
ダイトロン	2,700	2,014.00	5,437,800		
ハイデイ日高	9,600	1,571.00	15,081,600	貸付株式数	3,800株
シークス	9,400	1,331.00	12,511,400	貸付株式数	3,700株
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　Ｈ	3,600	210.00	756,000	貸付株式数	400株
コロワイド	27,300	1,522.00	41,550,600	貸付株式数	10,900株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	7,900	321.00	2,535,900	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	621.00	1,304,100	貸付株式数	500株
オーハシテクニカ	3,500	1,469.00	5,141,500	貸付株式数	400株
壱番屋	4,700	4,435.00	20,844,500	貸付株式数	1,800株
白銅	2,000	2,355.00	4,710,000	貸付株式数	500株
トップカルチャー	2,500	300.00	750,000		
ＰＬＡＮＴ	1,600	697.00	1,115,200	貸付株式数	500株
スギホールディングス	13,300	7,140.00	94,962,000	貸付株式数	5,200株
ダイコー通産	800	1,174.00	939,200	貸付株式数	300株
薬王堂ホールディングス	3,300	2,138.00	7,055,400		
島津製作所	86,600	4,810.00	416,546,000		

ＪＭＳ	5,900	590.00	3,481,000	貸付株式数	2,100株
クボテック	1,000	285.00	285,000	貸付株式数	600株
長野計器	5,100	1,691.00	8,624,100		
ブイ・テクノロジー	2,900	3,445.00	9,990,500	貸付株式数	1,000株
スター精密	10,400	1,446.00	15,038,400		
東京計器	4,100	969.00	3,972,900	貸付株式数	1,600株
愛知時計	1,000	4,505.00	4,505,000		
インターアクション	3,400	2,325.00	7,905,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
オーバル	6,600	253.00	1,669,800		
東京精密	11,400	4,800.00	54,720,000		
マニー	26,800	1,660.00	44,488,000	貸付株式数	10,600株
ニコン	102,700	1,177.00	120,877,900		
トプコン	31,500	1,791.00	56,416,500	貸付株式数	3,300株
オリンパス	353,000	2,539.00	896,267,000		
理研計器	5,400	5,370.00	28,998,000	貸付株式数	700株
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,700	11,500.00	134,550,000		
キヤノン電子	6,200	1,486.00	9,213,200		
タムロン	5,600	2,523.00	14,128,800	貸付株式数	2,000株
ＨＯＹＡ	131,400	18,020.00	2,367,828,000		
シ　ー　ド	2,900	561.00	1,626,900	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	6,200	2,743.00	17,006,600		
エー・アンド・デイ	6,100	1,118.00	6,819,800		
朝日インテック	73,800	2,488.00	183,614,400		
キヤノン	334,500	2,500.00	836,250,000		
リ　コ　ー	186,900	1,003.00	187,460,700		
シチズン時計	78,400	519.00	40,689,600		
リズム	2,000	1,190.00	2,380,000	貸付株式数	600株
大研医器	5,000	545.00	2,725,000		
メニコン	22,300	3,755.00	83,736,500	貸付株式数	8,900株
シンシア	800	554.00	443,200	貸付株式数	200株
中本パックス	1,800	1,595.00	2,871,000	貸付株式数	700株
スノーピーク	9,000	3,875.00	34,875,000	貸付株式数	1,700株
パラマウントベッドＨＤ	12,800	1,931.00	24,716,800		
トランザクション	4,500	967.00	4,351,500	貸付株式数	1,400株
粧美堂	1,900	384.00	729,600	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	5,800	1,065.00	6,177,000	貸付株式数	200株
前田工繊	7,600	3,510.00	26,676,000	貸付株式数	2,000株
永大産業	8,800	272.00	2,393,600		

アートネイチャー	6,000	646.00	3,876,000	貸付株式数	1,100株
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	60,300	8,837.00	532,871,100		
アイフィスジャパン	1,800	646.00	1,162,800	貸付株式数	700株
共立印刷	9,700	141.00	1,367,700	貸付株式数	400株
ＳＨＯＥＩ	6,500	4,800.00	31,200,000		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,800	853.00	8,359,400	貸付株式数	3,400株
マーベラス	10,400	716.00	7,446,400		
パイロットコーポレーション	11,300	4,145.00	46,838,500	貸付株式数	4,500株
萩原工業	4,300	1,326.00	5,701,800	貸付株式数	1,500株
エイベックス	11,700	1,695.00	19,831,500		
トッパン・フォームズ	9,300	1,546.00	14,377,800	貸付株式数	3,700株
フジシールインターナショナル	16,300	2,058.00	33,545,400	貸付株式数	4,700株
タカラトミー	28,000	999.00	27,972,000	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,200	819.00	3,439,800	貸付株式数	1,300株
エステールホールディングス	1,300	636.00	826,800	貸付株式数	700株
レック	8,800	819.00	7,207,200		
タカノ	2,100	640.00	1,344,000	貸付株式数	800株
三光合成	8,500	374.00	3,179,000	貸付株式数	300株
プロネクサス	5,300	1,015.00	5,379,500		
ホクシン	6,900	156.00	1,076,400		
ウッドワン	2,000	952.00	1,904,000	貸付株式数	200株
大建工業	4,000	2,158.00	8,632,000	貸付株式数	800株
き　も　と	12,700	210.00	2,667,000		
凸版印刷	102,100	1,723.00	175,918,300		
大日本印刷	79,400	2,663.00	211,442,200		
共同印刷	1,900	2,761.00	5,245,900		
ＮＩＳＳＨＡ	13,800	1,578.00	21,776,400		
光村印刷	600	1,475.00	885,000	貸付株式数	200株
藤森工業	6,000	3,580.00	21,480,000		
ヴィア・ホールディングス	8,500	153.00	1,300,500		
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,300	1,731.00	5,712,300	貸付株式数	1,200株
前澤化成工業	4,500	1,251.00	5,629,500	貸付株式数	1,600株
未来工業	2,500	1,616.00	4,040,000		
アシックス	59,700	2,818.00	168,234,600		
ツ　ツ　ミ	1,700	2,070.00	3,519,000	貸付株式数	600株
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	706.00	1,623,800	貸付株式数	900株

ジェイ　エス　ピー	3,700	1,515.00	5,605,500	貸付株式数	1,400株
ニ　チ　ハ	9,400	2,791.00	26,235,400		
エフピコ	12,500	3,745.00	46,812,500		
小松ウオール工業	2,000	1,846.00	3,692,000		
ヤマハ	40,000	5,820.00	232,800,000		
河合楽器	1,900	3,210.00	6,099,000		
クリナップ	6,300	512.00	3,225,600		
ピジョン	40,800	2,301.00	93,880,800	貸付株式数	16,200株
天馬	6,300	2,402.00	15,132,600		
兼松サステック	500	1,788.00	894,000		
キングジム	5,700	853.00	4,862,100		
象印マホービン	18,300	1,591.00	29,115,300		
リンテック	16,500	2,500.00	41,250,000		
信越ポリマー	11,700	951.00	11,126,700		
東　リ	16,500	219.00	3,613,500		
イトーキ	12,900	342.00	4,411,800		
任　天　堂	38,000	50,100.00	1,903,800,000		
三菱鉛筆	11,000	1,213.00	13,343,000	貸付株式数	500株
松　風	2,700	2,027.00	5,472,900	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	14,000	1,366.00	19,124,000	貸付株式数	200株
コ　ク　ヨ	32,500	1,656.00	53,820,000		
ナカバヤシ	5,800	499.00	2,894,200	貸付株式数	600株
ニ　フ　コ	23,100	3,120.00	72,072,000		
立川ブラインド	3,200	1,090.00	3,488,000	貸付株式数	1,100株
グローブライド	6,000	3,460.00	20,760,000	貸付株式数	700株
オカムラ	23,600	1,275.00	30,090,000		
バルカー	7,200	2,442.00	17,582,400		
ＭＵＴＯＨホールディングス	900	1,648.00	1,483,200		
伊　藤　忠	465,300	3,260.00	1,516,878,000		
丸　紅	654,000	1,017.50	665,445,000		
スクロール	10,200	767.00	7,823,400		
高　島	1,000	2,147.00	2,147,000	貸付株式数	100株
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,595.00	9,889,000	貸付株式数	2,400株
三陽商会	3,200	823.00	2,633,600	貸付株式数	900株
長瀬産業	36,000	1,683.00	60,588,000		
ナイガイ	2,700	310.00	837,000	貸付株式数	700株
蝶　理	3,600	1,712.00	6,163,200	貸付株式数	800株
豊田通商	66,900	4,955.00	331,489,500		

オンワードホールディングス	41,800	288.00	12,038,400	貸付株式数	15,700株
三共生興	8,500	547.00	4,649,500	貸付株式数	1,900株
兼　松	25,900	1,231.00	31,882,900	貸付株式数	900株
美　津　濃	6,800	2,131.00	14,490,800		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,360.00	1,496,000		
ルックホールディングス	2,100	1,290.00	2,709,000	貸付株式数	800株
三井物産	516,000	2,557.00	1,319,412,000		
日本紙パルプ	3,300	3,575.00	11,797,500		
東京エレクトロン	42,700	59,840.00	2,555,168,000		
カメイ	7,800	992.00	7,737,600	貸付株式数	1,100株
東都水産	400	4,500.00	1,800,000		
ＯＵＧホールディングス	1,000	2,525.00	2,525,000	貸付株式数	400株
スターゼン	5,000	1,844.00	9,220,000		
セイコーＨＤ	9,700	2,198.00	21,320,600		
山　善	29,200	972.00	28,382,400	貸付株式数	1,900株
椿本興業	1,500	3,880.00	5,820,000		
住友商事	420,700	1,546.00	650,402,200		
日本ユニシス	20,600	3,280.00	67,568,000	貸付株式数	1,600株
内田洋行	2,800	4,635.00	12,978,000		
三菱商事	497,900	3,391.00	1,688,378,900		
第一実業	3,300	4,890.00	16,137,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	16,400	2,200.00	36,080,000		
西華産業	3,300	1,507.00	4,973,100		
佐藤商事	5,100	1,063.00	5,421,300		
菱洋エレクトロ	3,900	2,249.00	8,771,100	貸付株式数	1,500株
東京産業	6,600	739.00	4,877,400	貸付株式数	2,000株
ユアサ商事	6,600	2,797.00	18,460,200	貸付株式数	700株
神鋼商事	1,700	3,145.00	5,346,500		
トルク	9,200	207.00	1,904,400	貸付株式数	3,000株
阪和興業	13,500	3,070.00	41,445,000		
正栄食品	4,300	3,775.00	16,232,500	貸付株式数	1,700株
カナデン	6,900	986.00	6,803,400		
菱電商事	6,300	1,677.00	10,565,100	貸付株式数	1,600株
ニプロ	49,900	1,075.00	53,642,500	貸付株式数	12,200株
岩谷産業	16,100	5,730.00	92,253,000		
ナイス	2,500	1,612.00	4,030,000		
ニチモウ	1,000	2,029.00	2,029,000	貸付株式数	100株
極東貿易	2,100	2,332.00	4,897,200	貸付株式数	700株

アステナホールディングス	10,800	486.00	5,248,800		
兼松エレクトロニクス	3,600	3,600.00	12,960,000		
三愛石油	16,300	1,184.00	19,299,200		
稲畑産業	15,600	1,529.00	23,852,400	貸付株式数	2,000株
ＧＳＩクレオス	3,200	1,021.00	3,267,200	貸付株式数	1,200株
明和産業	6,400	819.00	5,241,600	貸付株式数	2,400株
クワザワホールディングス	2,700	572.00	1,544,400	貸付株式数	900株
ゴールドウイン	11,900	6,450.00	76,755,000		
ユニ・チャーム	129,800	4,888.00	634,462,400		
デサント	12,900	4,610.00	59,469,000		
キ　ン　グ	3,200	550.00	1,760,000	貸付株式数	100株
ワ　キ　タ	13,800	1,026.00	14,158,800		
ヤマトインターナシヨナル	5,800	302.00	1,751,600	貸付株式数	2,200株
東邦ホールディングス	21,400	1,692.00	36,208,800	貸付株式数	8,300株
サンゲツ	17,600	1,519.00	26,734,400	貸付株式数	100株
ミツウロコグループ	9,900	1,165.00	11,533,500		
シナネンホールディングス	2,500	3,420.00	8,550,000	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,900	951.00	14,169,900		
サンリオ	20,500	2,479.00	50,819,500	貸付株式数	500株
サンワ　テクノス	3,900	1,675.00	6,532,500	貸付株式数	500株
リョーサン	7,200	2,108.00	15,177,600		
新光商事	9,500	873.00	8,293,500	貸付株式数	3,600株
トーホー	3,100	1,375.00	4,262,500	貸付株式数	1,200株
三信電気	2,900	1,395.00	4,045,500		
東陽テクニカ	6,900	1,077.00	7,431,300		
モスフード　サービス	8,700	3,055.00	26,578,500	貸付株式数	1,000株
加賀電子	6,200	2,932.00	18,178,400		
三益半導体	5,200	2,341.00	12,173,200		
ソーダニツカ	6,400	676.00	4,326,400		
立花エレテック	5,100	1,519.00	7,746,900	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,700	2,088.00	18,165,600	貸付株式数	3,400株
ＳＲＳホールディングス	9,100	742.00	6,752,200	貸付株式数	3,600株
千　趣　会	11,900	388.00	4,617,200	貸付株式数	4,700株
タカキユー	7,300	122.00	890,600	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	8,000	1,212.00	9,696,000	貸付株式数	3,200株
ケーヨー	12,300	803.00	9,876,900		
上新電機	7,600	2,048.00	15,564,800		
日本瓦斯	32,600	1,417.00	46,194,200		
ロイヤルホールディングス	11,600	1,819.00	21,100,400	貸付株式数	4,500株
東　天　紅	500	1,001.00	500,500		

いなげや	8,100	1,301.00	10,538,100	貸付株式数	2,900株
チヨダ	6,400	702.00	4,492,800	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	6,200	3,355.00	20,801,000		
リンガーハット	8,200	2,136.00	17,515,200	貸付株式数	3,200株
ＭｒＭａｘＨＤ	8,300	529.00	4,390,700	貸付株式数	3,500株
テンアライド	6,600	308.00	2,032,800	貸付株式数	2,600株
ＡＯＫＩホールディングス	13,300	614.00	8,166,200	貸付株式数	2,400株
オークワ	10,200	955.00	9,741,000	貸付株式数	4,000株
コメリ	10,200	2,444.00	24,928,800		
青山商事	13,700	719.00	9,850,300	貸付株式数	2,900株
しまむら	7,700	9,700.00	74,690,000		
はせがわ	3,400	230.00	782,000	貸付株式数	600株
高　島　屋	49,200	995.00	48,954,000		
松　屋	13,300	838.00	11,145,400	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	32,500	790.00	25,675,000	貸付株式数	12,400株
近鉄百貨店	2,500	2,428.00	6,070,000	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	56,400	2,086.00	117,650,400		
クレディセゾン	42,800	1,124.00	48,107,200		
アクシアル　リテイリング	5,100	3,260.00	16,626,000	貸付株式数	2,100株
井　筒　屋	3,100	309.00	957,900	貸付株式数	1,200株
イオン	255,100	2,644.50	674,611,950		
イ　ズ　ミ	11,900	3,145.00	37,425,500	貸付株式数	4,700株
フオーバル	3,000	991.00	2,973,000		
平　和　堂	12,200	1,853.00	22,606,600	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	8,000	1,920.00	15,360,000	貸付株式数	3,200株
ヤオコー	7,500	6,690.00	50,175,000	貸付株式数	2,900株
ゼビオホールディングス	9,000	879.00	7,911,000	貸付株式数	2,900株
ケーズホールディングス	61,200	1,149.00	70,318,800		
ＰＡＬＴＡＣ	9,300	4,405.00	40,966,500	貸付株式数	2,000株
三谷産業	9,400	297.00	2,791,800	貸付株式数	1,500株
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,400	611.00	2,077,400	貸付株式数	700株
日産東京販売ＨＤ	8,900	225.00	2,002,500		
新生銀行	43,300	1,916.00	82,962,800		
あおぞら銀行	37,000	2,472.00	91,464,000		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,258,400	601.40	2,561,001,760		
りそなホールディングス	760,700	415.60	316,146,920		
三井住友トラストＨＤ	125,500	3,560.00	446,780,000		

三井住友フィナンシャルG ※	459,700	3,703.00	1,702,269,100		
千葉銀行	221,500	661.00	146,411,500		
群馬銀行	127,200	331.00	42,103,200	貸付株式数	13,600株
武蔵野銀行	9,900	1,558.00	15,424,200	貸付株式数	3,800株
千葉興業銀行	15,800	245.00	3,871,000	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	26,200	157.00	4,113,400	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	20,600	1,156.00	23,813,600	貸付株式数	7,900株
青森銀行	5,100	1,593.00	8,124,300		
秋田銀行	4,200	1,430.00	6,006,000		
山形銀行	7,400	811.00	6,001,400		
岩手銀行	4,400	1,610.00	7,084,000		
東邦銀行	54,800	194.00	10,631,200	貸付株式数	22,600株
東北銀行	3,100	964.00	2,988,400		
みちのく銀行	4,500	731.00	3,289,500		
ふくおかフィナンシャルG	55,900	1,838.00	102,744,200		
静岡銀行	161,800	800.00	129,440,000		
スルガ銀行	63,000	471.00	29,673,000		
八十二銀行	149,300	356.00	53,150,800		
山梨中央銀行	6,900	788.00	5,437,200	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	13,200	1,771.00	23,377,200	貸付株式数	2,600株
福井銀行	5,900	1,332.00	7,858,800		
清水銀行	2,800	1,516.00	4,244,800		
富山銀行	1,200	1,696.00	2,035,200	貸付株式数	100株
滋賀銀行	12,400	1,751.00	21,712,400	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,200	1,790.00	18,258,000	貸付株式数	400株
百五銀行	63,600	318.00	20,224,800		
京都銀行	23,900	4,825.00	115,317,500		
紀陽銀行	23,400	1,359.00	31,800,600		
ほくほくフィナンシャルG	41,300	770.00	31,801,000	貸付株式数	4,100株
山陰合同銀行	39,300	564.00	22,165,200	貸付株式数	3,600株
中国銀行	53,100	836.00	44,391,600	貸付株式数	6,100株
鳥取銀行	2,000	1,102.00	2,204,000		
伊予銀行	88,300	524.00	46,269,200	貸付株式数	32,800株
百十四銀行	6,900	1,350.00	9,315,000		
四国銀行	9,700	704.00	6,828,800	貸付株式数	3,700株
阿波銀行	10,200	2,035.00	20,757,000		
大分銀行	3,900	1,680.00	6,552,000	貸付株式数	400株
宮崎銀行	4,100	1,952.00	8,003,200		
佐賀銀行	3,700	1,408.00	5,209,600	貸付株式数	200株

琉球銀行	14,600	712.00	10,395,200		
セブン銀行	196,900	228.00	44,893,200	貸付株式数	88,100株
みずほフィナンシャルG	849,700	1,402.00	1,191,279,400		
高知銀行	2,500	719.00	1,797,500		
山口フィナンシャルG	77,000	621.00	47,817,000	貸付株式数	8,300株
芙蓉総合リース	7,000	7,180.00	50,260,000		
みずほリース	10,500	2,964.00	31,122,000	貸付株式数	3,900株
東京センチュリー	12,900	5,420.00	69,918,000	貸付株式数	6,100株
ＳＢＩホールディングス	81,900	2,924.00	239,475,600	貸付株式数	32,600株
日本証券金融	26,300	814.00	21,408,200		
アイフル	113,800	352.00	40,057,600		
日本アジア投資	5,900	187.00	1,103,300	貸付株式数	500株
長野銀行	2,200	1,100.00	2,420,000		
名古屋銀行	4,900	2,193.00	10,745,700	貸付株式数	600株
北洋銀行	101,200	231.00	23,377,200	貸付株式数	12,700株
愛知銀行	2,400	3,505.00	8,412,000		
中京銀行	2,600	1,185.00	3,081,000		
大光銀行	2,300	1,266.00	2,911,800		
愛媛銀行	9,300	720.00	6,696,000		
トマト銀行	2,300	1,005.00	2,311,500	貸付株式数	300株
京葉銀行	28,000	422.00	11,816,000	貸付株式数	10,000株
栃木銀行	31,700	174.00	5,515,800		
北日本銀行	2,100	1,414.00	2,969,400	貸付株式数	700株
東和銀行	12,200	480.00	5,856,000		
福島銀行	7,700	202.00	1,555,400		
大東銀行	3,100	656.00	2,033,600		
リコーリース	6,000	3,615.00	21,690,000	貸付株式数	2,000株
イオンフィナンシャルサービス	36,100	1,227.00	44,294,700	貸付株式数	3,800株
ア　コ　ム	132,000	337.00	44,484,000	貸付株式数	50,900株
ジャックス	7,700	2,753.00	21,198,100		
オ　リ　コ	181,600	124.00	22,518,400		
オリックス	403,000	2,245.00	904,735,000		
三菱ＨＣキャピタル	246,300	534.00	131,524,200		
ジャフコ　グループ	8,700	7,120.00	61,944,000		
九州　リースサービス	3,300	566.00	1,867,800	貸付株式数	500株
トモニホールディングス	51,200	291.00	14,899,200	貸付株式数	900株
大和証券G本社	497,100	630.90	313,620,390		
野村ホールディングス	1,013,000	477.40	483,606,200		
岡三証券グループ	52,000	369.00	19,188,000	貸付株式数	6,600株

丸三証券	19,700	499.00	9,830,300		
東洋証券	21,700	143.00	3,103,100	貸付株式数	8,600株
東海東京ＨＤ	75,500	372.00	28,086,000	貸付株式数	30,200株
光世証券	1,400	500.00	700,000	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	269.00	4,788,200	貸付株式数	5,000株
いちよし証券	12,400	619.00	7,675,600	貸付株式数	5,200株
松井証券	32,500	781.00	25,382,500		
ＳＯＭＰＯホールディングス	117,000	4,674.00	546,858,000		
日本取引所グループ	168,300	2,459.00	413,849,700		
マネックスＧ	54,100	931.00	50,367,100		
極東証券	8,900	732.00	6,514,800	貸付株式数	1,700株
岩井コスモホールディング	6,300	1,292.00	8,139,600	貸付株式数	800株
アイザワ証券グループ	11,000	986.00	10,846,000	貸付株式数	2,900株
フィデアホール	5,900	1,197.00	7,062,300	貸付株式数	200株
池田泉州ＨＤ	74,900	149.00	11,160,100	貸付株式数	29,900株
アニコム　ホールディングス	20,500	777.00	15,928,500		
ＭＳ＆ＡＤ	148,900	3,316.00	493,752,400	貸付株式数	44,000株
マネーパートナーズＧＰ	9,100	218.00	1,983,800		
スパークス・グループ	31,600	312.00	9,859,200	貸付株式数	12,100株
小林洋行	2,300	246.00	565,800		
第一生命ＨＬＤＧＳ	326,800	2,287.00	747,391,600		
東京海上ＨＤ	218,700	5,708.00	1,248,339,600		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	657.00	2,168,100	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	9,800	2,457.00	24,078,600		
アサックス	4,200	684.00	2,872,800	貸付株式数	1,100株
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,000	1,914.00	5,742,000		
Ｔ＆Ｄホールディングス	172,400	1,342.00	231,360,800		
アドバンスクリエイト	3,200	981.00	3,139,200	貸付株式数	1,100株
三井不動産	302,300	2,336.00	706,172,800		
三菱地所	435,500	1,565.00	681,557,500		
平和不動産	11,500	3,400.00	39,100,000		
東京建物	65,400	1,608.00	105,163,200		
ダイビル	16,900	1,464.00	24,741,600	貸付株式数	400株
京阪神ビルディング	10,500	1,377.00	14,458,500		
住友不動産	139,100	3,539.00	492,274,900		
太平洋興発	2,200	591.00	1,300,200	貸付株式数	200株
テーオーシー	12,100	556.00	6,727,600	貸付株式数	3,300株

東京楽天地	1,000	3,980.00	3,980,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	8,800	2,429.00	21,375,200		
フジ住宅	7,700	664.00	5,112,800		
空港施設	7,200	525.00	3,780,000		
明和地所	3,400	550.00	1,870,000		
ゴールドクレスト	4,700	1,492.00	7,012,400	貸付株式数	2,300株
リログループ	35,200	2,093.00	73,673,600		
エスリード	2,500	1,599.00	3,997,500	貸付株式数	1,000株
日神グループＨＬＤＧＳ	9,300	465.00	4,324,500	貸付株式数	4,100株
日本エスコン	13,100	750.00	9,825,000		
タカラレーベン	29,300	266.00	7,793,800	貸付株式数	11,200株
ＡＶＡＮＴＩＡ	2,800	828.00	2,318,400	貸付株式数	600株
イオンモール	33,100	1,607.00	53,191,700	貸付株式数	13,200株
毎日コムネット	2,700	727.00	1,962,900		
ファースト住建	2,900	1,184.00	3,433,600	貸付株式数	900株
ランド	371,200	11.00	4,083,200	貸付株式数	119,600株
カチタス	16,400	4,190.00	68,716,000		
東祥	4,900	1,674.00	8,202,600	貸付株式数	1,500株
トーセイ	9,300	963.00	8,955,900	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,100	1,865.00	2,051,500	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	8,500	958.00	8,143,000		
インテリックス	900	654.00	588,600		
ランドビジネス	2,300	247.00	568,100		
サンネクスタグループ	2,300	1,005.00	2,311,500	貸付株式数	800株
グランディハウス	5,200	458.00	2,381,600		
東武鉄道	65,800	2,565.00	168,777,000		
相鉄ホールディングス	21,400	1,975.00	42,265,000	貸付株式数	2,300株
東急	169,800	1,571.00	266,755,800		
京浜急行	86,300	1,122.00	96,828,600		
小田急電鉄	100,100	2,187.00	218,918,700		
京王電鉄	34,900	5,110.00	178,339,000		
京成電鉄	46,900	3,110.00	145,859,000		
富士急行	8,100	4,105.00	33,250,500	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,600	1,970.00	3,152,000	貸付株式数	300株
東日本旅客鉄道	118,500	6,986.00	827,841,000		
西日本旅客鉄道	81,600	4,898.00	399,676,800		
東海旅客鉄道	56,000	15,600.00	873,600,000		
西武ホールディングス	87,800	1,085.00	95,263,000	貸付株式数	32,300株
鴻池運輸	10,600	1,089.00	11,543,400		
西日本鉄道	18,600	2,544.00	47,318,400		

ハマキョウレックス	4,700	2,850.00	13,395,000	貸付株式数	600株
サカイ引越センター	3,100	4,195.00	13,004,500	貸付株式数	500株
近鉄グループＨＬＤＧＳ	63,700	3,260.00	207,662,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	79,600	3,365.00	267,854,000	貸付株式数	2,800株
南海電鉄	28,400	2,032.00	57,708,800	貸付株式数	11,900株
京阪ホールディングス	28,300	2,548.00	72,108,400		
神戸電鉄	1,500	3,205.00	4,807,500	貸付株式数	500株
名古屋鉄道	52,400	1,660.00	86,984,000	貸付株式数	3,800株
山陽電鉄	4,700	1,930.00	9,071,000	貸付株式数	1,700株
トランコム	1,800	8,050.00	14,490,000	貸付株式数	700株
日本通運	22,100	6,470.00	142,987,000		
ヤマトホールディングス	89,300	2,504.00	223,607,200		
山　九	17,600	4,510.00	79,376,000		
日　新	5,000	1,523.00	7,615,000		
丸　運	4,300	250.00	1,075,000	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,165.00	16,458,000		
センコーグループＨＬＤＧＳ	32,300	926.00	29,909,800	貸付株式数	13,900株
トナミホールディングス	1,500	3,520.00	5,280,000		
ニッコンホールディングス	21,300	1,983.00	42,237,900		
日石輸送	600	2,607.00	1,564,200		
福山通運	10,500	3,760.00	39,480,000		
セイノーホールディングス	43,300	1,147.00	49,665,100	貸付株式数	8,200株
エスライン	1,800	900.00	1,620,000		
神奈川中央交通	1,600	3,220.00	5,152,000		
日立物流	12,300	4,630.00	56,949,000	貸付株式数	200株
丸和運輸機関	13,800	1,380.00	19,044,000	貸付株式数	5,300株
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,500	1,502.00	9,763,000		
日本郵船	53,400	7,400.00	395,160,000		
商船三井	35,300	6,500.00	229,450,000		
川崎汽船	19,800	4,870.00	96,426,000		
ＮＳユナイテッド海運	3,500	3,230.00	11,305,000		
明治海運	7,500	686.00	5,145,000	貸付株式数	3,000株
飯野海運	29,300	517.00	15,148,100	貸付株式数	3,900株
共栄タンカー	1,100	819.00	900,900	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	49,500	2,395.00	118,552,500		
ＳＧホールディングス	120,500	2,510.00	302,455,000		
日本航空	146,200	2,056.00	300,587,200		
ＡＮＡホールディングス	162,000	2,239.50	362,799,000		

パスコ	1,100	1,298.00	1,427,800		
ＴＲＥホールディングス	8,800	1,775.00	15,620,000	貸付株式数	100株
人・夢・技術グループ	2,600	1,813.00	4,713,800		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,500	3,220.00	4,830,000	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,500	1,287.00	1,930,500	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	900	1,985.00	1,786,500	貸付株式数	200株
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,900	5,120.00	14,848,000	貸付株式数	800株
国際紙パルプ商事	15,900	311.00	4,944,900		
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,038.00	1,660,800	貸付株式数	500株
ブックオフＧＨＤ	3,800	970.00	3,686,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,100	2,774.00	55,757,400		
三井倉庫ＨＯＬＤ	6,900	2,280.00	15,732,000		
住友倉庫	22,500	1,817.00	40,882,500	貸付株式数	400株
渋沢倉庫	3,800	2,097.00	7,968,600		
ヤマタネ	2,900	1,516.00	4,396,400		
東陽倉庫	10,600	305.00	3,233,000	貸付株式数	300株
乾汽船	4,500	2,009.00	9,040,500	貸付株式数	1,700株
日本トランスシティ	14,000	554.00	7,756,000		
ケイヒン	1,000	1,279.00	1,279,000	貸付株式数	200株
中央倉庫	3,500	934.00	3,269,000		
川西倉庫	1,200	1,067.00	1,280,400	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,000	930.00	4,650,000		
ファイズホールディングス	1,400	552.00	772,800	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,900	1,407.00	2,673,300		
宇徳	5,400	516.00	2,786,400		
上　組	35,000	2,099.00	73,465,000		
サンリツ	1,900	797.00	1,514,300	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,500	1,173.00	1,759,500	貸付株式数	400株
キユーソー流通システム	3,000	882.00	2,646,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	12,000	2,728.00	32,736,000	貸付株式数	400株
東海運	3,600	298.00	1,072,800	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,100	1,139.00	4,669,900		
内外トランスライン	2,700	1,826.00	4,930,200	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,500	687.00	1,717,500	貸付株式数	600株
日本コンセプト	2,100	1,644.00	3,452,400	貸付株式数	800株
ＴＢＳホールディングス	40,200	1,715.00	68,943,000	貸付株式数	5,500株

日本テレビＨＬＤＳ	55,400	1,150.00	63,710,000		
朝日放送グループＨＤ	6,400	682.00	4,364,800		
テレビ朝日ＨＤ	16,000	1,492.00	23,872,000	貸付株式数	8,100株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	56,300	405.00	22,801,500	貸付株式数	22,400株
テレビ東京ＨＤ	4,800	2,027.00	9,729,600		
日本ＢＳ放送	2,400	1,102.00	2,644,800	貸付株式数	900株
ビジョン	11,900	1,319.00	15,696,100		
スマートバリュー	1,800	500.00	900,000	貸付株式数	600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	6,800	3,235.00	21,998,000	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	2,900	324.00	939,600	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,600	1,407.00	6,472,200		
日本通信	55,100	270.00	14,877,000	貸付株式数	5,100株
クロップス	1,100	1,109.00	1,219,900	貸付株式数	400株
日本電信電話	772,600	3,125.00	2,414,375,000		
ＫＤＤＩ	481,600	3,300.00	1,589,280,000		
ソフトバンク	1,000,600	1,562.50	1,563,437,500		
光通信	7,800	16,460.00	128,388,000		
エムティーアイ	7,600	584.00	4,438,400	貸付株式数	2,500株
ＧＭＯインターネット	23,700	2,858.00	67,734,600	貸付株式数	9,000株
ファイバーゲート	2,200	1,079.00	2,373,800	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコミュ	1,000	313.00	313,000	貸付株式数	600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	19,300	6,020.00	116,186,000		
学研ホールディングス	9,600	978.00	9,388,800	貸付株式数	3,700株
ゼンリン	10,900	935.00	10,191,500	貸付株式数	4,600株
昭文社ホールディングス	2,700	478.00	1,290,600	貸付株式数	1,000株
インプレスホールディングス	8,900	210.00	1,869,000		
東京電力ＨＤ	503,800	303.00	152,651,400	貸付株式数	94,500株
中部電力	205,400	1,146.00	235,388,400		
関西電力	254,700	1,027.00	261,576,900		
中国電力	104,800	891.00	93,376,800		
北陸電力	62,400	563.00	35,131,200		
東北電力	156,800	786.00	123,244,800	貸付株式数	11,300株
四国電力	60,200	755.00	45,451,000		
九州電力	138,300	811.00	112,161,300	貸付株式数	5,200株
北海道電力	58,100	469.00	27,248,900	貸付株式数	22,400株
沖縄電力	13,900	1,389.00	19,307,100		
電源開発	57,200	1,445.00	82,654,000		

エフオン	4,500	655.00	2,947,500	貸付株式数	200株
イーレックス	10,200	2,558.00	26,091,600		
レノバ	13,100	5,350.00	70,085,000		
東京瓦斯	129,100	1,945.00	251,099,500		
大阪瓦斯	121,800	1,827.00	222,528,600		
東邦瓦斯	30,900	3,205.00	99,034,500		
北海道瓦斯	3,100	1,471.00	4,560,100	貸付株式数	400株
広島ガス	11,700	351.00	4,106,700	貸付株式数	1,600株
西部ガスＨＬＤＧＳ	7,400	2,120.00	15,688,000		
静岡ガス	19,300	968.00	18,682,400		
メタウォーター	7,900	1,950.00	15,405,000		
アイネット	3,000	1,300.00	3,900,000		
松　竹	4,400	10,960.00	48,224,000	貸付株式数	800株
東　宝	39,000	5,050.00	196,950,000		
エイチ・アイ・エス	14,500	1,941.00	28,144,500	貸付株式数	5,700株
東　映	2,200	18,600.00	40,920,000	貸付株式数	200株
ラックランド	1,700	2,908.00	4,943,600	貸付株式数	600株
ＮＴＴデータ	175,800	2,394.00	420,865,200		
共立メンテナンス	11,500	3,995.00	45,942,500	貸付株式数	4,500株
イチネンホールディングス	6,200	1,300.00	8,060,000		
建設技術研究所	3,800	2,364.00	8,983,200		
スペース	3,900	893.00	3,482,700		
アインホールディングス	9,700	6,110.00	59,267,000		
燦ホールディングス	2,700	1,386.00	3,742,200		
ピー・シー・エー	3,900	1,463.00	5,705,700	貸付株式数	1,100株
スバル興業	400	7,970.00	3,188,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,209.00	2,780,700		
タナベ経営	2,000	721.00	1,442,000		
ビジネスＢ太田昭和	2,600	1,964.00	5,106,400		
ナ　ガ　ワ	2,000	11,420.00	22,840,000	貸付株式数	700株
東京都競馬	4,800	3,990.00	19,152,000	貸付株式数	1,900株
常磐興産	2,600	1,401.00	3,642,600	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,000	2,154.00	23,694,000		
ＤＴＳ	12,500	2,367.00	29,587,500	貸付株式数	2,200株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	30,700	5,930.00	182,051,000		
シーイーシー	7,200	1,242.00	8,942,400		
カプコン	62,300	2,829.00	176,246,700		
西尾レントオール	5,800	2,519.00	14,610,200	貸付株式数	2,000株
アイ・エス・ビー	3,000	1,013.00	3,039,000		

アゴーラ　ホスピタリティーG	52,200	23.00	1,200,600		
日本空港ビルデング	25,300	5,000.00	126,500,000		
トランス・コスモス	8,100	3,150.00	25,515,000	貸付株式数	1,400株
乃村工藝社	27,700	1,003.00	27,783,100		
ジャステック	3,600	1,018.00	3,664,800	貸付株式数	1,400株
ＳＣＳＫ	45,900	2,155.00	98,914,500		
藤田観光	2,900	2,237.00	6,487,300	貸付株式数	1,100株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,100	1,412.00	5,789,200	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,700	2,736.00	18,331,200	貸付株式数	1,800株
トーカイ	5,600	1,949.00	10,914,400	貸付株式数	2,200株
白　洋　舎	800	1,868.00	1,494,400	貸付株式数	300株
セコム	63,300	7,664.00	485,131,200		
日本システムウエア	2,300	2,152.00	4,949,600		
セントラル警備保障	3,000	2,407.00	7,221,000		
アイネス	5,700	1,390.00	7,923,000	貸付株式数	2,700株
丹青社	13,000	810.00	10,530,000		
メイテツク	7,800	6,660.00	51,948,000	貸付株式数	900株
ＴＫＣ	11,500	3,290.00	37,835,000		
富士ソフト	7,200	5,280.00	38,016,000		
応用地質	7,100	1,963.00	13,937,300		
船井総研ホールディン	13,100	2,559.00	33,522,900		
ＮＳＤ	21,600	2,117.00	45,727,200		
進学会ホールディングス	2,100	341.00	716,100	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	300	1,741.00	522,300	貸付株式数	100株
オ　オ　バ	4,300	760.00	3,268,000	貸付株式数	1,800株
コナミホールディングス	24,000	5,810.00	139,440,000		
いであ	1,700	1,815.00	3,085,500	貸付株式数	600株
学　究　社	2,200	1,457.00	3,205,400		
ベネッセホールディングス	21,500	2,199.00	47,278,500	貸付株式数	3,300株
イオンディライト	7,800	3,545.00	27,651,000	貸付株式数	3,100株
ナック	2,400	929.00	2,229,600	貸付株式数	300株
福井コンピュータＨＬＤＳ	3,000	3,820.00	11,460,000		
ダイセキ	11,800	5,160.00	60,888,000	貸付株式数	5,100株
ステップ	2,600	1,772.00	4,607,200	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,600	4,605.00	21,183,000	貸付株式数	900株
泉州電業	1,900	4,590.00	8,721,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,800	2,446.00	4,402,800		
トラスコ中山	14,200	2,631.00	37,360,200		

ヤマダホールディングス	242,500	396.00	96,030,000	貸付株式数	96,800株
オートバックスセブン	22,200	1,309.00	29,059,800	貸付株式数	9,300株
モリト	4,900	641.00	3,140,900		
アークランドサカモト	10,400	1,659.00	17,253,600		
ニトリホールディングス	26,300	18,030.00	474,189,000		
グルメ杵屋	5,300	982.00	5,204,600	貸付株式数	2,100株
愛　眼	4,100	189.00	774,900		
ケーユーホールディングス	3,400	934.00	3,175,600	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	23,100	2,225.00	51,397,500	貸付株式数	9,200株
加藤産業	9,600	3,170.00	30,432,000		
北恵	1,700	819.00	1,392,300	貸付株式数	600株
イノテック	3,900	1,354.00	5,280,600		
イエローハット	11,500	1,550.00	17,825,000	貸付株式数	2,200株
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,200	3,430.00	10,976,000	貸付株式数	1,200株
ＪＢＣＣホールディングス	4,200	1,763.00	7,404,600		
ＪＫホールディングス	5,300	1,030.00	5,459,000	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	10,300	991.00	10,207,300	貸付株式数	4,000株
日　伝	6,300	2,180.00	13,734,000	貸付株式数	100株
関西スーパーマーケット	5,000	1,834.00	9,170,000	貸付株式数	400株
ミロク情報サービス	5,700	1,464.00	8,344,800	貸付株式数	2,600株
北沢産業	4,400	249.00	1,095,600		
杉本商事	3,000	2,090.00	6,270,000	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,400	2,459.00	45,245,600		
王将フードサービス	4,400	5,780.00	25,432,000	貸付株式数	1,500株
プレナス	7,500	1,935.00	14,512,500		
ミニストップ	5,400	1,361.00	7,349,400	貸付株式数	1,900株
アークス	12,700	2,067.00	26,250,900	貸付株式数	5,000株
バローホールディングス	14,600	2,116.00	30,893,600		
東　テ　ク	2,300	2,325.00	5,347,500		
ミスミグループ本社	83,300	4,785.00	398,590,500		
藤　　久	1,600	771.00	1,233,600	貸付株式数	500株
アルテック	6,300	298.00	1,877,400		
ベ　ル　ク	2,900	5,260.00	15,254,000	貸付株式数	500株
大　庄	3,500	923.00	3,230,500	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,000	1,690.00	3,380,000	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	8,900	67,400.00	599,860,000		
ソフトバンクグループ	396,100	6,030.00	2,388,483,000		
蔵王産業	900	1,856.00	1,670,400		
スズケン	26,000	3,085.00	80,210,000	貸付株式数	3,300株
サンドラッグ	25,000	2,989.00	74,725,000		

サックスバーホールディング	6,100	520.00	3,172,000		
ジェコス	4,500	768.00	3,456,000		
ヤマザワ	1,400	1,680.00	2,352,000	貸付株式数	500株
や　ま　や	1,300	2,328.00	3,026,400	貸付株式数	500株
グローセル	7,300	392.00	2,861,600	貸付株式数	2,100株
ベルーナ	14,900	667.00	9,938,300	貸付株式数	5,700株
合計			177,548,758,040		

（注）1. ※先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

ソニーグループ	20,000株	キーエンス	5,000株
本田技研	30,000株	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	200,000株
三井住友フィナンシャルＧ	30,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	327,212,168	304,345,621
国債証券	79,869,797,660	85,097,080,600
地方債証券	4,128,711,500	3,514,853,500

特殊債券	3,097,138,700	2,703,089,900
社債券	2,777,936,600	2,976,109,700
未収入金	101,092,000	403,578,000
未収利息	196,593,327	195,282,238
前払費用	3,411,279	2,741,434
流動資産合計	90,501,893,234	95,197,080,993
資産合計	90,501,893,234	95,197,080,993
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	100,000,000
未払解約金	142,747,138	17,470,022
流動負債合計	242,747,138	117,470,022
負債合計	242,747,138	117,470,022
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	63,632,169,674	66,960,247,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	26,626,976,422	28,119,363,665
元本等合計	90,259,146,096	95,079,610,971
純資産合計	90,259,146,096	95,079,610,971
負債純資産合計	90,501,893,234	95,197,080,993

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. ※1　期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	57,670,399,195円	63,632,169,674円
期中追加設定元本額	27,218,615,082円	13,191,022,279円
期中一部解約元本額	21,256,844,603円	9,862,944,647円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	65,126,538円	59,050,508円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	505,967,183円	412,666,474円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	62,478,037円	49,180,012円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	718,126,297円	693,952,196円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	8,503,141,748円	9,573,099,389円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	－円	704,912円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	10,269,709,415円	10,117,083,683円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,737,338,049円	1,686,540,655円

ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	226,910,962円	219,254,803円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	339,059,642円	314,922,939円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	90,548,180円	61,401,829円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	23,601,367,986円	26,594,045,062円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	6,701,446,457円	6,074,653,568円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,691,971,743円	2,139,796,937円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,058,268,870円	965,018,800円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,961,101,317円	6,784,763,908円
ダイワライフスタイル２５	459,018,956円	477,075,499円
ダイワライフスタイル５０	504,172,138円	581,511,996円
ダイワライフスタイル７５	136,416,156円	155,524,136円
計	63,632,169,674円	66,960,247,306円
2. 期末日における受益権の総数	63,632,169,674口	66,960,247,306口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2020年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,166,650,040	△500,217,670
地方債証券	△30,019,100	△20,927,900
特殊債券	△22,302,900	△11,147,300
社債券	△16,802,200	5,480,800
合計	△1,235,774,240	△526,812,070

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4185円 (14,185円)	1.4199円 (14,199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	４２１　２年国債	600,000,000	601,614,000	
	４２３　２年国債	100,000,000	100,180,000	
	４２４　２年国債	500,000,000	500,955,000	
	４２５　２年国債	380,000,000	380,767,600	
	４２６　２年国債	390,000,000	390,830,700	
	４２７　２年国債	166,000,000	166,373,500	
	４２９　２年国債	40,000,000	40,099,200	
	１３４　５年国債	950,000,000	952,251,500	
	１３５　５年国債	1,550,000,000	1,554,526,000	
	１３６　５年国債	950,000,000	953,391,500	
	１３７　５年国債	800,000,000	803,392,000	
	１３８　５年国債	1,200,000,000	1,205,676,000	
	１３９　５年国債	900,000,000	904,770,000	
	１４０　５年国債	700,000,000	704,025,000	
	１４１　５年国債	1,120,000,000	1,127,078,400	
	１４２　５年国債	850,000,000	855,856,500	
	１４３　５年国債	700,000,000	705,215,000	
	１４４　５年国債	890,000,000	896,977,600	
	１４５　５年国債	1,100,000,000	1,109,031,000	
	１４６　５年国債	480,000,000	484,099,200	
	１４７　５年国債	840,000,000	843,981,600	
	１４８　５年国債	1,000,000,000	1,005,020,000	
	１４９　５年国債	220,000,000	221,060,400	
	１　４０年国債	70,000,000	100,678,200	
	２　４０年国債	110,000,000	153,078,200	
	３　４０年国債	150,000,000	209,835,000	
	４　４０年国債	180,000,000	253,659,600	
	６　４０年国債	105,000,000	141,153,600	
	７　４０年国債	121,000,000	156,797,850	
	８　４０年国債	230,000,000	279,128,000	

９　４０年国債	220,000,000	200,910,600	
１０　４０年国債	275,000,000	293,053,750	
１１　４０年国債	320,000,000	330,697,600	
１２　４０年国債	380,000,000	354,897,200	
１３　４０年国債	430,000,000	400,394,500	
１４　４０年国債	300,000,000	298,161,000	
３２６　１０年国債	30,000,000	30,258,900	
３２７　１０年国債	450,000,000	454,360,500	
３２８　１０年国債	350,000,000	353,300,500	
３２９　１０年国債	500,000,000	507,185,000	
３３０　１０年国債	612,000,000	622,281,600	
３３１　１０年国債	365,000,000	369,814,350	
３３２　１０年国債	250,000,000	253,727,500	
３３３　１０年国債	700,000,000	711,697,000	
３３４　１０年国債	900,000,000	916,695,000	
３３５　１０年国債	690,000,000	702,123,300	
３３６　１０年国債	275,000,000	280,263,500	
３３７　１０年国債	400,000,000	405,208,000	
３３８　１０年国債	580,000,000	589,987,600	
３３９　１０年国債	590,000,000	600,938,600	
３４０　１０年国債	760,000,000	775,093,600	
３４１　１０年国債	500,000,000	508,445,000	
３４２　１０年国債	880,000,000	887,981,600	
３４３　１０年国債	780,000,000	787,488,000	
３４４　１０年国債	780,000,000	787,527,000	
３４５　１０年国債	900,000,000	909,135,000	
３４６　１０年国債	780,000,000	788,307,000	
３４７　１０年国債	600,000,000	606,528,000	
３４８　１０年国債	550,000,000	556,253,500	
３４９　１０年国債	1,050,000,000	1,062,453,000	
３５０　１０年国債	500,000,000	506,015,000	
３５１　１０年国債	800,000,000	809,744,000	
３５２　１０年国債	700,000,000	708,855,000	
３５３　１０年国債	580,000,000	587,609,600	
３５４　１０年国債	600,000,000	607,926,000	
３５５　１０年国債	690,000,000	699,163,200	
３５６　１０年国債	510,000,000	516,599,400	
３５７　１０年国債	620,000,000	627,768,600	
３５８　１０年国債	660,000,000	667,966,200	

３５９　１０年国債	930,000,000	940,360,200	
３６０　１０年国債	900,000,000	909,117,000	
３６１　１０年国債	633,000,000	638,437,470	
３６２　１０年国債	710,000,000	715,268,200	
３６３　１０年国債	700,000,000	703,990,000	
３６４　１０年国債	520,000,000	522,277,600	
１　３０年国債	16,000,000	19,579,520	
２　３０年国債	24,000,000	28,854,240	
３　３０年国債	30,000,000	35,947,800	
４　３０年国債	36,000,000	45,364,320	
５　３０年国債	28,000,000	33,734,960	
６　３０年国債	24,000,000	29,580,240	
７　３０年国債	55,000,000	67,672,550	
８　３０年国債	27,000,000	31,965,570	
９　３０年国債	43,000,000	49,056,550	
１０　３０年国債	45,000,000	49,915,800	
１１　３０年国債	40,000,000	47,173,200	
１２　３０年国債	60,000,000	73,740,000	
１３　３０年国債	75,000,000	91,533,000	
１４　３０年国債	82,000,000	104,279,400	
１５　３０年国債	50,000,000	64,395,000	
１６　３０年国債	250,000,000	323,187,500	
１７　３０年国債	130,000,000	166,909,600	
１８　３０年国債	80,000,000	102,026,400	
１９　３０年国債	57,000,000	72,888,180	
２１　３０年国債	60,000,000	77,168,400	
２２　３０年国債	170,000,000	223,884,900	
２４　３０年国債	92,000,000	121,895,400	
２５　３０年国債	150,000,000	194,889,000	
２６　３０年国債	180,000,000	237,198,600	
２７　３０年国債	150,000,000	200,848,500	
２８　３０年国債	170,000,000	228,825,100	
２９　３０年国債	200,000,000	267,398,000	
３０　３０年国債	220,000,000	291,638,600	
３１　３０年国債	300,000,000	394,329,000	
３２　３０年国債	285,000,000	380,899,650	
３３　３０年国債	280,000,000	360,231,200	
３４　３０年国債	270,000,000	358,030,800	
３５　３０年国債	250,000,000	323,395,000	

３６　３０年国債	310,000,000	402,364,500	
３７　３０年国債	350,000,000	448,668,500	
３８　３０年国債	250,000,000	316,517,500	
３９　３０年国債	230,000,000	296,389,500	
４０　３０年国債	180,000,000	228,472,200	
４１　３０年国債	170,000,000	212,629,200	
４２　３０年国債	205,000,000	256,668,200	
４３　３０年国債	200,000,000	250,668,000	
４４　３０年国債	200,000,000	250,922,000	
４５　３０年国債	200,000,000	242,592,000	
４６　３０年国債	140,000,000	169,923,600	
４７　３０年国債	400,000,000	494,788,000	
４８　３０年国債	160,000,000	190,832,000	
４９　３０年国債	120,000,000	143,187,600	
５０　３０年国債	260,000,000	274,814,800	
５１　３０年国債	240,000,000	226,044,000	
５２　３０年国債	260,000,000	256,321,000	
５３　３０年国債	250,000,000	251,920,000	
５４　３０年国債	310,000,000	326,485,800	
５５　３０年国債	260,000,000	273,639,600	
５６　３０年国債	170,000,000	178,593,500	
５７　３０年国債	230,000,000	241,451,700	
５８　３０年国債	350,000,000	367,150,000	
５９　３０年国債	300,000,000	306,870,000	
６０　３０年国債	210,000,000	224,544,600	
６１　３０年国債	200,000,000	203,706,000	
６２　３０年国債	230,000,000	222,258,200	
６３　３０年国債	230,000,000	216,057,400	
６４　３０年国債	220,000,000	206,078,400	
６５　３０年国債	200,000,000	187,026,000	
６６　３０年国債	200,000,000	186,930,000	
６７　３０年国債	230,000,000	226,412,000	
６８　３０年国債	290,000,000	285,441,200	
６９　３０年国債	259,000,000	261,843,820	
７０　３０年国債	235,000,000	237,307,700	
７１　３０年国債	240,000,000	242,373,600	
７２　３０年国債	140,000,000	141,218,000	
５９　２０年国債	45,000,000	45,862,650	
６０　２０年国債	10,000,000	10,160,100	

６１　２０年国債	100,000,000	101,463,000	
６２　２０年国債	95,000,000	96,365,150	
６３　２０年国債	130,000,000	133,887,000	
６４　２０年国債	90,000,000	93,301,200	
６５　２０年国債	175,000,000	182,290,500	
６６　２０年国債	185,000,000	192,326,000	
６７　２０年国債	55,000,000	57,560,800	
６８　２０年国債	120,000,000	126,416,400	
６９　２０年国債	110,000,000	115,628,700	
７０　２０年国債	83,000,000	88,362,630	
７１　２０年国債	125,000,000	132,436,250	
７２　２０年国債	105,000,000	111,555,150	
７３　２０年国債	120,000,000	127,792,800	
７４　２０年国債	73,000,000	77,964,000	
７５　２０年国債	80,000,000	85,881,600	
７６　２０年国債	51,000,000	54,411,390	
７７　２０年国債	130,000,000	139,126,000	
７８　２０年国債	61,000,000	65,381,630	
７９　２０年国債	50,000,000	53,770,000	
８０　２０年国債	53,000,000	57,185,410	
８２　２０年国債	87,000,000	94,341,930	
８３　２０年国債	93,000,000	101,365,350	
８５　２０年国債	58,000,000	63,536,100	
８６　２０年国債	80,000,000	88,326,400	
８７　２０年国債	55,000,000	60,487,350	
８８　２０年国債	100,000,000	110,996,000	
８９　２０年国債	78,000,000	86,220,420	
９０　２０年国債	20,000,000	22,219,800	
９２　２０年国債	310,000,000	344,627,000	
９３　２０年国債	100,000,000	111,186,000	
９４　２０年国債	130,000,000	145,234,700	
９５　２０年国債	50,000,000	56,682,000	
９６　２０年国債	55,000,000	61,736,400	
９７　２０年国債	40,000,000	45,343,200	
９８　２０年国債	320,000,000	360,876,800	
９９　２０年国債	100,000,000	113,326,000	
１００　２０年国債	155,000,000	177,426,950	
１０１　２０年国債	350,000,000	405,076,000	
１０３　２０年国債	170,000,000	196,642,400	

	１０４　２０年国債	10,000,000	11,435,500	
	１０５　２０年国債	126,000,000	144,787,860	
	１０６　２０年国債	150,000,000	173,392,500	
	１０７　２０年国債	90,000,000	103,914,000	
	１０８　２０年国債	300,000,000	342,126,000	
	１０９　２０年国債	55,000,000	62,971,700	
	１１０　２０年国債	260,000,000	301,498,600	
	１１１　２０年国債	200,000,000	234,462,000	
	１１２　２０年国債	150,000,000	174,708,000	
	１１３　２０年国債	310,000,000	362,634,900	
	１１４　２０年国債	70,000,000	82,200,300	
	１１５　２０年国債	180,000,000	212,828,400	
	１１６　２０年国債	200,000,000	237,400,000	
	１１７　２０年国債	200,000,000	235,734,000	
	１１８　２０年国債	95,000,000	111,531,900	
	１１９　２０年国債	93,000,000	107,588,910	
	１２０　２０年国債	317,000,000	361,294,410	
	１２１　２０年国債	200,000,000	233,758,000	
	１２２　２０年国債	200,000,000	231,996,000	
	１２３　２０年国債	200,000,000	237,910,000	
	１２４　２０年国債	300,000,000	354,150,000	
	１２５　２０年国債	130,000,000	156,302,900	
	１２６　２０年国債	110,000,000	130,214,700	
	１２７　２０年国債	250,000,000	293,620,000	
	１２８　２０年国債	250,000,000	294,380,000	
	１２９　２０年国債	200,000,000	233,600,000	
	１３０　２０年国債	140,000,000	163,899,400	
	１３１　２０年国債	150,000,000	174,142,500	
	１３２　２０年国債	40,000,000	46,531,200	
	１３３　２０年国債	430,000,000	504,506,100	
	１３４　２０年国債	30,000,000	35,288,400	
	１３５　２０年国債	92,000,000	107,278,440	
	１３６　２０年国債	300,000,000	346,755,000	
	１３８　２０年国債	100,000,000	114,796,000	
	１３９　２０年国債	370,000,000	428,615,400	
	１４０　２０年国債	300,000,000	351,486,000	
	１４１　２０年国債	200,000,000	234,850,000	
	１４２　２０年国債	240,000,000	284,443,200	
	１４３　２０年国債	210,000,000	244,782,300	

	１４４　２０年国債	240,000,000	277,072,800	
	１４５　２０年国債	420,000,000	495,318,600	
	１４６　２０年国債	350,000,000	413,633,500	
	１４７　２０年国債	320,000,000	375,148,800	
	１４８　２０年国債	530,000,000	616,029,600	
	１４９　２０年国債	402,000,000	467,988,300	
	１５０　２０年国債	180,000,000	207,610,200	
	１５１　２０年国債	400,000,000	451,740,000	
	１５２　２０年国債	460,000,000	520,260,000	
	１５３　２０年国債	430,000,000	492,401,600	
	１５４　２０年国債	550,000,000	623,034,500	
	１５５　２０年国債	350,000,000	387,208,500	
	１５６　２０年国債	270,000,000	275,969,700	
	１５７　２０年国債	360,000,000	357,220,800	
	１５８　２０年国債	350,000,000	362,229,000	
	１５９　２０年国債	170,000,000	178,243,300	
	１６０　２０年国債	360,000,000	382,741,200	
	１６１　２０年国債	320,000,000	335,008,000	
	１６２　２０年国債	350,000,000	366,117,500	
	１６３　２０年国債	340,000,000	355,347,600	
	１６４　２０年国債	500,000,000	514,340,000	
	１６５　２０年国債	300,000,000	308,244,000	
	１６６　２０年国債	350,000,000	370,615,000	
	１６７　２０年国債	300,000,000	307,488,000	
	１６８　２０年国債	320,000,000	322,083,200	
	１６９　２０年国債	320,000,000	316,044,800	
	１７０　２０年国債	220,000,000	216,882,600	
	１７１　２０年国債	300,000,000	295,197,000	
	１７２　２０年国債	100,000,000	100,000,000	
	１７３　２０年国債	410,000,000	409,290,700	
	１７４　２０年国債	420,000,000	418,534,200	
	１７５　２０年国債	400,000,000	405,284,000	
	１７６　２０年国債	340,000,000	343,933,800	
	１７７　２０年国債	365,000,000	362,043,500	
	１７８　２０年国債	150,000,000	151,363,500	
	２７　メキシコ国債	100,000,000	99,550,700	
	１１　フイリピン共和国	100,000,000	101,955,000	
国債証券　合計			85,097,080,600	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	101,482,400	

	１６　東京都２０年	100,000,000	113,930,900	
	３－５　北海道公債	100,000,000	100,139,100	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	100,259,300	
	３１　神奈川県２０年	100,000,000	109,600,300	
	４２０　大阪府公債	200,000,000	201,625,400	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	101,447,500	
	３　兵庫県公債１２年	200,000,000	203,686,800	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	115,382,300	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	101,504,600	
	２１－５　愛知県公債	100,000,000	116,763,100	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	100,888,000	
	２９－５　広島県公債	100,000,000	101,351,600	
	４　埼玉県３０年	100,000,000	115,929,000	
	９　埼玉県２０年	100,000,000	117,498,500	
	２９－１　福岡県公債	100,000,000	101,039,800	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	106,623,500	
	１６　千葉県２０年	100,000,000	115,827,900	
	２８－２　新潟県公債	100,000,000	100,916,000	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	101,485,900	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	101,460,100	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	101,119,900	
	２７－１　滋賀県公債	100,000,000	101,874,400	
	２５－６　大阪市公債	200,000,000	202,723,400	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	116,484,900	
	２０－１　神戸市２０年	100,000,000	115,199,500	
	４　川崎市公債３０年	100,000,000	130,694,000	
	２３－４　福岡市２０年	100,000,000	117,121,500	
	２４－４　福井県公債	100,000,000	100,639,600	
	２－２　岡山県公債	100,000,000	100,154,300	
地方債証券　合計			3,514,853,500	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	107,254,400	
	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	100,916,300	
	２４７　道路機構	200,000,000	195,749,000	
	８６　政保道路機構	100,000,000	115,190,200	
	１８６　政保道路機構	100,000,000	100,927,200	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	100,960,000	
	２２３　政保道路機構	100,000,000	114,844,800	
	２３６　政保道路機構	100,000,000	101,108,500	
	２６１　政保道路機構	200,000,000	203,284,800	

	２８４　政保道路機構	200,000,000	195,373,200	
	２９８　政保道路機構	100,000,000	103,238,500	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	107,540,300	
	１　地方公共団１５年	100,000,000	107,919,000	
	４８　地方公共団体	100,000,000	101,190,800	
	５１　地方公共団体	100,000,000	101,467,100	
	３１　地方公共団２０	100,000,000	117,162,600	
	６５　地方公共団体	100,000,000	101,524,100	
	７１　地方公共団体	100,000,000	101,547,000	
	２５　政保日本政策	100,000,000	101,061,900	
	１２７　都市再生	100,000,000	100,191,600	
	８０　住宅支援機構	100,000,000	107,467,200	
	１２３　住宅支援機構	100,000,000	116,970,400	
	１９　利付商工債	100,000,000	100,201,000	
特殊債券　合計			2,703,089,900	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	100,249,700	
	６３　中日本高速道	100,000,000	102,163,600	
	２１　西日本高速道	100,000,000	101,538,800	
	１２　アサヒグループＨＤ	100,000,000	101,050,100	
	１１日本たばこ産業	100,000,000	101,889,000	
	５　野村不動産ＨＤ	100,000,000	102,551,900	
	２３　森ビル	100,000,000	102,592,000	
	１４　セブンアンドアイ	100,000,000	100,443,800	
	２０　ＺＨＤ	100,000,000	99,967,000	
	１８　楽天グループ	100,000,000	100,138,600	
	１７　パナソニツク	100,000,000	101,500,800	
	１５　デンソー	100,000,000	100,656,100	
	１　日生２０２１基金	100,000,000	100,018,400	
	７　凸版印刷	100,000,000	106,876,500	
	１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	101,659,800	
	１６　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	100,241,500	
	７８　トヨタファイナンス	100,000,000	100,754,600	
	１７５　オリックス	100,000,000	101,961,600	
	７　三井住友海上	100,000,000	100,049,000	
	１３　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	106,692,400	
	１０７東日本旅客鉄	100,000,000	116,343,100	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	114,360,300	
	１５　ソフトバンク	100,000,000	99,989,300	
	５０９　関西電力	100,000,000	101,460,800	

	４８２　九州電力	100,000,000	100,233,000	
	３３２　北海道電力	100,000,000	104,791,400	
	１１　東京電力パワー	100,000,000	102,792,800	
	６５　東京瓦斯	100,000,000	100,444,400	
	４　フアーストリテイリング	100,000,000	102,699,400	
社債券　合計			2,976,109,700	
合計			94,291,133,700	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	365,587,927	1,248,475,444
コール・ローン	3,752,997,009	9,574,164,291
株式	151,364,986,629	229,141,995,652
新株予約権証券	868,069	－
投資証券	3,711,750,912	5,638,901,532
派生商品評価勘定	619,719,431	448,705,586
未収入金	12,393,192	24,502,132
未収配当金	182,217,065	248,294,417
差入委託証拠金	2,380,060,115	4,653,123,326
流動資産合計	162,390,580,349	250,978,162,380
資産合計	162,390,580,349	250,978,162,380
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,156,487	130,578,047
未払金	1,712,592	4,990,970

未払解約金	82,467,100	65,382,000
流動負債合計	107,336,179	200,951,017
負債合計	107,336,179	200,951,017
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	54,067,455,177	61,024,141,090
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	108,215,788,993	189,753,070,273
元本等合計	162,283,244,170	250,777,211,363
純資産合計	162,283,244,170	250,777,211,363
負債純資産合計	162,390,580,349	250,978,162,380

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1．※1　期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	48,893,612,273円	54,067,455,177円
期中追加設定元本額	16,107,558,260円	13,499,704,777円
期中一部解約元本額	10,933,715,356円	6,543,018,864円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	429,418,774円	372,377,534円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	6,511,702円	4,453,234円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	109,450,582円	59,956,664円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,001,565円	7,408,815円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	353,394,455円	236,485,519円
外国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	22,667,766円	36,674,409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）	535,920,559円	508,352,729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）	2,255,476,207円	2,520,260,966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）	662,541,353円	513,644,174円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	11,396,584円	15,304,858円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	6,026,400円	32,174,123円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	2,011,620,301円	4,063,382,462円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,021,183,359円	1,116,648,157円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	49,879,929円	171,426,649円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	33,018,813,032円	38,249,671,210円
ダイワ・ライフ・バランス３０	579,030,840円	500,854,698円
ダイワ・ライフ・バランス５０	976,488,397円	919,288,192円
ダイワ・ライフ・バランス７０	722,361,053円	740,101,154円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,541,641,973円	1,732,619,609円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	2,282,168円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	11,422,149円	12,075,244円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	7,627,380円	10,707,802円
ダイワつみたてインデックス外国株式	452,466,523円	811,486,824円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,121,988円	1,690,959円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,068,375円	2,170,527円

	ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,463,419円	3,559,196円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	161,683,743円	107,882,488円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	284,495,474円	208,152,302円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,255,482,425円	1,461,676,506円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	110,264,809円	73,896,117円
	ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）	271,255,135円	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）	－円	212,845,169円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	798,778,255円	927,057,365円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	183,907,812円	324,437,993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）	2,325,979,029円	1,929,148,713円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,735,745,325円	2,822,903,027円
	ダイワライフスタイル２５	17,629,498円	12,346,386円
	ダイワライフスタイル５０	63,519,419円	49,688,514円
	ダイワライフスタイル７５	50,437,420円	39,700,549円
計		54,067,455,177円	61,024,141,090円
2.	期末日における受益権の総数	54,067,455,177口	61,024,141,090口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	17,672,692,878	41,450,751,465
新株予約権証券	30,829	－
投資証券	△288,804,566	1,091,405,878
合計	17,383,919,141	42,542,157,343

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	2020年11月30日 現在				2021年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	6,984,505,406	－	7,583,915,003	599,409,597	15,914,463,645	－	16,312,448,688	397,985,043
合計	6,984,505,406	－	7,583,915,003	599,409,597	15,914,463,645	－	16,312,448,688	397,985,043

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種　類	2020年11月30日 現在				2021年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	4,081,862,053	－	4,079,015,400	△2,846,653	9,828,774,794	－	9,748,917,290	△79,857,504
アメリカ･ドル	3,024,714,845	－	3,001,843,000	△22,871,845	7,046,626,660	－	7,027,555,314	△19,071,346
イギリス･ポンド	165,466,538	－	169,006,600	3,540,062	308,287,051	－	301,604,400	△6,682,651
オーストラリア･ドル	112,156,038	－	117,657,000	5,500,962	286,703,319	－	274,744,314	△11,959,005
カナダ･ドル	129,630,400	－	131,901,000	2,270,600	439,283,847	－	428,403,360	△10,880,487
スイス･フラン	173,808,703	－	174,769,600	960,897	443,805,440	－	440,052,480	△3,752,960
ユーロ	476,085,529	－	483,838,200	7,752,671	1,304,068,477	－	1,276,557,422	△27,511,055
合計	4,081,862,053	－	4,079,015,400	△2,846,653	9,828,774,794	－	9,748,917,290	△79,857,504

（注）　1．時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.0015円	4.1095円
（1万口当たり純資産額）	(30,015円)	(41,095円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,250	175.510	745,917.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,510	551.180	1,934,641.800	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,750	197.740	1,334,745.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,750	86.080	408,880.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,150	122.410	263,181.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	47.120	994,232.000	
	ABBOTT LABORATORIES	64,366	128.030	8,240,778.980	
	HOWMET AEROSPACE INC	14,133	28.500	402,790.500	
	VERISK ANALYTICS INC	5,650	229.160	1,294,754.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	12,650	37.260	471,339.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	21,600	82.930	1,791,288.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,610	564.320	908,555.200	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	22,562	105.390	2,377,809.180	
	QORVO INC	4,070	150.840	613,918.800	
	AFLAC INC	23,600	55.700	1,314,520.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,800	141.750	680,400.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,050	107.850	652,492.500	
	ADOBE INC	17,320	687.490	11,907,326.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,650	62.960	481,644.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,530	463.260	2,098,567.800	
	GARMIN LTD	5,650	139.240	786,706.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,950	291.350	2,316,232.500	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,150	207.660	5,222,649.000	
	WR BERKLEY CORP	5,275	79.470	419,204.250	
	AUTOZONE INC	820	1,838.690	1,507,725.800	
	DOLLAR TREE INC	8,321	141.350	1,176,173.350	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	41,900	8.590	359,921.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	4,100	66.290	271,789.000	

CELANESE CORP	4,150	159.790	663,128.500	
DR HORTON INC	12,566	98.760	1,241,018.160	
DENTSPLY SIRONA INC	7,950	48.690	387,085.500	
AUTODESK INC	8,020	261.150	2,094,423.000	
MOODY'S CORP	6,160	397.270	2,447,183.200	
DEVON ENERGY CORP	23,300	43.920	1,023,336.000	
ALBEMARLE CORP	4,310	275.890	1,189,085.900	
ATMOS ENERGY CORP	4,850	93.800	454,930.000	
ALLIANT ENERGY CORP	9,050	57.280	518,384.000	
CITIGROUP INC	74,873	65.040	4,869,739.920	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,500	235.900	3,656,450.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,300	83.310	1,524,573.000	
ALLEGHANY CORP	480	664.730	319,070.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,430	533.950	763,548.500	
HESS CORP	10,200	76.070	775,914.000	
DAVITA INC	2,750	96.910	266,502.500	
DANAHER CORP	23,250	326.520	7,591,590.000	
FORTIVE CORP	11,700	76.230	891,891.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	20,550	131.900	2,710,545.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,150	64.810	1,305,921.500	
BUNGE LTD	5,100	90.580	461,958.000	
TE CONNECTIVITY LTD	11,925	159.390	1,900,725.750	
APPLE INC	605,600	160.240	97,041,344.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,050	113.320	1,252,186.000	
BOEING CO/THE	20,130	198.500	3,995,805.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,565	118.460	659,229.900	
BECTON DICKINSON AND CO	10,619	243.610	2,586,894.590	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	7,600	10.120	76,912.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,900	90.550	443,695.000	
NISOURCE INC	13,900	25.250	350,975.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,900	95.620	468,538.000	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	320	442.370	141,558.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,071	57.010	1,714,347.710	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	150,204	51.660	7,759,538.640	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,850	282.120	13,781,562.000	
ANSYS INC	3,200	397.720	1,272,704.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	49,067	61.060	2,996,031.020	

BLACKSTONE GROUP INC/THE	24,950	148.880	3,714,556.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	81,000	54.640	4,425,840.000	
JPMORGAN CHASE & CO	109,770	161.230	17,698,217.100	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,300	207.020	1,718,266.000	
LKQ CORP	10,250	57.600	590,400.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,830	155.100	283,833.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,412	74.190	846,656.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	10,050	186.690	1,876,234.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,220	293.710	1,239,456.200	
DOLLAR GENERAL CORP	8,850	225.070	1,991,869.500	
SERVICENOW INC	7,150	672.820	4,810,663.000	
CATERPILLAR INC	19,850	195.920	3,889,012.000	
BROWN & BROWN INC	8,550	65.410	559,255.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,300	48.440	402,052.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,800	375.310	675,558.000	
CMS ENERGY CORP	10,650	61.130	651,034.500	
MOSAIC CO/THE	12,800	36.030	461,184.000	
DELTA AIR LINES INC	5,750	36.240	208,380.000	
CORNING INC	29,400	38.460	1,130,724.000	
CISCO SYSTEMS INC	152,950	55.760	8,528,492.000	
MORGAN STANLEY	50,652	97.230	4,924,893.960	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	54.160	113,736.000	
MSCI INC	3,000	645.490	1,936,470.000	
FAIR ISAAC CORP	1,000	350.660	350,660.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,200	322.120	386,544.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,500	78.480	667,080.000	
BROADCOM INC	14,812	564.340	8,359,004.080	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,350	180.740	786,219.000	
ARAMARK	8,500	34.380	292,230.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,170	111.490	799,383.300	
CENTENE CORP	21,387	73.770	1,577,718.990	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,950	129.700	512,315.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,700	48.780	765,846.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,500	164.810	1,236,075.000	
GARTNER INC	3,150	325.000	1,023,750.000	
SPLUNK INC	6,010	125.000	751,250.000	
DOMINION ENERGY INC	29,441	74.420	2,190,999.220	
MONSTER BEVERAGE CORP	14,300	86.850	1,241,955.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,000	80.860	404,300.000	

DEERE & CO	10,800	348.090	3,759,372.000	
POOL CORP	1,480	560.100	828,948.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,684	120.260	1,284,857.840	
VMWARE INC-CLASS A	7,480	120.380	900,442.400	
CABLE ONE INC	200	1,825.970	365,194.000	
BURLINGTON STORES INC	2,400	293.370	704,088.000	
NASDAQ INC	4,200	209.080	878,136.000	
VAIL RESORTS INC	1,490	333.450	496,840.500	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	18,400	36.840	677,856.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,630	138.140	363,308.200	
CONSOLIDATED EDISON INC	12,600	80.350	1,012,410.000	
COGNEX CORP	6,500	78.660	511,290.000	
TELEFLEX INC	1,720	308.950	531,394.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,050	195.870	597,403.500	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,710	447.380	1,212,399.800	
BIO-RAD LABORATORIES-A	790	749.560	592,152.400	
CATALENT INC	6,200	133.960	830,552.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,050	294.090	1,485,154.500	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,120	297.530	630,763.600	
IDEX CORP	2,760	234.420	646,999.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,350	77.710	2,280,788.500	
ROLLINS INC	8,087	35.330	285,713.710	
AMETEK INC	8,445	140.010	1,182,384.450	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,900	93.750	834,375.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,550	57.830	320,956.500	
HEICO CORP	1,600	140.180	224,288.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,320	424.580	985,025.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	469.430	657,202.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,700	89.170	864,949.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,500	521.280	781,920.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,060	554.880	8,911,372.800	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,800	118.470	331,716.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,000	634.170	1,268,340.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,600	93.020	427,892.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,000	1,678.100	1,678,100.000	
UGI CORP	7,650	43.400	332,010.000	

CUMMINS INC	5,350	217.270	1,162,394.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,350	60.310	1,709,788.500	
CDW CORP/DE	5,100	194.800	993,480.000	
COSTAR GROUP INC	14,500	79.990	1,159,855.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,020	724.500	1,463,490.000	
AMERCO	370	717.230	265,375.100	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,640	357.220	1,300,280.800	
MERCADOLIBRE INC	1,610	1,234.100	1,986,901.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,760	152.310	420,375.600	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,016	138.070	1,382,909.120	
IPG PHOTONICS CORP	1,420	163.180	231,715.600	
DEXCOM INC	3,540	571.010	2,021,375.400	
NORDSON CORP	1,910	262.150	500,706.500	
COPART INC	7,830	148.010	1,158,918.300	
SEAGEN INC	4,950	165.310	818,284.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,710	634.470	1,719,413.700	
TRANSDIGM GROUP INC	1,890	584.220	1,104,175.800	
BIO-TECHNE CORP	1,400	479.690	671,566.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,350	84.740	283,879.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,750	102.080	791,120.000	
KINDER MORGAN INC	73,381	16.010	1,174,829.810	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	229.920	2,253,216.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,400	352.960	494,144.000	
COTERRA ENERGY INC	29,000	20.840	604,360.000	
T-MOBILE US INC	22,677	113.400	2,571,571.800	
ZILLOW GROUP INC - C	5,950	54.260	322,847.000	
COCA-COLA CO/THE	148,650	54.580	8,113,317.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,350	51.820	380,877.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,150	126.760	779,574.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,150	33.750	376,312.500	
CSX CORP	82,100	35.620	2,924,402.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,460	291.920	1,010,043.200	
EXPEDIA GROUP INC	5,175	166.500	861,637.500	
AUTOLIV INC	2,950	95.930	282,993.500	
AMAZON.COM INC	16,470	3,561.570	58,659,057.900	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22,690	110.710	2,512,009.900	

EXXON MOBIL CORP	153,605	61.590	9,460,531.950	
AES CORP	24,600	23.620	581,052.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,500	264.370	396,555.000	
EOG RESOURCES INC	21,000	88.390	1,856,190.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,000	114.260	685,560.000	
ABIOMED INC	1,610	319.120	513,783.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,680	120.230	682,906.400	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,170	153.420	1,713,701.400	
FORD MOTOR CO	143,323	19.670	2,819,163.410	
NOVAVAX INC	2,600	193.960	504,296.000	
DISCOVERY INC - A	6,290	24.590	154,671.100	
EXACT SCIENCES CORP	6,250	86.570	541,062.500	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,637	27.640	155,806.680	
LIBERTY BROADBAND-A	850	156.340	132,889.000	
DISCOVERY INC-C	11,389	24.050	273,905.450	
FORTINET INC	5,050	343.300	1,733,665.000	
MARKEL CORP	510	1,243.740	634,307.400	
NEXTERA ENERGY INC	71,180	88.660	6,310,818.800	
MASIMO CORP	1,920	288.290	553,516.800	
FREEPORT-MCMORAN INC	53,608	37.980	2,036,031.840	
INSULET CORP	2,440	295.870	721,922.800	
US BANCORP	51,200	57.400	2,938,880.000	
UNITED RENTALS INC	2,570	357.020	917,541.400	
F5 NETWORKS INC	2,250	231.070	519,907.500	
FASTENAL CO	21,050	60.940	1,282,787.000	
FISERV INC	21,933	97.470	2,137,809.510	
GENERAL ELECTRIC CO	39,856	98.400	3,921,830.400	
GENERAL MOTORS CO	47,650	59.860	2,852,329.000	
ZENDESK INC	4,370	95.110	415,630.700	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,750	194.440	1,701,350.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,350	386.540	4,773,769.000	
ALPHABET INC-CL A	10,900	2,910.610	31,725,649.000	
ALPHABET INC-CL C	10,557	2,922.280	30,850,509.960	
OWENS CORNING	3,900	87.130	339,807.000	
GENERAL MILLS INC	22,050	63.520	1,400,616.000	
FIRSTENERGY CORP	19,768	39.050	771,940.400	
GENUINE PARTS CO	5,100	132.910	677,841.000	
IHS MARKIT LTD	13,884	130.130	1,806,724.920	
FIFTH THIRD BANCORP	25,900	42.990	1,113,441.000	

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,550	214.680	1,620,834.000	
HALLIBURTON CO	32,600	22.250	725,350.000	
HOME DEPOT INC	38,550	406.820	15,682,911.000	
ASSURANT INC	2,250	156.040	351,090.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	52,900	15.370	813,073.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,510	181.720	274,397.200	
HERSHEY CO/THE	5,390	179.160	965,672.400	
HUMANA INC	4,720	428.070	2,020,490.400	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,100	223.940	2,261,794.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,820	222.080	626,265.600	
HENRY SCHEIN INC	5,100	73.770	376,227.000	
HP INC	47,300	35.930	1,699,489.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	47,600	14.610	695,436.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	49.730	297,285.940	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,000	60.050	420,350.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	49.890	147,175.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,400	41.730	600,912.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	24,303	34.780	845,258.340	
ENPHASE ENERGY INC	4,690	256.710	1,203,969.900	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	32,400	118.500	3,839,400.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,750	47.220	649,275.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,900	102.960	504,504.000	
ZOETIS INC	17,300	223.550	3,867,415.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,779	192.930	1,693,732.470	
CHENIERE ENERGY INC	8,850	106.600	943,410.000	
ALLEGION PLC	3,300	128.680	424,644.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	27.920	362,206.160	
WASTE CONNECTIONS INC	9,487	137.190	1,301,521.530	
JUNIPER NETWORKS INC	12,200	31.840	388,448.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,050	129.370	523,948.500	
JOHNSON & JOHNSON	95,500	159.750	15,256,125.000	
PLUG POWER INC	18,600	41.620	774,132.000	
ABBVIE INC	64,072	116.890	7,489,376.080	
HOLOGIC INC	9,150	75.970	695,125.500	

KIMBERLY-CLARK CORP	12,200	135.040	1,647,488.000	
KROGER CO	26,400	42.350	1,118,040.000	
KLA CORP	5,560	413.840	2,300,950.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,030	341.230	3,081,306.900	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,930	212.980	624,031.400	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	9,700	75.870	735,939.000	
LOWE'S COS INC	26,000	248.580	6,463,080.000	
ELI LILLY & CO	29,535	254.830	7,526,404.050	
LAM RESEARCH CORP	5,200	680.540	3,538,808.000	
LOEWS CORP	8,300	55.110	457,413.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	68.340	454,392.660	
MCDONALD'S CORP	27,050	250.300	6,770,615.000	
3M CO	21,040	176.230	3,707,879.200	
META PLATFORMS INC CLASS A	86,900	338.030	29,374,807.000	
S&P GLOBAL INC	8,770	464.930	4,077,436.100	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,310	418.340	966,365.400	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	1,920	347.210	666,643.200	
PHILLIPS 66	15,750	69.860	1,100,295.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	41.130	660,136.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,200	86.990	800,308.000	
METLIFE INC	27,000	59.890	1,617,030.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	29,950	75.020	2,246,849.000	
ARISTA NETWORKS INC	8,480	126.600	1,073,568.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	84.250	404,400.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,228	259.500	1,616,166.000	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	850	1,536.220	1,305,787.000	
BAKER HUGHES CO	26,523	23.530	624,086.190	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,190	340.580	1,427,030.200	
MERCK & CO. INC.	91,821	74.890	6,876,474.690	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	77.040	1,598,657.040	
MASCO CORP	9,100	67.340	612,794.000	
M & T BANK CORP	4,689	152.160	713,478.240	
MARSH & MCLENNAN COS	18,520	167.030	3,093,395.600	
BLACK KNIGHT INC	5,600	73.140	409,584.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,720	127.000	345,440.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	10,172	150.770	1,533,632.440	

WORKDAY INC-CLASS A	6,900	281.590	1,942,971.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,710	267.510	724,952.100	
SQUARE INC - A	14,200	212.870	3,022,754.000	
TRANSUNION	6,900	114.130	787,497.000	
VISTRA CORP	15,650	20.090	314,408.500	
NOVOCURE LTD	3,450	93.350	322,057.500	
NETAPP INC	8,200	91.520	750,464.000	
NIKE INC -CL B	46,200	169.870	7,847,994.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,050	268.740	2,432,097.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,100	84.400	1,696,440.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,855	100.570	689,407.350	
ALLY FINANCIAL INC	13,650	47.710	651,241.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,710	356.390	2,034,986.900	
APTIV PLC	9,750	165.490	1,613,527.500	
NEWMONT CORP	29,311	55.400	1,623,829.400	
MCKESSON CORP	5,750	223.270	1,283,802.500	
XYLEM INC	6,670	123.800	825,746.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	56,500	87.350	4,935,275.000	
NUCOR CORP	10,950	112.070	1,227,166.500	
SUNRUN INC	6,100	47.860	291,946.000	
WESTERN UNION CO	15,246	16.160	246,375.360	
GODADDY INC - CLASS A	6,000	69.090	414,540.000	
NEWELL BRANDS INC	13,442	22.350	300,428.700	
EVERGY INC	8,250	65.260	538,395.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	34,324	30.060	1,031,779.440	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	900	204.190	183,771.000	
OKTA INC	4,510	223.610	1,008,481.100	
COUPA SOFTWARE INC	2,550	202.660	516,783.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	159.940	895,664.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,755	30.190	475,643.450	
LINDE PLC	18,846	320.740	6,044,666.040	
WIX.COM LTD	2,130	159.370	339,458.100	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,300	32.240	461,032.000	
KKR & CO INC	18,800	76.310	1,434,628.000	
PAYCHEX INC	11,700	123.730	1,447,641.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,480	644.150	1,597,492.000	
ALTRIA GROUP INC	66,700	43.480	2,900,116.000	
P G & E CORP	55,100	12.380	682,138.000	
PFIZER INC	203,113	52.400	10,643,121.200	

CIGNA CORP	12,620	199.610	2,519,078.200	
DELL TECHNOLOGIES -C	10,101	57.570	581,514.570	
ALTICE USA INC- A	10,900	15.990	174,291.000	
XCEL ENERGY INC	19,700	65.590	1,292,123.000	
STERIS PLC	3,600	226.690	816,084.000	
SEA LTD-ADR	2,700	297.960	804,492.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	34.490	187,384.170	
FOX CORP - CLASS A	12,199	36.920	450,387.080	
STRYKER CORP	12,330	243.500	3,002,355.000	
LYFT INC-A	9,200	41.820	384,744.000	
DOW INC	27,368	56.860	1,556,144.480	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,850	97.300	374,605.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,740	218.980	1,694,905.200	
PARKER HANNIFIN CORP	4,660	309.140	1,440,592.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	44,500	39.700	1,766,650.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,450	183.360	1,549,392.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	88,667	149.020	13,213,156.340	
EXELON CORP	35,772	54.170	1,937,769.240	
TELADOC HEALTH INC	5,100	106.410	542,691.000	
INGERSOLL-RAND INC	14,708	59.800	879,538.400	
NVR INC	120	5,281.730	633,807.600	
CONOCOPHILLIPS	49,202	72.150	3,549,924.300	
TWILIO INC - A	5,950	293.230	1,744,718.500	
DOCUSIGN INC	7,100	251.500	1,785,650.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,890	447.430	845,642.700	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,000	112.970	564,850.000	
PEPSICO INC	50,100	164.140	8,223,414.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,500	176.960	265,440.000	
DROPBOX INC-CLASS A	11,400	24.950	284,430.000	
MONGODB INC	2,020	525.980	1,062,479.600	
SNAP INC - A	34,750	48.850	1,697,537.500	
CORTEVA INC	26,918	46.590	1,254,109.620	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,300	105.030	1,501,929.000	
AMCOR PLC	56,400	11.580	653,112.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,900	224.570	1,549,533.000	

ROKU INC	4,220	231.280	976,001.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,550	173.320	1,135,246.000	
ACCENTURE PLC-CL A	23,050	365.820	8,432,151.000	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,750	144.450	397,237.500	
PENTAIR PLC	5,925	76.800	455,040.000	
QUALCOMM INC	40,850	183.740	7,505,779.000	
INVESCO LTD	14,100	23.240	327,684.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	227.270	534,084.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,000	70.920	709,200.000	
DATADOG INC - CLASS A	6,800	182.990	1,244,332.000	
PINTEREST INC- CLASS A	19,900	40.540	806,746.000	
AVALARA INC	3,050	142.700	435,235.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,800	654.400	2,486,720.000	
REPUBLIC SERVICES INC	8,250	138.230	1,140,397.500	
BOOKING HOLDINGS INC	1,500	2,182.010	3,273,015.000	
ROSS STORES INC	13,100	111.660	1,462,746.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,450	133.700	461,265.000	
RESMED INC	5,330	256.920	1,369,383.600	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	156.700	741,191.000	
ROBERT HALF INTL INC	4,150	114.760	476,254.000	
MODERNA INC	12,370	368.510	4,558,468.700	
HUBSPOT INC	1,590	851.910	1,354,536.900	
PERKINELMER INC	4,130	185.220	764,958.600	
CARRIER GLOBAL CORP	30,237	55.980	1,692,667.260	
OTIS WORLDWIDE CORP	14,938	83.580	1,248,518.040	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	6,300	73.350	462,105.000	
AVANTOR INC	19,350	39.780	769,743.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	5,700	56.800	323,760.000	
DYNATRACE INC	6,700	64.470	431,949.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	15,820	107.060	1,693,689.200	
REGIONS FINANCIAL CORP	35,185	23.540	828,254.900	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,550	41.340	270,777.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,880	130.810	376,732.800	
MATCH GROUP INC	9,370	134.080	1,256,329.600	
CHEVRON CORP	70,118	114.850	8,053,052.300	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	9,400	44.390	417,266.000	
ZSCALER INC	3,000	355.920	1,067,760.000	
EDISON INTERNATIONAL	14,000	66.070	924,980.000	

ETSY INC	4,650	281.480	1,308,882.000	
TESLA INC	29,620	1,136.990	33,677,643.800	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,000	364.780	2,553,460.000	
NORTONLIFELOCK INC	21,400	25.310	541,634.000	
DRAFTKINGS INC - CL A	11,700	35.200	411,840.000	
UNITY SOFTWARE INC	2,100	170.330	357,693.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,852	184.150	1,077,645.800	
SYNOPSYS INC	5,580	355.870	1,985,754.600	
CARVANA CO	2,620	291.970	764,961.400	
CHEWY INC - CLASS A	3,250	68.660	223,145.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,500	191.090	1,624,265.000	
PPD INC	4,400	47.200	207,680.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,785	668.190	3,197,289.150	
VIATRIS INC	43,321	12.520	542,378.920	
DOORDASH INC - A	2,700	183.010	494,127.000	
AIRBNB INC-CLASS A	4,600	180.080	828,368.000	
CBRE GROUP INC - A	12,150	97.960	1,190,214.000	
TWITTER INC	29,200	45.780	1,336,776.000	
SOUTHERN CO/THE	38,650	62.820	2,427,993.000	
SYSCO CORP	18,750	73.200	1,372,500.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,103	152.400	1,387,297.200	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	50.490	100,980.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	61.520	264,536.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,650	61.400	469,710.000	
SCHLUMBERGER LTD	50,352	29.650	1,492,936.800	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,850	57.900	338,715.000	
AT&T INC	258,991	23.890	6,187,294.990	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,550	44.540	247,197.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	15,500	63.020	976,810.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,500	93.480	701,100.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,170	334.280	3,065,347.600	
SEMPRA ENERGY	11,400	124.200	1,415,880.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,500	50.060	325,390.000	
CLARIVATE PLC	12,500	22.830	285,375.000	
OAK STREET HEALTH INC	3,600	30.670	110,412.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	56,000	21.070	1,179,920.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,950	104.060	827,277.000	

TEXAS INSTRUMENTS INC	33,500	194.380	6,511,730.000	
SALESFORCE.COM INC	35,216	296.740	10,449,995.840	
WESTROCK CO	9,880	46.120	455,665.600	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25,934	78.360	2,032,188.240	
TERADYNE INC	6,050	154.450	934,422.500	
UNION PACIFIC CORP	24,080	239.460	5,766,196.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,488	61.780	1,451,088.640	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	54,929	82.940	4,555,811.260	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	26,200	204.640	5,361,568.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,044	266.690	1,878,564.360	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	62.250	270,787.500	
AMEREN CORPORATION	9,200	85.090	782,828.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	34,216	452.000	15,465,632.000	
VERISIGN INC	3,700	244.460	904,502.000	
VALERO ENERGY CORP	14,792	68.170	1,008,370.640	
ULTA BEAUTY INC	1,890	401.420	758,683.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,888	49.950	493,905.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	121.270	343,194.100	
ANTHEM INC	8,920	416.220	3,712,682.400	
WALT DISNEY CO/THE	65,862	147.810	9,735,062.220	
WELLS FARGO & CO	149,922	49.160	7,370,165.520	
WASTE MANAGEMENT INC	15,200	166.830	2,535,816.000	
WILLIAMS COS INC	43,800	28.010	1,226,838.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,250	226.700	963,475.000	
WHIRLPOOL CORP	2,320	222.780	516,849.600	
WALMART INC	56,100	142.630	8,001,543.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,650	123.500	944,775.000	
WYNN RESORTS LTD	3,700	83.000	307,100.000	
WABTEC CORP	6,511	92.470	602,072.170	
TJX COMPANIES INC	43,800	70.670	3,095,346.000	
WATERS CORP	2,230	341.220	760,920.600	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,890	607.200	1,147,608.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26,500	46.080	1,221,120.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,743	230.390	1,092,739.770	
WESTERN DIGITAL CORP	11,250	58.990	663,637.500	
WEC ENERGY GROUP INC	11,430	90.490	1,034,300.700	

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,250	64.250	1,172,562.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	61,250	196.290	12,022,762.500	
PPL CORP	27,900	28.440	793,476.000	
PULTEGROUP INC	9,450	51.510	486,769.500	
PPG INDUSTRIES INC	8,530	157.360	1,342,280.800	
NORTHERN TRUST CORP	7,300	119.940	875,562.000	
NVIDIA CORP	90,380	333.760	30,165,228.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,463	200.880	3,106,207.440	
TYSON FOODS INC-CL A	10,850	81.880	888,398.000	
NETFLIX INC	16,070	663.840	10,667,908.800	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,240	648.770	9,238,484.800	
NRG ENERGY INC	8,650	36.630	316,849.500	
GLOBE LIFE INC	3,655	88.470	323,357.850	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,450	214.450	1,383,202.500	
TEXTRON INC	8,300	72.790	604,157.000	
NEWS CORP - CLASS A	14,137	21.820	308,469.340	
OMNICOM GROUP	7,950	67.470	536,386.500	
ORACLE CORP	68,133	92.940	6,332,281.020	
MASTERCARD INC - A	32,050	323.010	10,352,470.500	
ONEOK INC	16,400	62.460	1,024,344.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,752	12.950	450,038.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,800	481.480	1,829,624.000	
YUM! BRANDS INC	10,850	125.250	1,358,962.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	4,250	169.600	720,800.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,950	45.330	315,043.500	
BANK OF AMERICA CORP	279,401	45.590	12,737,891.590	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,720	431.880	742,833.600	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,750	87.400	589,950.000	
AMERICAN EXPRESS CO	24,750	157.860	3,907,035.000	
ANALOG DEVICES INC	19,391	183.200	3,552,431.200	
ADVANCED MICRO DEVICES	44,150	161.910	7,148,326.500	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	31,172	54.950	1,712,901.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,950	154.920	921,774.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,450	69.890	590,570.500	

AVERY DENNISON CORP	3,030	215.530	653,055.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,150	79.710	1,526,446.500	
EMERSON ELECTRIC CO	21,550	90.860	1,958,033.000	
AON PLC-CLASS A	8,240	296.690	2,444,725.600	
AMGEN INC	20,850	203.470	4,242,349.500	
EATON CORP PLC	14,586	167.380	2,441,404.680	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,250	226.970	1,418,562.500	
APPLIED MATERIALS INC	33,250	151.220	5,028,065.000	
CME GROUP INC	13,120	225.330	2,956,329.600	
ECOLAB INC	9,400	227.150	2,135,210.000	
EQUIFAX INC	4,430	284.060	1,258,385.800	
GILEAD SCIENCES INC	45,650	70.650	3,225,172.500	
KEURIG DR PEPPER INC	25,500	35.170	896,835.000	
HORMEL FOODS CORP	10,550	42.490	448,269.500	
STATE STREET CORP	12,463	93.190	1,161,426.970	
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,540	80.100	4,208,454.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,200	76.030	1,383,746.000	
CAMPBELL SOUP CO	7,000	41.200	288,400.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	108.400	539,832.000	
CARDINAL HEALTH INC	10,400	47.470	493,688.000	
FEDEX CORP	9,200	240.570	2,213,244.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,504	147.020	2,426,418.080	
FMC CORP	4,650	103.540	481,461.000	
CERNER CORP	10,850	72.860	790,531.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,013	147.190	1,326,623.470	
CITRIX SYSTEMS INC	4,600	82.370	378,902.000	
INTEL CORP	146,500	50.000	7,325,000.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14,200	34.020	483,084.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,150	68.610	902,221.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,550	238.110	2,750,170.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.270	242,022.000	
ILLUMINA INC	5,330	370.810	1,976,417.300	
SEALED AIR CORP	5,400	64.200	346,680.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	12,870	334.740	4,308,103.800	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	111.110	483,328.500	
SNAP-ON INC	2,020	212.820	429,896.400	
CARMAX INC	5,800	146.480	849,584.000	
DUKE ENERGY CORP	28,028	100.220	2,808,966.160	

TARGET CORP	17,950	249.160	4,472,422.000	
DOVER CORP	5,200	171.800	893,360.000	
WW GRAINGER INC	1,580	495.580	783,016.400	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,720	146.090	689,544.800	
CINTAS CORP	3,420	434.730	1,486,776.600	
CONAGRA BRANDS INC	17,300	31.510	545,123.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,450	53.290	290,430.500	
CLOROX COMPANY	4,430	169.160	749,378.800	
ENTERGY CORP	7,420	105.070	779,619.400	
MICROSOFT CORP	259,600	336.630	87,389,148.000	
INCYTE CORP	6,930	70.370	487,664.100	
CVS HEALTH CORP	47,769	92.020	4,395,703.380	
MEDTRONIC PLC	48,898	110.280	5,392,471.440	
MICRON TECHNOLOGY INC	40,850	86.140	3,518,819.000	
BLACKROCK INC	5,510	928.000	5,113,280.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	21,100	26.590	561,049.000	
HASBRO INC	4,700	99.130	465,911.000	
KELLOGG CO	9,300	63.870	593,991.000	
KEYCORP	35,400	22.830	808,182.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,350	296.190	992,236.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	51,061	60.640	3,096,339.040	
COOPER COS INC/THE	1,770	381.190	674,706.300	
CHUBB LTD	16,219	185.040	3,001,163.760	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	124.420	335,934.000	
ALLSTATE CORP	10,950	113.140	1,238,883.000	
EBAY INC	24,900	70.550	1,756,695.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	40,500	187.240	7,583,220.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,050	110.180	556,409.000	
XILINX INC	8,850	233.080	2,062,758.000	
DISH NETWORK CORP-A	8,900	33.130	294,857.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,470	340.050	2,880,223.500	
TRIMBLE INC	9,050	86.530	783,096.500	
LENNAR CORP-A	10,050	107.250	1,077,862.500	
LEAR CORP	2,150	169.000	363,350.000	
PROGRESSIVE CORP	21,390	94.970	2,031,408.300	
PACCAR INC	12,537	86.120	1,079,686.440	
BIOGEN INC	5,520	236.110	1,303,327.200	

	IDEXX LABORATORIES INC	3,090	631.300	1,950,717.000	
	STARBUCKS CORP	42,750	110.730	4,733,707.500	
	PTC INC	4,020	110.320	443,486.400	
	EVERSOURCE ENERGY	12,410	85.270	1,058,200.700	
	INTUIT INC	9,880	694.660	6,863,240.800	
	BORGWARNER INC	8,750	44.810	392,087.500	
	BEST BUY CO INC	8,250	110.950	915,337.500	
	BALL CORP	11,984	94.810	1,136,203.040	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	51,797	38.590	1,998,846.230	
	ELECTRONIC ARTS INC	10,570	124.880	1,319,981.600	
	VULCAN MATERIALS CO	4,900	199.350	976,815.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,350	190.110	1,777,528.500	
	VF CORP	12,250	73.730	903,192.500	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	22,025	32.280	710,967.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	174.380	383,636.000	
	CARNIVAL CORP	30,000	18.160	544,800.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	166,090	51.530	8,558,617.700	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,300	58.370	484,471.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,800	5.560	249,088.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,496,632,493.350 (170,271,878,768)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	733,000	3.277	2,402,041.000	
	UNILEVER PLC	94,860	39.210	3,719,460.600	
	BARCLAYS PLC	622,300	1.832	1,140,551.440	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	300,500	1.225	368,112.500	
	PRUDENTIAL PLC	95,100	12.945	1,231,069.500	
	NATWEST GROUP PLC	210,291	2.104	442,452.260	
	EVRAZ PLC	17,400	5.720	99,528.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	21.330	150,675.120	
	BAE SYSTEMS PLC	117,000	5.498	643,266.000	
	AVIVA PLC	142,366	3.782	538,428.210	
	AVEVA GROUP PLC	4,400	32.200	141,680.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	182,300	15.250	2,780,075.000	
	INFORMA PLC	52,700	4.740	249,798.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	159,540	1.460	233,008.170	
	AUTO TRADER GROUP PLC	35,000	7.324	256,340.000	

DCC PLC	3,400	56.340	191,556.000	
OCADO GROUP PLC	17,500	18.340	320,950.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,750	158.400	435,600.000	
HALMA PLC	13,700	30.290	414,973.000	
ENTAIN PLC	21,200	17.460	370,152.000	
JD SPORTS FASHION PLC	17,200	11.415	196,338.000	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	23,500	6.440	151,340.000	
M&G PLC	91,700	1.903	174,550.950	
RELX PLC	70,396	23.430	1,649,378.280	
DIAGEO PLC	84,700	38.235	3,238,504.500	
RIO TINTO PLC	40,700	46.215	1,880,950.500	
STANDARD CHARTERED PLC	97,000	4.142	401,774.000	
TESCO PLC	280,684	2.790	783,108.360	
SMITH & NEPHEW PLC	31,950	12.400	396,180.000	
GLENCORE PLC	364,525	3.571	1,301,901.030	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,450	13.415	167,016.750	
SMITHS GROUP PLC	14,383	14.560	209,416.480	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	46,583	2.672	124,469.770	
PEARSON PLC	25,763	6.146	158,339.390	
SAINSBURY (J) PLC	59,525	2.897	172,443.920	
NEXT PLC	4,850	79.620	386,157.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	127,700	1.555	198,573.500	
WHITBREAD PLC	7,361	28.750	211,628.750	
BUNZL PLC	11,905	28.670	341,316.350	
VODAFONE GROUP PLC	1,014,183	1.101	1,116,818.310	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,011	100.650	504,357.150	
KINGFISHER PLC	73,711	3.260	240,297.860	
WPP PLC	42,900	10.605	454,954.500	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	24,827	10.885	270,241.890	
SEVERN TRENT PLC	9,083	29.070	264,042.810	
RENTOKIL INITIAL PLC	67,300	6.186	416,317.800	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,000	61.640	1,602,640.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	19,450	15.625	303,906.250	
SCHRODERS PLC	4,150	35.170	145,955.500	
SSE PLC	37,600	15.580	585,808.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	36,700	6.928	254,257.600	
ASTRAZENECA PLC	56,100	83.670	4,693,887.000	
FERGUSON PLC	8,087	115.550	934,452.850	

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	215,200	2.849	613,104.800	
	3I GROUP PLC	35,091	13.880	487,063.080	
	ASHTEAD GROUP PLC	16,150	61.300	989,995.000	
	SAGE GROUP PLC/THE	40,114	7.770	311,685.780	
	NATIONAL GRID PLC	129,634	10.012	1,297,895.600	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,575,465	0.468	1,205,317.620	
	IMPERIAL BRANDS PLC	34,100	15.630	532,983.000	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	3,832	43.250	165,734.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	79,060	25.560	2,020,773.600	
	BHP GROUP PLC	76,827	20.190	1,551,137.130	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,850	19.070	245,049.500	
	HSBC HOLDINGS PLC	741,650	4.164	3,088,601.420	
	ANGLO AMERICAN PLC	46,583	26.835	1,250,054.800	
	MONDI PLC	17,600	17.480	307,648.000	
	COMPASS GROUP PLC	64,739	15.220	985,327.580	
	PERSIMMON PLC	11,200	27.590	309,008.000	
	BT GROUP PLC	320,600	1.634	523,860.400	
	COCA-COLA HBC AG-DI	7,150	23.530	168,239.500	
	BURBERRY GROUP PLC	14,289	17.950	256,487.550	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	6,436	46.000	296,056.000	
	INTERTEK GROUP PLC	5,850	54.800	320,580.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,049	68.700	827,766.300	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	148,900	15.948	2,374,657.200	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	134,618	15.940	2,145,810.920	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	22.300	127,110.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,050	30.130	212,416.500	
	ANTOFAGASTA PLC	14,100	13.980	197,118.000	
	ABRDN PLC	77,862	2.358	183,598.590	
	EXPERIAN PLC	33,654	33.830	1,138,514.820	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 64,194,636.540 (9,729,339,114)	
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	44,300	19.750	874,925.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,650	290.900	479,985.000	

	ICL GROUP LTD	28,100	28.520	801,412.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	471.000	447,450.000	
	BANK HAPOALIM BM	44,100	30.740	1,355,634.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,200	31.040	1,744,448.000	
	NICE LTD	2,400	884.700	2,123,280.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,400	117.100	632,340.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 8,459,474.000 (304,635,810)	
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	97,000	3.360	325,920.000	
	BHP GROUP LTD	103,400	38.570	3,988,138.000	
	SOUTH32 LTD	160,100	3.570	571,557.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	33,550	21.240	712,602.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	59,100	17.600	1,040,160.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	115,950	27.200	3,153,840.000	
	WESTPAC BANKING CORP	128,948	20.920	2,697,592.160	
	SANTOS LTD	62,900	6.390	401,931.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	2.520	163,800.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	100,850	26.620	2,684,627.000	
	RIO TINTO LTD	13,000	95.390	1,240,070.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	59,000	4.920	290,280.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	3.410	204,600.000	
	XERO LTD	4,750	141.210	670,747.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	31.110	105,774.000	
	COLES GROUP LTD	46,845	18.030	844,615.350	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,400	51.810	279,774.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	37,000	9.660	357,420.000	
	EVOLUTION MINING LTD	59,500	4.120	245,140.000	
	AFTERPAY LTD	7,600	110.550	840,180.000	
	REECE LTD	10,500	23.460	246,330.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	47,300	6.850	324,005.000	
	OIL SEARCH LTD	64,200	3.910	251,022.000	
	SEEK LTD	11,700	34.300	401,310.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	25,600	11.920	305,152.000	
	NEWCREST MINING LTD	28,500	24.180	689,130.000	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	62,350	93.780	5,847,183.000	
	AMPOL LTD	7,950	28.930	229,993.500	
	ORICA LTD	13,100	14.380	188,378.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	51,950	11.600	602,620.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	44,100	40.100	1,768,410.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	78,263	4.990	390,532.370	
	CROWN RESORTS LTD	13,400	11.100	148,740.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	4.900	149,450.000	
	TELSTRA CORP LTD	143,500	4.000	574,000.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	15,650	54.930	859,654.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	11,984	194.010	2,325,015.840	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	21,130	44.590	942,186.700	
	CSL LTD	16,000	307.000	4,912,000.000	
	WESFARMERS LTD	40,300	58.210	2,345,863.000	
	COCHLEAR LTD	2,320	226.670	525,874.400	
	BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	20.330	361,874.000	
	SUNCORP GROUP LTD	43,657	10.650	464,947.050	
	ASX LTD	6,700	91.020	609,834.000	
	COMPUTERSHARE LTD	18,200	19.140	348,348.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	86,136	4.370	376,414.320	
	SONIC HEALTHCARE LTD	15,950	42.700	681,065.000	
	AGL ENERGY LTD	21,500	5.330	114,595.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	10.100	509,040.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,150	66.200	407,130.000	
	REA GROUP LTD	1,800	161.000	289,800.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,400	32.630	143,572.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	130.170	286,374.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 49,438,611.690 (4,018,864,744)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	9,100	42.850	389,935.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	2,205.320	1,543,724.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,687	72.960	706,763.520	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,100	53.950	868,595.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,450	161.360	1,040,772.000	

BCE INC	4,930	64.860	319,759.800	
FRANCO-NEVADA CORP	6,900	179.960	1,241,724.000	
SUNCOR ENERGY INC	54,230	31.950	1,732,648.500	
METRO INC/CN	8,600	62.150	534,490.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	12,000	101.870	1,222,440.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	43,500	81.430	3,542,205.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,950	145.590	2,322,160.500	
TORONTO-DOMINION BANK	65,200	93.590	6,102,068.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,800	37.450	367,010.000	
ROYAL BANK OF CANADA	51,050	129.730	6,622,716.500	
TC ENERGY CORP	35,250	61.020	2,150,955.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	19,729	38.550	760,552.950	
BARRICK GOLD CORP	63,300	24.430	1,546,419.000	
CAE INC	10,900	31.540	343,786.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,212	156.000	969,072.000	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,900	37.110	218,949.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	106.730	373,555.000	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	7,800	19.570	152,646.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,450	63.460	345,857.000	
HYDRO ONE LTD	11,300	31.120	351,656.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	96.860	577,285.600	
NORTHLAND POWER INC	7,900	38.840	306,836.000	
WSP GLOBAL INC	4,300	181.840	781,912.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	110.940	310,632.000	
PARKLAND CORP	5,100	34.170	174,267.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	29.000	174,000.000	
EMERA INC	9,000	59.350	534,150.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	35.300	169,440.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,700	57.720	733,044.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	10.330	232,425.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,700	64.600	562,020.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	21,500	17.540	377,110.000	
B2GOLD CORP	34,700	5.120	177,664.000	
AIR CANADA	6,500	21.300	138,450.000	
KINROSS GOLD CORP	43,200	7.700	332,640.000	
BANK OF MONTREAL	23,100	137.010	3,164,931.000	
POWER CORP OF CANADA	20,100	41.830	840,783.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,100	2,000.000	8,200,000.000	
NUTRIEN LTD	20,319	87.260	1,773,035.940	

CANOPY GROWTH CORP	8,400	14.090	118,356.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,600	50.920	488,832.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,700	47.720	224,284.000	
CAMECO CORP	14,000	31.830	445,620.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,400	253.080	354,312.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	51.180	332,670.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	3,900	68.160	265,824.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,900	122.830	233,377.000	
TELUS CORP	10,800	29.490	318,492.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,000	33.890	576,130.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	174.050	382,910.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,000	53.430	2,244,060.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	566.740	566,740.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,200	100.370	1,023,774.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,737	136.480	373,545.760	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	32.620	228,340.000	
BLACKBERRY LTD	19,400	12.560	243,664.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	20,850	68.670	1,431,769.500	
ENBRIDGE INC	72,700	48.740	3,543,398.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	46,125	73.870	3,407,253.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	69,100	23.920	1,652,872.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	31.790	333,795.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,000	91.440	2,194,560.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,700	69.880	258,556.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,000	53.280	372,960.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,550	163.760	4,184,068.000	
CGI INC - CLASS A	7,900	107.430	848,697.000	
ONEX CORPORATION	2,600	95.610	248,586.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,000	37.240	595,840.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	48.870	151,497.000	
TMX GROUP LTD	1,900	128.610	244,359.000	
OPEN TEXT CORP	9,900	62.040	614,196.000	
SAPUTO INC	8,700	28.980	252,126.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,400	28.070	572,628.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	30,200	47.510	1,434,802.000	
YAMANA GOLD INC	32,300	5.160	166,668.000	

	FORTIS INC	16,600	55.960	928,936.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	88.660	336,908.000	
	LUNDIN MINING CORP	22,100	10.420	230,282.000	
	CENOVUS ENERGY INC	46,700	15.860	740,662.000	
	DOLLARAMA INC	10,700	56.410	603,587.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,900	42.540	123,366.000	
	ALTAGAS LTD	10,300	24.940	256,882.000	
	KEYERA CORP	7,400	28.790	213,046.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 89,694,316.320 (8,006,114,675)	
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	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	102,400	3.370	345,088.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	45,200	26.530	1,199,156.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	69,900	30.790	2,152,221.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	48,475	4.910	238,012.250	
	KEPPEL CORP LTD	56,300	5.210	293,323.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	6.870	117,477.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.000	112,700.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	129,300	11.340	1,466,262.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.790	165,110.000	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.810	186,219.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	320,150	2.410	771,561.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	56,500	3.840	216,960.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	31,500	9.230	290,745.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,400	4.190	311,736.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 7,866,570.750 (654,577,352)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	130,600	15.755	2,057,603.000	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,100	383.000	421,300.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	890.000	249,200.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,150	43.740	225,261.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	25,000	357.500	8,937,500.000	
	SIKA AG-REG	5,100	363.700	1,854,870.000	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	112,300.000	449,200.000	
	ABB LTD-REG	62,700	31.940	2,002,638.000	
	SWISS RE AG	10,700	86.660	927,262.000	
	NESTLE SA-REG	102,700	120.100	12,334,270.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	800	1,575.000	1,260,000.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,500	240.300	360,450.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	90,920	8.866	806,096.720	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,000	57.180	457,440.000	
	SGS SA-REG	210	2,846.000	597,660.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	234.000	161,460.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,750	105.200	184,100.000	
	TEMENOS AG - REG	2,300	121.300	278,990.000	
	ALCON INC	17,800	73.080	1,300,824.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	273.200	265,004.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,342	381.800	2,039,575.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,700	138.300	235,110.000	
	CLARIANT AG-REG	7,700	18.110	139,447.000	
	NOVARTIS AG-REG	79,100	74.240	5,872,384.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	120	2,210.000	265,200.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	18,600	138.900	2,583,540.000	
	SWISSCOM AG-REG	900	513.400	462,060.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,010	70.800	71,508.000	
	GEBERIT AG-REG	1,300	698.000	907,400.000	
	GIVAUDAN-REG	330	4,524.000	1,492,920.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	360	1,945.000	700,200.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,992	344.200	685,646.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,200	75.440	467,728.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,690	730.400	1,964,776.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	53.050	100,795.000	
	HOLCIM LTD	18,540	45.480	843,199.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,110	524.600	582,306.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,920	266.100	510,912.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,700	88.600	239,220.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	11,330.000	385,220.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 55,680,275.920 (6,862,594,007)	

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	3,870	534.200	2,067,354.000	
	ERICSSON LM-B SHS	112,830	93.820	10,585,710.600	
	VOLVO AB-B SHS	55,650	198.320	11,036,508.000	
	SKF AB-B SHARES	14,400	210.300	3,028,320.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	203.700	1,751,820.000	
	SWEDISH MATCH AB	61,300	66.980	4,105,874.000	
	TELE2 AB-B SHS	18,800	131.150	2,465,620.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,000	131.500	8,153,000.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	54,850	96.340	5,284,249.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,100	183.560	6,259,396.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	162.620	4,585,884.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	22,900	150.700	3,451,030.000	
	SKANSKA AB-B SHS	12,850	210.300	2,702,355.000	
	SANDVIK AB	43,100	229.400	9,887,140.000	
	INVESTOR AB-B SHS	70,000	211.850	14,829,500.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,450	557.600	14,190,920.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	202.000	1,616,000.000	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	132.950	1,588,752.500	
	TELIA CO AB	100,200	35.375	3,544,575.000	
	ALFA LAVAL AB	11,900	361.600	4,303,040.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,900	475.300	7,081,970.000	
	ASSA ABLOY AB-B	38,750	259.000	10,036,250.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,743	275.000	1,304,325.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,000	684.800	2,739,200.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	507.800	1,523,400.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	341.900	1,948,830.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	54,300	127.100	6,901,530.000	
	LUNDIN ENERGY AB	7,550	338.700	2,557,185.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,000	292.400	6,725,200.000	
	EMBRACER GROUP AB	20,000	95.080	1,901,600.000	
	BOLIDEN AB	10,400	306.400	3,186,560.000	
	EPIROC AB-A	24,950	218.200	5,444,090.000	
	EPIROC AB-B	14,800	180.500	2,671,400.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,850	131.450	2,083,482.500	
	NORDEA BANK ABP	125,000	107.240	13,405,000.000	
	EQT AB	9,100	531.400	4,835,740.000	

	EVOLUTION AB	6,550	1,003.400	6,572,270.000	
	SINCH AB	19,400	123.550	2,396,870.000	
	KINNEVIK AB - B	9,300	328.550	3,055,515.000	
	HEXAGON AB-B SHS	76,400	133.500	10,199,400.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	271.500	1,683,300.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 213,690,165.600 (2,677,537,775)	
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	64,800	715.700	46,377,360.000	
	DANSKE BANK A/S	26,000	109.700	2,852,200.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	120	18,520.000	2,222,400.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,650	221.500	8,560,975.000	
	GN STORE NORD A/S	4,850	385.600	1,870,160.000	
	CARLSBERG AS-B	3,900	1,063.000	4,145,700.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,850	488.600	3,835,510.000	
	COLOPLAST-B	4,500	1,074.500	4,835,250.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,910	1,427.500	11,291,525.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	2,743.000	822,900.000	
	DEMANT A/S	3,875	314.600	1,219,075.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	19,660.000	4,521,800.000	
	TRYG A/S	13,200	158.250	2,088,900.000	
	PANDORA A/S	3,800	843.000	3,203,400.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,050	492.100	1,993,005.000	
	GENMAB A/S	2,520	2,550.000	6,426,000.000	
	ORSTED A/S	7,050	846.200	5,965,710.000	
	AMBU A/S-B	6,300	191.000	1,203,300.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 113,435,170.000 (1,959,025,386)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	47,500	4.490	213,275.000	
	MERCURY NZ LTD	26,000	5.850	152,100.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	6.200	162,440.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	72,789	4.355	316,996.090	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	48,300	7.785	376,015.500	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,200	33.000	765,600.000	

	RYMAN HEALTHCARE LTD	16,500	12.100	199,650.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 2,186,076.590 (169,486,518)	
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	
	DNB BANK	36,750	201.800	7,416,150.000	
	NORSK HYDRO ASA	50,700	60.500	3,067,350.000	
	ORKLA ASA	29,050	84.100	2,443,105.000	
	TELENOR ASA	27,800	137.900	3,833,620.000	
	EQUINOR ASA	38,223	227.150	8,682,354.450	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	410.400	1,149,120.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	445.400	2,966,364.000	
	MOWI ASA	16,600	210.400	3,492,640.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	207.300	1,523,655.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,650	358.000	1,306,700.000	
	ADEVINTA ASA	10,600	131.950	1,398,670.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 37,279,728.450 (470,097,376)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	27,891	25.010	697,553.910	
	BAYER AG-REG	35,220	45.320	1,596,170.400	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,000	26.700	186,900.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	73,900	10.678	789,104.200	
	COMMERZBANK AG	32,935	6.235	205,349.720	
	VOLKSWAGEN AG	1,110	255.400	283,494.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,550	164.520	1,077,606.000	
	SIEMENS AG-REG	27,350	144.560	3,953,716.000	
	E.ON SE	79,300	10.992	871,665.600	
	UNIPER SE	6,650	38.680	257,222.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,750	85.780	1,007,915.000	
	GEA GROUP AG	5,050	44.570	225,078.500	
	CONTINENTAL AG	3,960	93.250	369,270.000	
	BASF SE	32,870	57.980	1,905,802.600	
	ALLIANZ SE-REG	14,740	192.080	2,831,259.200	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,400	71.100	455,040.000	
	RWE AG	22,700	35.020	794,954.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	5.501	53,084.650	
	BRENNTAG SE	5,350	76.340	408,419.000	

FRESENIUS SE & CO KGAA	14,800	33.780	499,944.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	33.020	109,626.400	
SAP SE	37,392	116.800	4,367,385.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,040	239.100	1,205,064.000	
ZALANDO SE	7,650	81.500	623,475.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,350	59.620	318,967.000	
KION GROUP AG	2,400	93.900	225,360.000	
COVESTRO AG	6,700	50.680	339,556.000	
RATIONAL AG	190	811.600	154,204.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	580.000	701,800.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,300	75.000	397,500.000	
DELIVERY HERO SE	5,800	119.300	691,940.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,400	177.500	248,500.000	
BECHTLE AG	2,850	63.240	180,234.000	
NEMETSCHEK SE	2,000	107.550	215,100.000	
SCOUT24 AG	3,600	59.760	215,136.000	
AROUNDTOWN SA	32,500	5.520	179,400.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,100	64.460	651,046.000	
KNORR-BREMSE AG	2,500	90.440	226,100.000	
HELLOFRESH SE	5,700	94.500	538,650.000	
TEAMVIEWER AG	5,350	12.350	66,072.500	
SIEMENS ENERGY AG	14,325	24.090	345,089.250	
BEIERSDORF AG	3,610	89.260	322,228.600	
FUCHS PETROLUB PREF	2,350	39.800	93,530.000	
MERCK KGAA	4,600	219.600	1,010,160.000	
ADIDAS AG	6,810	254.300	1,731,783.000	
PUMA SE	3,860	106.350	410,511.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,750	66.800	250,500.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	119,200	16.040	1,911,968.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,220	53.520	386,414.400	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	30,650	82.800	2,537,820.000	
QIAGEN N.V.	7,698	49.230	378,972.540	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	46,700	40.220	1,878,274.000	
HANNOVER RUECK SE	2,200	155.500	342,100.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	35,450	53.580	1,899,411.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,710	142.200	954,162.000	
LANXESS AG	2,800	51.240	143,472.000	

MTU AERO ENGINES AG	1,790	167.650	300,093.500	
SYMRISE AG	4,400	125.900	553,960.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.357	79,666.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1,950	70.500	137,475.000	
VONOVIA SE	19,500	49.170	958,815.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,550	124.150	316,582.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32,260	31.745	1,024,093.700	
NN GROUP NV	9,900	43.890	434,511.000	
ARCELORMITTAL	25,700	24.440	628,108.000	
HEINEKEN NV	9,200	93.440	859,648.000	
AEGON NV	64,244	3.939	253,057.110	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37,383	30.255	1,131,022.660	
AKZO NOBEL N.V.	6,768	94.460	639,305.280	
KONINKLIJKE DSM NV	6,200	191.800	1,189,160.000	
WOLTERS KLUWER	9,600	100.300	962,880.000	
ING GROEP NV	139,600	12.158	1,697,256.800	
KONINKLIJKE KPN NV	121,150	2.619	317,291.850	
ASML HOLDING NV	15,010	704.800	10,579,048.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,150	12.672	191,980.800	
ADYEN NV	700	2,460.500	1,722,350.000	
JUST EAT TAKEAWAY	6,450	58.150	375,067.500	
PROSUS NV	33,380	70.680	2,359,298.400	
JDE PEET'S NV	2,600	25.050	65,130.000	
INPOST SA	7,000	10.312	72,184.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,700	396.400	673,880.000	
VOPAK	2,300	33.180	76,314.000	
RANDSTAD NV	4,300	56.100	241,230.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,950	77.300	305,335.000	
TOTALENERGIES SE	89,350	41.200	3,681,220.000	
MICHELIN (CGDE)	6,050	128.350	776,517.500	
AIR LIQUIDE SA	16,977	147.360	2,501,730.720	
KERING	2,700	683.800	1,846,260.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19,350	151.240	2,926,494.000	
BOUYGUES SA	8,200	29.910	245,262.000	
BNP PARIBAS	40,300	55.380	2,231,814.000	
THALES SA	3,850	73.880	284,438.000	

DANONE	23,400	54.330	1,271,322.000	
CARREFOUR SA	21,200	15.170	321,604.000	
SUEZ	12,625	19.770	249,596.250	
VIVENDI	27,891	11.200	312,379.200	
L'OREAL	9,040	401.800	3,632,272.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	17,900	57.240	1,024,596.000	
LEGRAND SA	9,467	95.780	906,749.260	
PERNOD RICARD SA	7,487	206.600	1,546,814.200	
EURAZEO SE	1,254	73.450	92,106.300	
SOCIETE GENERALE SA	29,000	27.485	797,065.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,910	697.200	6,909,252.000	
ACCOR SA	6,150	26.670	164,020.500	
CAPGEMINI SE	5,720	201.900	1,154,868.000	
VALEO SA	7,700	24.570	189,189.000	
PUBLICIS GROUPE	8,000	57.960	463,680.000	
BUREAU VERITAS SA	10,600	28.310	300,086.000	
EIFFAGE	3,040	82.320	250,252.800	
SODEXO SA	2,950	75.140	221,663.000	
IPSEN	1,150	86.780	99,797.000	
ORPEA	1,800	83.600	150,480.000	
AMUNDI SA	2,250	75.050	168,862.500	
TELEPERFORMANCE	2,100	357.400	750,540.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	44.890	134,670.000	
FAURECIA	3,857	37.140	143,248.980	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,750	112.980	536,655.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	513.200	513,200.000	
SEB SA	997	133.300	132,900.100	
ESSILORLUXOTTICA	10,150	180.380	1,830,857.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	84.450	84,450.000	
WORLDLINE SA	8,514	47.470	404,159.580	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,500	41.830	146,405.000	
AXA SA	69,400	24.235	1,681,909.000	
EDENRED	8,850	40.500	358,425.000	
RENAULT SA	6,400	29.145	186,528.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,130	1,640.000	1,853,200.000	
STMICROELECTRONICS NV	24,400	43.025	1,049,810.000	
REMY COINTREAU	750	213.400	160,050.000	
ATOS SE	3,200	37.360	119,552.000	

DASSAULT SYSTEMES SE	23,450	53.430	1,252,933.500	
WENDEL	930	103.500	96,255.000	
ORANGE	71,400	9.604	685,725.600	
ALSTOM	11,400	32.370	369,018.000	
CNP ASSURANCES	5,850	21.580	126,243.000	
SANOFI	40,725	85.610	3,486,467.250	
VINCI SA	18,850	84.160	1,586,416.000	
AIRBUS SE	21,100	99.690	2,103,459.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,700	28.240	556,328.000	
CREDIT AGRICOLE SA	41,600	12.132	504,691.200	
BIOMERIEUX	1,340	127.350	170,649.000	
ENGIE	64,623	12.894	833,248.960	
EDF	20,250	12.345	249,986.250	
SAFRAN SA	12,200	101.600	1,239,520.000	
ARKEMA	2,220	116.000	257,520.000	
ADP	910	104.400	95,004.000	
SCOR SE	5,550	26.700	148,185.000	
GETLINK SE	14,200	12.895	183,109.000	
BOLLORE	28,600	4.766	136,307.600	
UCB SA	4,530	97.040	439,591.200	
KBC GROUP NV	8,900	72.580	645,962.000	
COLRUYT SA	1,600	41.350	66,160.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	96.820	387,280.000	
SOLVAY SA	2,600	99.220	257,972.000	
UMICORE	7,000	43.070	301,490.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	27,200	50.840	1,382,848.000	
AGEAS	6,290	46.310	291,289.900	
PROXIMUS	4,950	16.030	79,348.500	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	109.100	114,555.000	
SOFINA	600	406.800	244,080.000	
ARGENX SE	1,640	250.900	411,476.000	
PRYSMIAN SPA	8,850	33.290	294,616.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	39,443	17.800	702,085.400	
MEDIOBANCA SPA	22,365	9.724	217,477.260	
TENARIS SA	15,700	8.922	140,075.400	
UNICREDIT SPA	76,356	10.570	807,082.920	
TELECOM ITALIA SPA	343,982	0.471	162,049.920	
TELECOM ITALIA-RSP	203,950	0.445	90,859.720	
INTESA SANPAOLO	594,537	2.143	1,274,092.790	

ATLANTIA SPA	17,257	16.160	278,873.120	
POSTE ITALIANE SPA	17,700	11.195	198,151.500	
MONCLER SPA	7,400	64.600	478,040.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,850	54.960	211,596.000	
ENI SPA	90,400	11.800	1,066,720.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	13.085	255,157.500	
DIASORIN SPA	850	185.100	157,335.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,200	10.275	115,080.000	
NEXI SPA	15,850	13.795	218,650.750	
AMPLIFON SPA	4,300	42.760	183,868.000	
ENEL SPA	291,134	6.789	1,976,508.720	
SNAM SPA	70,100	4.997	350,289.700	
TERNA SPA	49,000	6.496	318,304.000	
EXOR NV	3,780	78.880	298,166.400	
CNH INDUSTRIAL NV	36,600	14.945	546,987.000	
FINECOBANK SPA	21,900	15.555	340,654.500	
STELLANTIS NV	73,200	15.568	1,139,577.600	
FERRARI NV	4,495	235.800	1,059,921.000	
TELEFONICA SA	186,727	3.961	739,719.010	
ENDESA SA	10,350	20.150	208,552.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	236,700	4.802	1,136,751.750	
IBERDROLA SA	211,934	9.916	2,101,537.540	
REPSOL SA	53,400	9.912	529,300.800	
GRIFOLS SA	9,800	16.730	163,954.000	
BANCO SANTANDER SA	619,950	2.783	1,725,630.820	
AMADEUS IT GROUP SA	16,050	58.080	932,184.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	24.630	253,689.000	
CAIXABANK SA	160,500	2.287	367,063.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	21.540	191,189.040	
AENA SME SA	2,600	129.350	336,310.000	
CELLNEX TELECOM SA	18,005	53.240	958,586.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	39,000	29.670	1,157,130.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,500	23.480	199,580.000	
ENAGAS SA	7,950	20.120	159,954.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	18.520	290,764.000	

	FERROVIAL SA	17,670	25.100	443,517.000	
	UPM-KYMMENE OYJ	19,150	32.700	626,205.000	
	NOKIA OYJ	191,300	5.019	960,134.700	
	WARTSILA OYJ ABP	17,000	12.335	209,695.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,700	15.440	304,168.000	
	ELISA OYJ	5,100	53.280	271,728.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	17,800	43.060	766,468.000	
	FORTUM OYJ	15,900	25.560	406,404.000	
	KESKO OYJ-B SHS	9,800	27.970	274,106.000	
	KONE OYJ-B	12,100	59.160	715,836.000	
	NESTE OYJ	15,100	42.980	648,998.000	
	ORION OYJ-CLASS B	3,600	36.930	132,948.000	
	VERBUND AG	2,430	89.750	218,092.500	
	OMV AG	5,300	47.250	250,425.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	10,000	38.760	387,600.000	
	VOESTALPINE AG	4,250	29.480	125,290.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	5,250	25.540	134,085.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,600	45.870	394,482.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,400	99.980	539,892.000	
	JERONIMO MARTINS	8,500	19.500	165,750.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	99,200	4.866	482,707.200	
	GALP ENERGIA SGPS SA	16,750	8.390	140,532.500	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,000	22.460	247,060.000	
	KERRY GROUP PLC-A	5,600	108.350	606,760.000	
	CRH PLC	28,100	43.400	1,219,540.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,030	122.050	735,961.500	
ユーロ　小計				ユーロ 172,118,377.880 (22,101,720,904)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,500	47.800	2,509,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	43.650	3,622,950.000	
	MTR CORP	58,500	42.000	2,457,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,000	96.750	4,934,250.000	
	SINO LAND CO	126,000	9.650	1,215,900.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	104,669	50.500	5,285,784.500	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	44.050	814,925.000	

	CLP HOLDINGS LTD	62,000	76.800	4,761,600.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	55,507	33.050	1,834,506.350	
	HONG KONG & CHINA GAS	422,475	11.840	5,002,104.000	
	HANG SENG BANK LTD	28,800	140.900	4,057,920.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	58,500	31.600	1,848,600.000	
	WH GROUP LTD	361,000	5.100	1,841,100.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,100	445.000	20,514,500.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	16.000	1,248,000.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	69,000	19.380	1,337,220.000	
	SJM HOLDINGS LTD	71,000	5.580	396,180.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	19.400	873,000.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	45.300	4,129,955.700	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	23,500	46.500	1,092,750.000	
	AIA GROUP LTD	461,400	83.900	38,711,460.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	28.800	1,555,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,000	40.250	2,535,750.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	20.200	1,371,580.000	
	ESR CAYMAN LTD	75,000	25.850	1,938,750.000	
	SANDS CHINA LTD	92,800	18.680	1,733,504.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	14.560	1,193,920.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	53,000	164.700	8,729,100.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	141,500	24.000	3,396,000.000	
	WYNN MACAU LTD	54,000	7.190	388,260.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 131,331,269.550 (1,916,123,223)	
合計				229,141,995,652 [229,141,995,652]	

(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	5,087	1,224,847.860	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	11,857	1,896,408.580	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,470	603,559.800	

		VORNADO REALTY TRUST	5,897	245,197.260	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,040	1,436,502.800	
		EQUITY RESIDENTIAL	13,050	1,125,171.000	
		EQUINIX INC	3,288	2,696,160.000	
		AMERICAN TOWER CORP	16,450	4,391,163.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	24,943	409,564.060	
		INVITATION HOMES INC	20,850	860,479.500	
		VICI PROPERTIES INC	19,800	556,974.000	
		VENTAS INC	13,800	677,856.000	
		WEYERHAEUSER CO	27,564	1,068,105.000	
		AGNC INVESTMENT CORP	19,600	310,268.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	15,750	2,926,822.500	
		IRON MOUNTAIN INC	10,260	480,783.600	
		SUN COMMUNITIES INC	4,100	806,675.000	
		PROLOGIS INC	26,952	4,131,202.560	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,100	1,046,826.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,450	582,532.500	
		DUKE REALTY CORP	13,800	820,410.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,400	831,600.000	
		WELLTOWER INC	15,300	1,255,212.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19,800	674,388.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	892,500.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,150	521,643.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	50,800	424,180.000	
		REALTY INCOME CORP	19,445	1,357,261.000	
		PUBLIC STORAGE	5,670	1,881,816.300	
		REGENCY CENTERS CORP	5,700	403,332.000	
		UDR INC	10,550	606,308.500	
		WP CAREY INC	6,400	504,000.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,300	230,408.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,300	1,738,537.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,900	994,945.000	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21,650	465,258.500	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 41,078,898.320 (4,673,546,262)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	23,562	176,950.620	

	SEGRO PLC	43,100	610,942.500	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	154,073.700	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 941,966.820 (142,764,491)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	36,150	392,227.500	
	LENDLEASE GROUP	23,500	249,100.000	
	TRANSURBAN GROUP	95,400	1,306,026.000	
	SYDNEY AIRPORT	45,800	377,392.000	
	APA GROUP	41,400	401,580.000	
	SCENTRE GROUP	181,922	553,042.880	
	GPT GROUP	68,160	353,750.400	
	MIRVAC GROUP	136,100	394,690.000	
	STOCKLAND	83,800	364,530.000	
	GOODMAN GROUP	58,200	1,428,810.000	
	VICINITY CENTRES	137,273	232,677.730	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 6,053,826.510 (492,115,557)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,900	169,534.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	128,296.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 297,830.000 (26,584,306)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	124,500	372,255.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	190,870	408,461.800	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	114,300	218,313.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77,500	161,975.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 1,161,004.800 (96,607,209)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	276,000.000	
	GECINA SA	1,600	190,960.000	
	KLEPIERRE	7,150	136,243.250	

		COVIVIO	1,750	128,380.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 731,583.250 (93,942,605)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	81,500	5,599,050.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	703,800.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138,000	1,465,560.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 7,768,410.000 (113,341,102)	
投資証券　合計				5,638,901,532 [5,638,901,532]	
合計				5,638,901,532 [5,638,901,532]	

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　598銘柄 投資証券　36銘柄	97.3%	2.7%	74.6%
イギリス・ポンド	株式　82銘柄 投資証券　3銘柄	98.6%	1.4%	4.2%
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式　53銘柄 投資証券　11銘柄	89.1%	10.9%	1.9%
カナダ・ドル	株式　88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　4銘柄	87.1%	12.9%	0.3%
スイス・フラン	株式　40銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式　41銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式　18銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式　7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式　11銘柄	100%	-%	0.2%

ユーロ	株式 230銘柄 投資証券 4銘柄	99.6%	0.4%	9.5%
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 3銘柄	94.4%	5.6%	0.9%

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。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	635,260,286	700,635,449
コール・ローン	1,397,690,109	1,607,697,128
国債証券	215,573,016,059	230,341,773,353
派生商品評価勘定	162,494	431,286
未収入金	21,902,130	2,787,836
未収利息	1,222,948,097	1,240,818,660
前払費用	58,449,028	21,860,457
流動資産合計	218,909,428,203	233,916,004,169
資産合計	218,909,428,203	233,916,004,169
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	69,348	6,725,909
未払金	2,087,434	252,029,658
未払解約金	71,815,810	25,134,000
流動負債合計	73,972,592	283,889,567
負債合計	73,972,592	283,889,567
純資産の部		
元本等		

元本　※1	72,688,498,430	74,475,307,643
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	146,146,957,181	159,156,806,959
元本等合計	218,835,455,611	233,632,114,602
純資産合計	218,835,455,611	233,632,114,602
負債純資産合計	218,909,428,203	233,916,004,169

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1．※1　期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	66,118,107,712円	72,688,498,430円
期中追加設定元本額	13,500,674,811円	10,294,827,028円
期中一部解約元本額	6,930,284,093円	8,508,017,815円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	601,675,980円	498,388,691円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	12,401,222円	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	102,686,952円	79,498,163円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	29,631,947円	22,023,940円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	339,511,943円	312,397,465円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	90,339,707円	211,430,078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）	462,489,583円	505,972,682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）	1,814,096,236円	2,311,980,333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）	654,015,808円	842,742,592円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,055,376円	744,003円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	957,155円	7,190,607円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	691,990,376円	1,686,822,876円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	989,492,660円	1,443,360,479円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	49,115,601円	229,923,693円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	48,408,053,236円	49,590,694,433円
ダイワ・ライフ・バランス３０	819,754,500円	964,870,268円
ダイワ・ライフ・バランス５０	459,770,424円	601,682,079円
ダイワ・ライフ・バランス７０	279,428,323円	393,993,399円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	459,816,979円	578,219,728円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	336,784,366円	439,097,748円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	108,589,082円	160,496,213円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	8,547,742円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	19,902,336円	28,543,954円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,844,467円	10,558,255円
ダイワつみたてインデックス外国債券	163,786,187円	599,439,774円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,047,233円	3,367,466円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	977,653円	1,453,811円

	ダイワつみたてインデックスバランス７０	951,206円	1,909,053円
	ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	－円	317,987円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	174,483,363円	163,610,849円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	131,594,279円	135,308,646円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,234,846,474円	3,912,241,392円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	250,419,145円	231,133,046円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,610,494円	143,219,876円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	34,513,413円	43,309,779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）	4,864,458,623円	2,367,106,464円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,832,536,410円	5,825,688,039円
	ダイワライフスタイル２５	33,396,711円	33,014,942円
	ダイワライフスタイル５０	59,767,812円	65,372,616円
	ダイワライフスタイル７５	16,157,426円	17,425,714円
計		72,688,498,430円	74,475,307,643円
2.	期末日における受益権の総数	72,688,498,430口	74,475,307,643口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2020年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	6,708,826,689	△9,023,697,557
合計	6,708,826,689	△9,023,697,557

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2020年11月30日 現在				2021年11月30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								
売　建	5,665,440	－	5,665,440	0	－	－	－	－
マレーシア・リンギット	5,665,440	－	5,665,440	0	－	－	－	－
買　建	2,102,427,594	－	2,102,520,740	93,146	1,712,299,150	－	1,706,004,527	△6,294,623
アメリカ・ドル	650,675,209	－	650,674,400	△809	755,807,619	－	756,096,737	289,118
イギリス・ポンド	56,666,132	－	56,662,860	△3,272	66,758,721	－	66,834,123	75,402
オーストラリア・ドル	28,675,523	－	28,678,740	3,217	－	－	－	－
カナダ・ドル	37,572,016	－	37,561,640	△10,376	61,806,931	－	59,980,905	△1,826,026
シンガポール・ドル	25,689,605	－	25,688,910	△695	31,361,148	－	31,422,799	61,651
スウェーデン・クローナ	16,083,586	－	16,069,300	△14,286	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	29,879,064	－	29,877,480	△1,584	53,986,987	－	52,312,950	△1,674,037
ユーロ	1,257,186,459	－	1,257,307,410	120,951	742,577,744	－	739,357,013	△3,220,731
合計	2,108,093,034	－	2,108,186,180	93,146	1,712,299,150	－	1,706,004,527	△6,294,623

（注）　1．時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.0106円	3.1370円
（1万口当たり純資産額）	(30,106円)	(31,370円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,758,884.840	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,441,219.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,781,042.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,729,981.280	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,241,622.740	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,478,371.010	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,131,664.640	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	718,961.820	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,029,266.100	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	906,520.310	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	884,786.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	928,145.700	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	989,168.460	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,203,174.880	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,627,372.320	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,239,728.490	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	758,936.160	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	729,272.850	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,319,851.800	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,540,321.260	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,500,472.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,688,700.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,453,056.700	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,352,472.100	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,440,545.490	

		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,030,202.070	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,843,129.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,924,540.800	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,981,459.890	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,742,943.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,954,952.190	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,601,708.460	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,541,421.340	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,858,314.100	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,168,426.560	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,672,849.760	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,178,424.980	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,758,136.590	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,315,635.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,198,241.490	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,430,848.060	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,348,094.540	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,169,622.790	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,284,902.500	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,946,244.770	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,829,910.820	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,019,925.160	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,405,969.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,950,724.310	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	2,209,690.480	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,112,552.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	795,123.040	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,597,444.360	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,399,222.950	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,094,136.320	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,970,910.960	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,605,510.180	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,496,231.760	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,006,992.780	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,680,569.470	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,896,255.560	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,107,922.400	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	3,136,832.910	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,547,150.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,047,460.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,485,212.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,955,473.600	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,819,503.800	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,439,552.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,547,459.750	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,508,237.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,554,575.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,785,690.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,570,427.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,588,275.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,831,209.200	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,569,503.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,845,000.000	3,466,205.750	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,379,143.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,706,929.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,778,496.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,445,140.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,097,380.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,473,257.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,479,776.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,212,051.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,110,730.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,950,000.000	3,458,167.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,060,840.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,594,800.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,541,300.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,797,770.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,104,835.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,646,685.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,324,224.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,919,420.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,586,520.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,879,780.500	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,396,789.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,734,056.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,862,405.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,672,480.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,984,390.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,064,024.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,290,656.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,101,250.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,585,250.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,024,526.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,784,619.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,589,625.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,588,850.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,187,950.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,000,804.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,335,964.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,202,120.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,670,700.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,745,116.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,829,752.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,685,925.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,132,300.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,688,275.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,182,320.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,121,726.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	5,962,829.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,214,920.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,094,140.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,718,190.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,607,900.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,141,398.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,166,400.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,656,625.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,824,663.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,644,725.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,431,076.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,620,875.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,646,076.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,155,606.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,634,120.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,951,368.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,132,630.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,593,625.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,892,288.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,650,590.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,583,375.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,767,351.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	4,961,146.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,828,756.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,053,560.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,555,250.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,060,810.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,020,350.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,066,090.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	5,988,703.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	4,988,655.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,045,140.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,061,170.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,043,710.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,571,775.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,569,900.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,056,840.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,726,945.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,280,757.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	5,016,750.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,250,496.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,533,272.000	

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	298,662.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,241,028.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,209,996.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,479,660.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,197,248.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,551,488.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,272,876.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,488,625.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,649,564.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,306,808.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,799,760.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,370,700.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,360,000.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,926,170.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,489,880.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,308,075.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,357,795.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	995,740.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,308,744.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,472,665.000	

		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,301,100.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,760,900.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,920,589.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,227,500.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,347,960.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,988,900.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,312,085.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,794,680.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,400,460.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,173,414.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,663,579.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,301,866.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,498,075.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,877,480.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,815,280.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	6,389,280.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,635,390.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	2,997,510.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,960,719.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,799,200.000	

		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,975,250.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,793,350.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	971,830.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,697,926.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,963,120.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,755,000.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,879,704.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,369,370.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,950,950.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	1,997,260.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,852,700.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,936,300.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,648,582.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,924,280.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,996,320.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,983,500.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,992,590.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	7,000,000.000	6,956,250.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,937,480.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,980,170.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	8,800,920.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,046,807.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,426,695.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,390,038.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,956,860.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,100,000.000	6,787,653.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,990,266.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	996,480.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,968,400.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,949,720.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,977,560.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,494,315.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,955,850.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,939,800.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,450,775.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,971,260.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	9,300,000.000	9,076,521.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	7,083,264.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,000,000.000	2,901,780.000	
		0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,488,375.000	

		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,855,340.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,871,850.000	
		0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,984,520.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,908,200.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,904,450.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,421,775.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	7,000,000.000	6,926,710.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,451,175.000	
		0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,494,780.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,991,480.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 955,962,463.000 (108,759,849,416)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	971,581.320	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,767,478.700	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,528,434.500	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,161,548.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,350,000.000	2,596,256.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,303,315.500	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,461,535.500	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,017,790.000	

		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,599,525.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	940,000.000	1,325,456.400	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,824,714.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	1,435,398.800	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,018,351.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	809,720.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,910,754.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,232,042.700	
		0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,294,572.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,219,707.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	679,290.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,474,380.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,551,104.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,014,475.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,234,285.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,289,951.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,300,000.000	1,227,915.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	483,795.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	100,000.000	98,722.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	322,230.000	

		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	99,045.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	606,000.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	100,000.000	98,430.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	298,977.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	348,462.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,296,846.460	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	3,000,547.200	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,685,763.840	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,386,249.740	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,155,689.490	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,794,401.440	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,341,747.460	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,494,859.520	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,009,158.720	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	2,155,440.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,427,741.100	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,207,882.940	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,224,778.400	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,403,001.900	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,454,773.970	

		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,714,416.960	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,124,195.080	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,632,434.160	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	2,889,754.560	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,160,250.000	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	2,607,498.280	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 93,472,673.140 (14,166,718,341)	
	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	2,567,200.000	
		4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,901,682.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,080,546.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,168,360.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,422,130.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,941,858.000	
		1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,012,990.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,166,152.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,987,254.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,541,265.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,413,752.000	

		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,611,840.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,660,594.000	
		0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	2,002,720.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	200,888.000	
		0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	905,121.000	
	イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 30,584,352.000 (1,101,379,217)	
	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,168,000.000	1,251,500.320	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,336,617.530	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,071,077.830	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,754,000.000	1,959,586.340	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,928,067.320	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,609,887.760	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,748,000.000	3,098,232.600	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,361,043.180	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,433,125.500	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	914,237.280	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,795,794.880	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,232,553.180	

		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,400,512.240	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,943,766.000	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,350,000.000	1,377,229.500	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,060,303.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	3,061,888.200	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,491,748.000	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,784,648.400	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,236,118.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,353,992.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,200,000.000	3,011,104.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,217,104.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,540,336.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,330,875.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,153,548.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,095,325.000	
オーストラリア・ドル　小計				**オーストラリア・ドル** 49,050,221.060 (3,987,292,470)	
オフショア・人民元			**オフショア・人民元**	**オフショア・人民元**	
		3.72% China Government Bond 20510412	3,000,000.000	3,163,710.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	3,800,000.000	3,851,718.000	

	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,504,995.000	
	2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20230520	10,000,000.000	10,019,100.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,517,930.000	
オフショア・人民元　小計			オフショア・人民元 27,057,453.000 (482,437,093)	
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	487,818.450	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,280,377.160	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,581,482.110	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,444,781.800	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,226,442.030	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,251,817.820	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,265,442.290	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,454,203.100	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,566,696.600	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,196,529.360	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	974,930.280	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,211,542.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	671,749.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,352,288.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,324,518.000	

		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,760,938.300	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,287,807.600	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,232,628.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,414,560.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,377,515.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	701,183.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,806,536.800	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	697,333.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,820,640.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,004,534.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,177,992.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,491,315.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,091,200.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	294,336.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,400,000.000	2,374,896.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	98,956.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	988,830.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	700,000.000	663,516.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	991,470.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	197,736.000	

	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	500,000.000	497,110.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	295,002.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 50,556,653.200 (4,512,686,865)	
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	850,358.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	973,561.940	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	882,619.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	448,848.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	692,478.710	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	655,188.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	678,750.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	546,008.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	775,376.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	465,750.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	779,062.500	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	456,030.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	585,750.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	502,519.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	370,475.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	685,150.000	

	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	729,600.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	300,000.000	297,486.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	196,396.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 11,571,406.650 (962,856,747)	
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	7,006,007.750	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,305,875.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,291,689.350	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,537,707.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,268,008.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,991,185.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,757,198.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,965,720.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 52,123,391.200 (653,106,092)	
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	24,709,912.920	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,053,021.120	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,555,132.080	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,302,110.000	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,134,903.800	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,338,399.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,700,000.000	2,714,418.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	502,700.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	1,016,880.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 63,327,476.920 (1,093,665,526)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	8,311,800.560	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,254,336.450	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,457,366.200	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,347,855.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,505,180.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,600,450.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,898,702.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,721,664.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,393,950.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 42,491,305.110 (535,815,357)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,259,171.160	

		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,050,300.800	
		2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,851,309.000	
		2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,845,318.000	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,701,043.600	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,332,850.000	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,853,100.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,566,620.000	
		Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	961,850.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	1,300,000.000	1,126,580.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	970,021.380	
		4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,682,225.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,553,457.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,612,807.250	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 40,366,653.690 (1,108,694,364)	
	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	2,401,665.840	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,253,816.080	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,595,301.800	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,362,816.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	754,735.570	

		3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,016,505.490	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,432,693.730	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,920,853.280	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	800,000.000	864,304.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,098,941.760	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,803,474.990	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,265,640.200	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,332,570.960	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	979,048.200	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	672,841.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,608,915.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,226,949.500	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,080,182.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,241,928.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,734,000.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,284,276.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	644,586.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	672,945.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	1,957,902.800	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,297,140.000	

	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	407,676.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,281,800.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,658,580.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,650,000.000	1,586,557.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,300,000.000	1,207,973.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 39,646,620.200 (1,064,579,152)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	31,290,000.000	29,442,951.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	18,949,898.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	24,233,874.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,281,184.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	3,000,000.000	2,747,100.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	30,663,993.330	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	25,652,888.310	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	28,034,563.840	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	10,585,883.340	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	31,129,921.920	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	17,474,815.720	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	23,515,000.000	23,660,557.850	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	18,828,532.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,956,948.720	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 286,643,112.330 (1,505,707,605)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	393,818.880	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	295,288.020	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	850,244.290	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	709,324.000	

		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	455,990.400	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	843,872.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	757,053.100	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	528,180.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	529,530.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	203,988.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	307,132.500	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	399,244.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	506,100.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	371,264.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	610,392.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	204,824.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,471,128.310	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,196,735.320	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	988,279.040	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	325,384.800	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	911,277.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,347,072.000	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	894,585.600	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,283,772.000	

		0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,033,566.800	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	814,520.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	991,662.000	
		Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,009,990.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	747,894.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	374,352.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	328,958.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,206,756.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	489,768.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	599,124.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,786,532.480	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,952,162.820	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,311,094.760	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	1,995,049.440	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,506,322.280	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	935,065.600	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	957,324.200	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,176,802.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,087,411.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	831,493.800	

		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	696,306.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,603,135.700	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	737,587.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,630,500.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	870,765.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,244,509.800	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	644,998.200	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,228,704.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,594,144.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	680,000.000	596,958.400	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,120,723.360	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,646,123.520	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,008,682.440	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,293,548.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,049,178.880	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,369,949.680	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,819,638.550	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,918,039.750	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,394,818.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,384,320.070	

		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,574,000.000	4,431,964.680	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,525,344.720	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,450,199.100	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,879,741.010	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,677,351.000	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,650,304.810	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,435,325.610	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,684,985.520	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,239,047.500	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,283,646.840	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,336,895.160	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,488,839.040	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,497,633.600	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,393,872.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,446,625.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	3,738,530.500	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,028,174.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,267,028.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,323,640.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,112,110.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,250,000.000	2,261,002.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,815,555.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,946,664.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,070,140.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,867,500.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,251,504.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	931,446.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	900,000.000	917,523.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,553,700.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,118,029.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	2,600,000.000	2,682,576.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	724,332.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	100,826.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,010,270.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,012,710.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	101,457.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	700,000.000	696,878.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,795,551.200	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,929,773.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,956,364.800	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,738,012.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,460,408.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,364,607.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	103,004.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,266,550.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,340,560.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,243,605.800	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,815,583.750	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,758,369.850	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	5,242,745.550	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,263,307.650	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,453,894.360	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,808,608.200	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,478,311.040	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,664,000.000	6,425,080.480	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,534,684.880	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,298,561.080	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	6,777,820.700	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,121,157.080	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,198,560.150	

		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,462,872.600	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,243,732.930	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,255,647.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,627,838.800	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,421,750.880	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,420,000.000	6,210,994.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	3,959,876.550	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	4,724,060.660	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,838,690.420	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	4,196,812.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,182,379.600	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,668,260.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,790,129.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,424,576.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,709,232.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,454,375.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,307,786.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,456,032.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,556,903.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	4,586,031.000	

		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,830,000.000	3,909,319.300	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,253,718.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,424,048.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,769,196.700	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,067,200.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	2,203,696.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	4,024,520.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	880,000.000	731,068.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,560.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,000,000.000	985,570.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	3,700,000.000	3,684,608.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	1,600,000.000	1,634,768.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	700,000.000	693,560.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	599,988.760	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,562,446.030	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,507,608.550	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	832,527.500	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	3,023,450.430	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,509,861.920	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,443,724.000	

		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	3,226,252.500	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,624,976.200	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,850,371.650	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	2,038,252.740	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,358,356.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,422,596.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,457,149.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,253,724.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	980,199.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,431,304.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	821,432.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,050,000.000	1,002,340.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,322,113.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	892,260.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	600,000.000	613,950.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,069,705.140	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,495,591.800	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,248,934.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,957,813.920	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,968,324.510	

		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,621,994.360	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,198,812.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,040,010.800	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,923,032.300	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,384,209.450	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,543,380.560	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,617,753.600	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,123,589.400	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,580,953.500	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,112,038.400	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,719,120.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,667,281.600	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,367,223.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,506,509.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,959,551.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,675,392.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,597,557.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,303,091.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,933,991.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,367,873.000	

		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,947,366.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,316,424.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,702,318.500	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,595,221.600	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	2,388,012.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,236,775.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,311,584.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,289,021.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,565,862.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,993,575.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	744,869.200	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,318,824.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,421,534.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,764,644.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,533,795.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,034,200.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,454,422.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,025,220.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,567,520.000	
		0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,316,523.000	

		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,273,370.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,729,461.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,300,000.000	1,346,657.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,302,668.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,107,524.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	1,167,024.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	661,633.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,874,787.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,700,000.000	2,619,405.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	677,110.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,093,598.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,508,295.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221129	100,000.000	100,511.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	446,227.600	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	798,800.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,895,250.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,008,060.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	500,000.000	502,775.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,100,000.000	1,089,638.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	4,421,372.500	

		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,184,497.240	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,707,788.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,331,295.700	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,734,044.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,162,824.280	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,448,975.450	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,470,011.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,523,035.240	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,460,360.600	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,068,564.400	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,089,065.700	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,029,496.760	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,880,168.060	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,431,171.400	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,439,808.500	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,841,103.060	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,357,282.560	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	3,103,101.120	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,705,514.920	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,226,515.290	

		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,103,949.600	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,401,916.260	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,424,214.780	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,634,911.600	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,009,234.350	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,235,828.770	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	661,284.000	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	664,573.950	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,159,859.730	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	1,211,063.420	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,144,343.770	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	653,950.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	856,576.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	838,440.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	839,955.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,033,011.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	824,180.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	351,890.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	822,552.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	811,280.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	786,224.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	398,576.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,144,374.000	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,201,289.710	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,082,217.500	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	906,906.160	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	723,147.620	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,008,138.600	

		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,005,348.470	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	992,739.600	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	996,485.080	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	781,363.820	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	470,725.010	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	460,312.140	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	603,650.190	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	564,194.370	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,792,068.280	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,189,438.350	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,352,864.240	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,411,506.880	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,006,409.320	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,715,466.240	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,433,283.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,833,351.600	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,073,964.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,107,315.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,237,554.500	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,617,888.000	

		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,617,824.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,763,710.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,439,624.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	3,171,991.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,760,512.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,126,094.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,346,299.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,900,072.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,391,688.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,483,394.600	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,536,700.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	1,321,488.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,521,968.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,146,906.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,350,193.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	506,350.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,148,652.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	303,627.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	594,152.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	500,525.000	

		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	898,803.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,400,000.000	1,410,052.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	600,270.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	300,000.000	302,373.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,393,596.390	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,384,426.080	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,666,938.340	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,881,838.420	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,321,703.340	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,311,296.030	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,537,542.050	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,096,215.220	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,087,412.060	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,397,535.800	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,399,499.810	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,180,593.000	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,300,346.090	
	ユーロ　小計			ユーロ 704,049,412.880 (90,406,985,108)	
国債証券　合計				230,341,773,353 [230,341,773,353]	
合計				230,341,773,353 [230,341,773,353]	

（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	255銘柄	100%	47.1%
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	100%	6.2%
イスラエル・シュケル	国債証券	16銘柄	100%	0.5%
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	100%	1.7%
オフショア・人民元	国債証券	5銘柄	100%	0.2%
カナダ・ドル	国債証券	37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	9銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	349銘柄	100%	39.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	1,036,838,545円
Ⅱ	負債総額	4,660,637円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,032,177,908円
Ⅳ	発行済数量	655,764,843口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5740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11月30日

Ⅰ	資産総額	187,880,194,267円
Ⅱ	負債総額	5,216,902,565円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	182,663,291,702円
Ⅳ	発行済数量	139,094,932,448口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3132円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	95,197,080,993円
Ⅱ	負債総額	117,470,022円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	95,079,610,971円
Ⅳ	発行済数量	66,960,247,306口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4199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11月30日

Ⅰ	資産総額	250,978,162,380円
Ⅱ	負債総額	200,951,017円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	250,777,211,363円
Ⅳ	発行済数量	61,024,141,090口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.1095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11月30日

Ⅰ	資産総額	233,916,004,169円
Ⅱ	負債総額	283,889,567円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	233,632,114,602円
Ⅳ	発行済数量	74,475,307,643口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1370円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2021年11月末日現在

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

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年11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	60	175,229
追加型株式投資信託	772	21,068,563
株式投資信託　　合計	832	21,243,792
単位型公社債投資信託	78	215,962
追加型公社債投資信託	14	1,474,160
公社債投資信託　合計	92	1,690,122
総合計	924	22,933,914

３【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）は、改正府令附則第３条第１項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第62期事業年度（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。

また、第63期事業年度に係る中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

３．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
流動資産計	36,088	37,539

固定資産				
有形固定資産	※1	217	※1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183
長期差入保証金		1,069		1,068
繰延税金資産		1,431		973
その他		33		30
固定資産計		18,424		18,283
資産合計		54,512		55,822

（単位:百万円）

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

固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574
利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△363	947
評価・換算差額等合計	△363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51

諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37
租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860

税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	△78	△ 109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,302	△1,302	△1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△410	△410	△410
当期変動額合計	△410	△410	△410
当期末残高	△363	△363	38,430

当事業年度（自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,564	△10,564	△10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,175	△1,175	△1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△363	△363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年２

月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（追加情報）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）第44－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年３月30日）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年３月30日）

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

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

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

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

（注記に関する表示方法の変更）

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

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

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度（2020年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2021年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年６月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 ３月31日	2019年 ６月24日

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

2020年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　10,564百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,050円
④ 基準日　2020年３月31日
⑤ 効力発生日　2020年６月24日

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年６月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 ３月31日	2020年 ６月24日

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

2021年６月22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日

⑤　効力発生日　　2021年６月23日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（３）　金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ⅰ）為替変動リスクの管理

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

（ⅱ）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

前事業年度（2020年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度（2021年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

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

れている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2020年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,944百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2021年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2020年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	60	55	5
（２）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	△764
小計	27,589	28,354	△764
合計	30,654	31,181	△526

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2021年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	85	55	30

（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）	当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	△183	△ 378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

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

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

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度181百万円、当事業年度186百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750

賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	△173	△ 254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△ 159
その他有価証券評価差額金	△71	△ 453
繰延税金負債合計	△230	△ 612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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

前事業年度（2020年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2021年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

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

［関連情報］
１.サービスごとの情報
単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,603	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,727	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,061	長期差入保証金	1,054

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	527	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
１株当たり純資産額　14,732.52円	１株当たり純資産額　14,784.79円
１株当たり当期純利益　4,050.66円	１株当たり当期純利益　3,599.54円

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,556	9,389
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （2021年９月30日）
資産の部	
流動資産	
現金・預金	2,139
有価証券	250
未収委託者報酬	13,857
関係会社短期貸付金	16,300
その他	369
流動資産合計	32,916
固定資産	

有形固定資産	※1	211
無形固定資産		
ソフトウエア		1,633
その他		134
無形固定資産合計		1,768
投資その他の資産		
投資有価証券		11,373
関係会社株式		3,705
繰延税金資産		786
その他		1,246
投資その他の資産合計		17,111
固定資産合計		19,091
資産合計		52,007

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2021年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	※2	927
流動負債合計		13,635
固定負債		
退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2
固定負債合計		2,571
負債合計		16,206
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,594
利益剰余金合計	7,968
株主資本合計	34,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,162
評価・換算差額等合計	1,162
純資産合計	35,801
負債・純資産合計	52,007

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		37,075
その他営業収益		295
営業収益合計		37,371
営業費用		
支払手数料		15,707
その他営業費用		6,525
営業費用合計		22,233
一般管理費	※１	5,737
営業利益		9,400
営業外収益	※２	228
営業外費用	※３	87
経常利益		9,540
特別利益		―
特別損失	※４	129
税引前中間純利益		9,411
法人税、住民税及び事業税		2,910
法人税等調整額		92
中間純利益		6,407

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△9,388	△9,388	△9,388
中間純利益	-	-	-	6,407	6,407	6,407
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△2,980	△2,980	△2,980
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,594	7,968	34,638

	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	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	△2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

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とおりであります。

建物	**10～18年**
器具備品	**４～20年**

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。

当社の日々のサービス提供時に当履行義務が充足されるため、一定期間にわたり収益を認識しております。

５．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。

６．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

７．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。

（会計方針の変更）

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年３月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。これによる当中間会計期間の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2021年９月30日現在）
有形固定資産	307百万円

※２　消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

３　保証債務

当中間会計期間（2021年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券売却益	117百万円
時効成立分配金・償還金	28百万円
受取配当金	26百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券売却損	58百万円
未収入金清算費用	9百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券評価損	102百万円
出資金評価損	27百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	―	―	2,608

合計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月22日定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2021年９月30日）

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

中間貸借対照表計上額、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、2019年７月４日公表の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、「2019年適用指針」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。

（１）時価をもって中間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）

	中間貸借対照表計上額			
	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）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって中間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、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、2019年適用指針第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格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中間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	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　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

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	85	55	30
（２）その他	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,179	3,398	△219
小計	3,179	3,398	△219
合計	10,956	9,294	1,661

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えており、かつ、内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）
１株当たり純資産額	13,724.67円

１株当たり中間純利益	2,456.52円

（注１） 潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注２） １株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）	
中間純利益(百万円)	6,407
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,407
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2021年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	
	日本生命保険相互会社	1,400,000百万円	（注9）	
	三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	（注8）	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	（注3）	

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

２【関係業務の概要】

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

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2021年５月21日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年1月7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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル２５の2020年12月1日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワライフスタイル２５の2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

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

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

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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11月25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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井	康治

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、「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2021年４月１日から2022年３月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。