

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2022年3月11日提出
【計算期間】	第6計算期間 (自 2020年12月19日 至 2021年12月20日)
【ファンド名】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2050
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

#### < 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

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

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2050年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2050年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

#### < 2021年12月時点の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	46%	30%	7%	6%	6%	5%

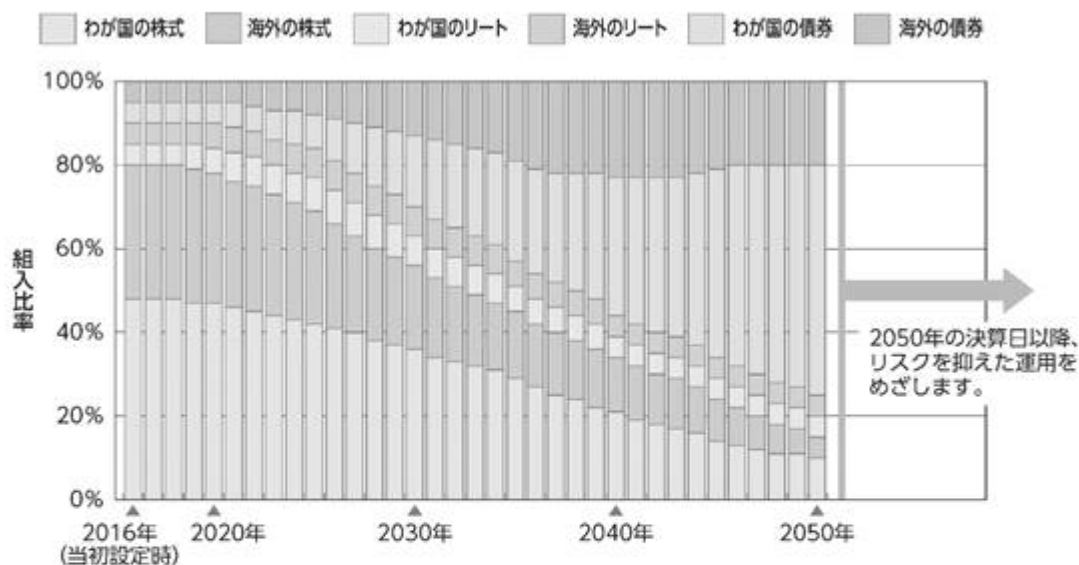
#### < 当初設定時の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	48%	32%	5%	5%	5%	5%

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

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

## ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2021年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2020年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なる場合があります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。
- (注4) 投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

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

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

### 運用プロセス



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

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

東証株価指数（TOPIX）は、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。



### 3 海外の株式への投資にあたっては、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います。

#### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークである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っています。

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

#### 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

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

## 運用プロセス



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

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

## 東証REIT指数とは

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

## 【算出方法の概要】

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

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

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

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

## 5

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

## 運用プロセス



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

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

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

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

## [特徴]

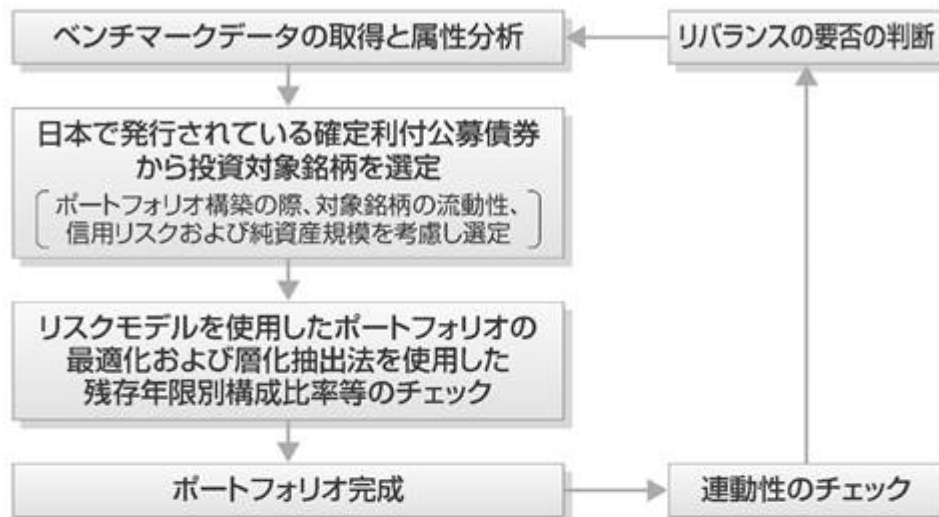
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

## 6

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

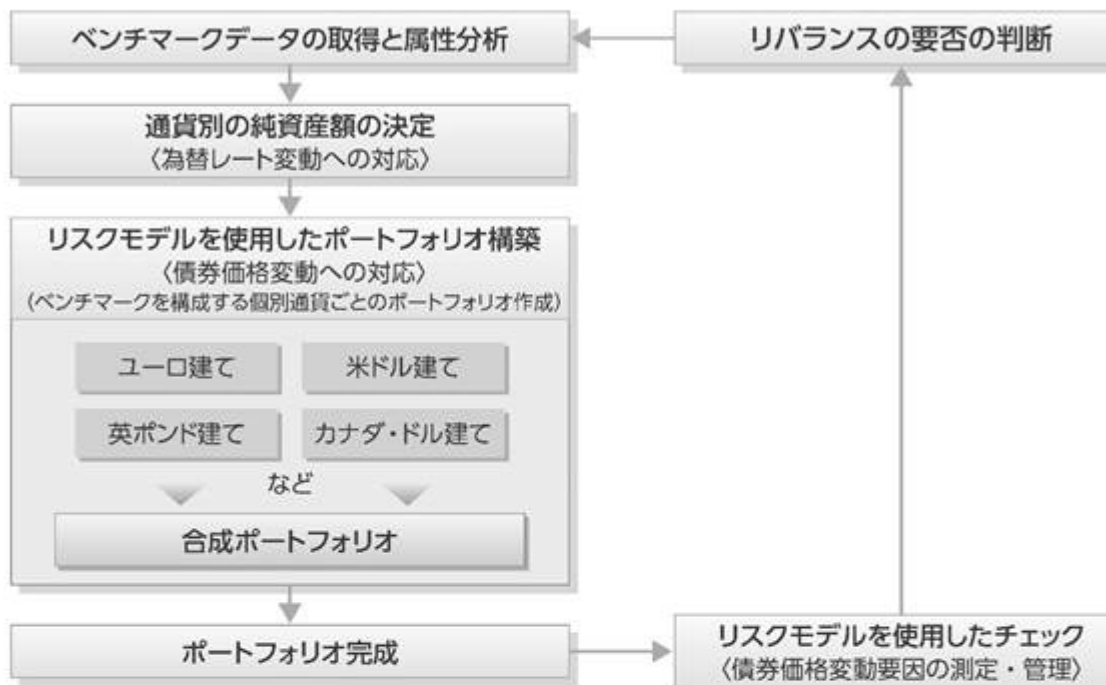
## NOMURA－BPI総合指数とは

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

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

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

### 運用プロセス



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

#### ①為替レート変動への対応

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

#### ②債券価格変動への対応

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

#### ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

### FTSE世界国債インデックスとは

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

## 8

2050年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

#### NOMURA-BPI総合短期指数とは

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

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

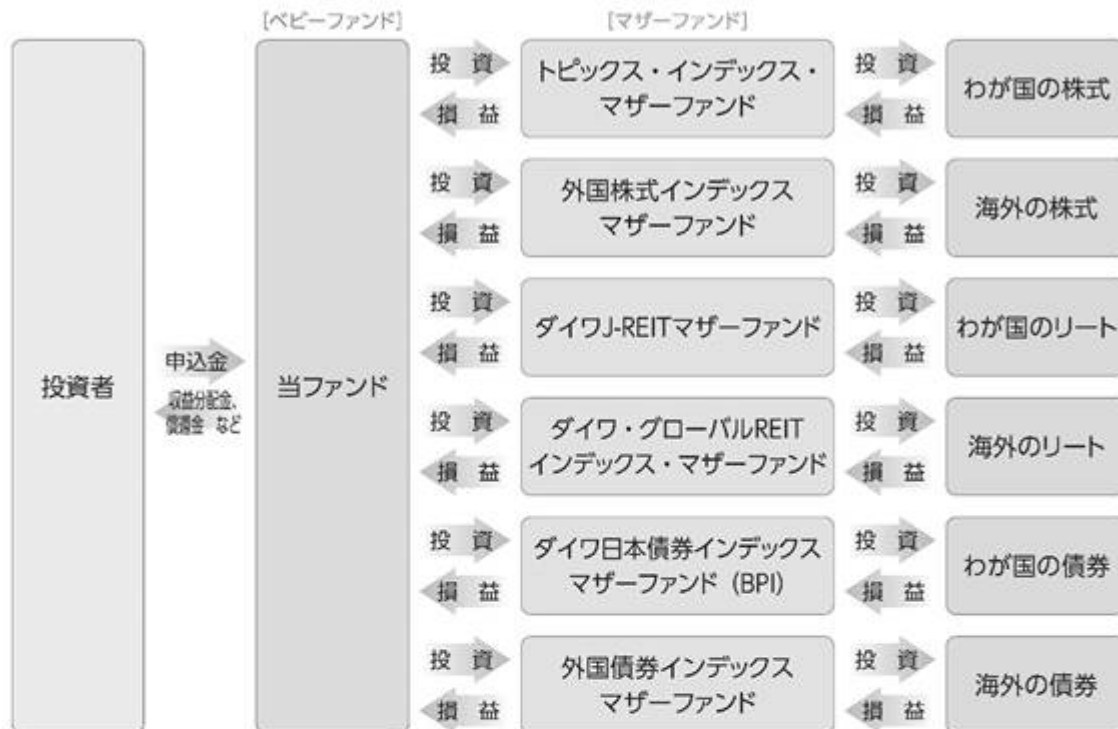
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

## 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。

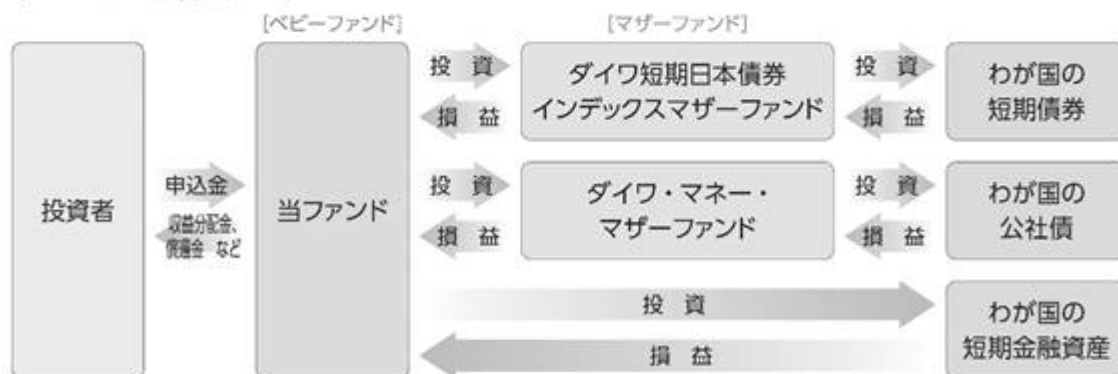
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

〈2050年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドおよびダイワ・マネー・マザーファンドに投資することがあります。

〈2050年の決算日から〉



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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



9

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

10

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

（注）第1計算期間は、2016年12月18日（休業日の場合翌営業日）までとします。

#### 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

#### (2) 【ファンドの沿革】

2016年5月13日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

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



委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）( 2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図	2	損益 信託金( 3)
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
		損益 投資
投資対象	内外の株式・債券・リート（REIT）および短期金融資産 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2021年12月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

- |             |  |
|-------------|--|
| 1959年12月12日 | 大和証券投資信託委託株式会社として設立                              |
| 1960年 2月17日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得                    |
| 1960年 4月 1日 | 営業開始   |
| 1985年11月 8日 | 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。                         |
| 1995年 5月31日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。        |
| 1995年 9月14日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。 |

2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。

(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

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

ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2050年に近づくにしながら株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

#### 当初設定時の基本配分比率

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

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

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

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券  
.....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券  
.....信託財産の純資産総額の 5%

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．2050年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドおよびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

## (2)【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から8．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9．から12．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券

6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

8. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券

9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

10. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9．の証券の性質を有するもの

11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

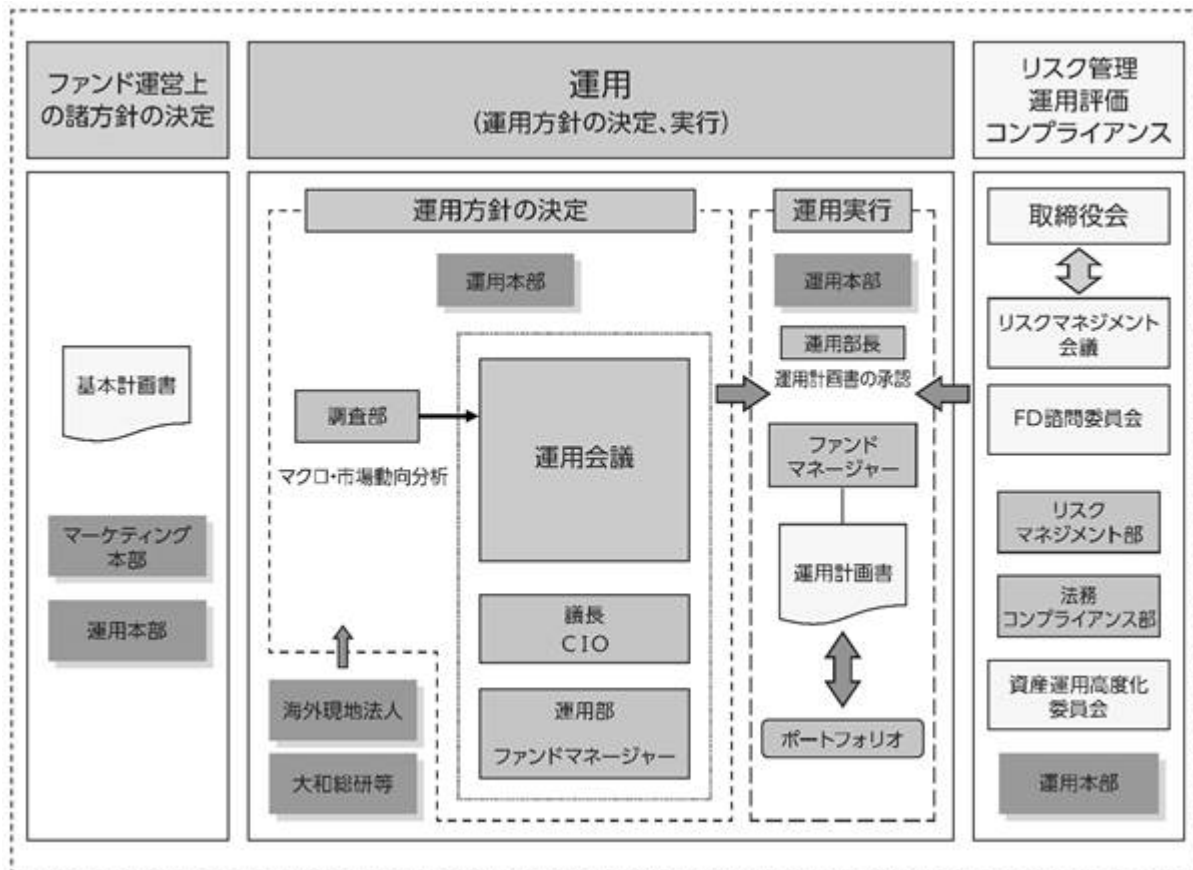
3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## (3) 【運用体制】

## 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

## イ．基本計画書の策定

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

## ロ．基本的な運用方針の決定

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

## ハ．運用計画書の作成・承認

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

## 職務権限

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

## イ．CIO (Chief Investment Officer) (3名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

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12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】

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。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

#### 外国為替予約取引（信託約款）

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

#### 信用リスク集中回避（信託約款）

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

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### <参考> 各マザーファンドの概要

### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

## (2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

## (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式(預託証券を含みます。)を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

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

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

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

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

1. 預金



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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 3. ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

- イ. 東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」(配当込み、以下同じ。)に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄(採用予定を含みます。)とし、組入比率を高位に保ちます。
- ハ. 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限ります。)

## 八．約束手形

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

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 4．新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）
- 5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

#### 株式

株式への直接投資は、行ないません。

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

#### 同一銘柄の投資信託証券

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

#### 先物取引

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

## 4．ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

- イ. 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク(S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース))をいいます。以下同じ。)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ. 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ. 保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
4. 外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

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

## 5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

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

- ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク(NOMURA - BPI総合短期指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、NOMURA - BPI総合短期指数が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

### (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受



取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。

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

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

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

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を

超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

## 7．外国債券インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 8. ダイワ・マネー・マザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

本邦通貨表示の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ. わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。

ロ. 邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位(A-2格相当)以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。

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

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．転換社債の転換、新株予約権（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券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

9．投資法人債券（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。）

10．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。）

11．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

12．外国の者に対する権利で前11.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資は、行ないません。

#### 同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への投資割合は、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。

#### 同一銘柄の転換社債等

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への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）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、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2) の1.か

ら4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。

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

ロ. 委託会社は、信託財産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金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

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

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由によ

- り、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。

- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
  - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
  - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- 八．リートに関する法制度(税制、会計制度等)が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制(建築規制、環境規制等)に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
  - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。



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

ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

### (3)その他の留意点

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

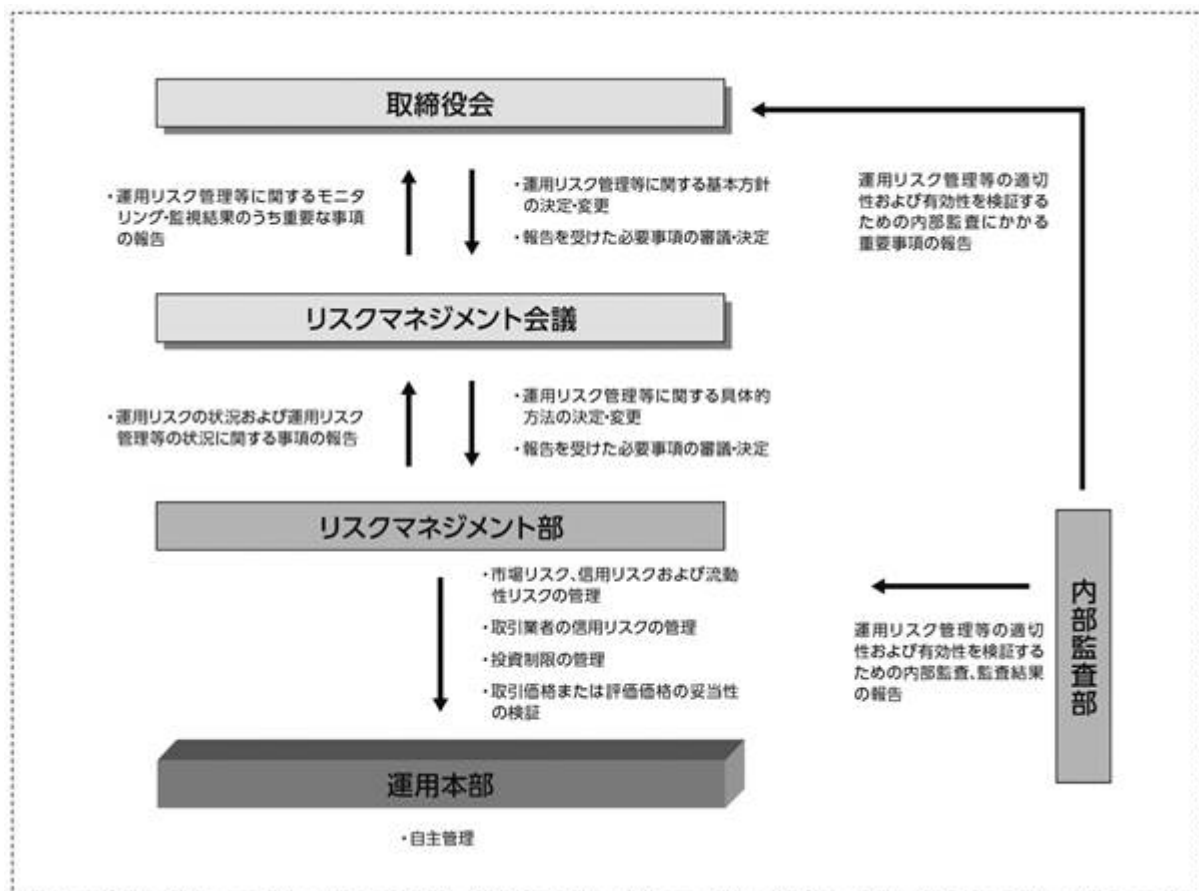
#### 流動性リスクに関する事項

- 当ファンドは、大量の解約が発生し短時間で解約資金を手当てする必要がある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。

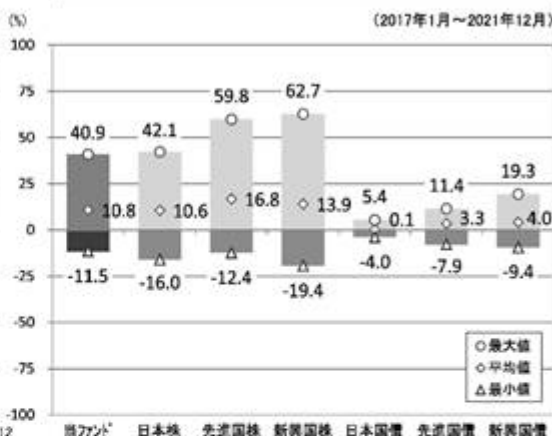
## 参 考 情 報

- 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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

### ※指数について

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

	信託報酬率
第1計算期間から第20計算期間まで	年率0.396%（税抜0.36%）
第21計算期間から第30計算期間まで	年率0.374%（税抜0.34%）
第31計算期間から第35計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第36計算期間以降	年率0.242%（税抜0.22%）

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から第20計算期間まで >

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

< 第21計算期間から第30計算期間まで >

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

< 第31計算期間から第35計算期間まで >

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

< 第36計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

##### イ．収益分配金に対する課税

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

することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

（ ）上記は、2021年12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12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	475,274,074	99.81
内 日本	475,274,074	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	926,467	0.19
純資産総額	476,200,541	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	159,276,190	1.3233 210,774,600	1.3593 216,504,125	45.46
2 外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	33,863,475	4.0756 138,013,979	4.2776 144,854,400	30.42
3 ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	9,700,731	3.3454 32,453,504	3.4288 33,261,866	6.98
4 ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	8,693,557	3.1950 27,775,916	3.3585 29,197,311	6.13
5 ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	26,825,990	1.0451 28,038,449	1.0447 28,025,111	5.89
6 外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	7,423,178	3.1417 23,321,827	3.1565 23,431,261	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。

## □．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	99.81%
合計	99.81%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2016年12月19日)	1,133,176	1,133,176	1.1332	1.1332
第2計算期間末 (2017年12月18日)	1,335,634	1,335,634	1.2975	1.2975
第3計算期間末 (2018年12月18日)	1,437,343	1,437,343	1.1966	1.1966
第4計算期間末 (2019年12月18日)	19,747,038	19,747,038	1.3816	1.3816
第5計算期間末 (2020年12月18日)	63,744,579	63,744,579	1.4508	1.4508
2020年12月末日	65,990,273	-	1.4610	-
2021年1月末日	74,410,883	-	1.4771	-
2月末日	110,795,703	-	1.5228	-
3月末日	147,033,480	-	1.6075	-
4月末日	164,405,885	-	1.6156	-
5月末日	210,856,369	-	1.6366	-
6月末日	247,830,358	-	1.6647	-



7月末日	281,437,663	-	1.6586	-
8月末日	319,253,473	-	1.6960	-
9月末日	342,452,957	-	1.7112	-
10月末日	382,959,726	-	1.7484	-
11月末日	437,862,337	-	1.7103	-
第6計算期間末 (2021年12月20日)	457,362,711	457,362,711	1.7142	1.7142
12月末日	476,200,541	-	1.7697	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.3
第2計算期間	14.5
第3計算期間	7.8
第4計算期間	15.5
第5計算期間	5.0
第6計算期間	18.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	29,370	0
第3計算期間	248,633	76,842
第4計算期間	15,611,182	2,518,983
第5計算期間	66,431,048	36,786,378
第6計算期間	295,237,620	72,365,338

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

## トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2021年12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		186,926,529,920	98.17
	内 日本	186,926,529,920	98.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,483,514,957	1.83
純資産総額		190,410,044,877	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		3,366,480,000	1.77
	内 日本	3,366,480,000	1.77

(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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	3,485,200	1,987.14 6,925,614,350	2,105.50 7,338,088,600	3.85
2 ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	431,000	12,374.10 5,333,241,100	14,475.00 6,238,725,000	3.28
3 キーエンス	日本	株式	電気機 器	62,300	71,665.05 4,464,733,000	72,280.00 4,503,044,000	2.36
4 リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	507,200	7,006.92 3,553,910,400	6,972.00 3,536,198,400	1.86
5 東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	43,700	54,121.69 2,365,118,000	66,280.00 2,896,436,000	1.52

6	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,250,500	632.40 2,688,040,940	624.90 2,656,137,450	1.39
7	日本電産	日本	株式	電気機器	178,300	13,276.83 2,367,258,900	13,520.00 2,410,616,000	1.27
8	信越化学	日本	株式	化学	115,700	21,122.55 2,443,880,000	19,920.00 2,304,744,000	1.21
9	HOYA	日本	株式	精密機器	134,200	18,399.46 2,469,207,800	17,110.00 2,296,162,000	1.21
10	ダイキン工業	日本	株式	機械	87,600	26,671.20 2,336,397,600	26,090.00 2,285,484,000	1.20
11	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	704,700	3,224.90 2,272,588,210	3,150.00 2,219,805,000	1.17
12	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	404,900	6,312.33 2,555,862,500	5,434.00 2,200,226,600	1.16
13	任天堂	日本	株式	その他製品	38,800	52,683.29 2,044,112,000	53,650.00 2,081,620,000	1.09
14	日立	日本	株式	電気機器	330,900	6,440.73 2,131,238,700	6,230.00 2,061,507,000	1.08
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	470,100	3,927.24 1,846,199,900	3,943.00 1,853,604,300	0.97
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	507,400	3,538.56 1,795,468,200	3,652.00 1,853,024,800	0.97
17	村田製作所	日本	株式	電気機器	202,200	9,989.14 2,019,806,000	9,157.00 1,851,545,400	0.97
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	542,000	3,334.71 1,807,418,200	3,230.00 1,750,660,000	0.92
19	武田薬品	日本	株式	医薬品	541,000	3,744.97 2,026,031,600	3,137.00 1,697,117,000	0.89
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	473,600	3,453.10 1,635,391,700	3,518.00 1,666,124,800	0.88
21	KDDI	日本	株式	情報・通信業	492,200	3,777.96 1,859,515,400	3,362.00 1,654,776,400	0.87
22	第一三共	日本	株式	医薬品	540,700	3,016.60 1,631,080,250	2,925.00 1,581,547,500	0.83
23	SMC	日本	株式	機械	20,000	77,229.56 1,544,591,200	77,590.00 1,551,800,000	0.81
24	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	77,700	17,357.44 1,348,673,500	19,395.00 1,506,991,500	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,022,100	1,551.67 1,585,971,600	1,454.50 1,486,644,450	0.78

26	ファナック	日本	株式	電気機器	60,400	25,529.02 1,541,952,900	24,380.00 1,472,552,000	0.77
27	デンソー	日本	株式	輸送用機器	151,500	7,761.34 1,175,843,400	9,529.00 1,443,643,500	0.76
28	三井物産	日本	株式	卸売業	525,800	2,448.64 1,287,495,400	2,723.50 1,432,016,300	0.75
29	東京海上HD	日本	株式	保険業	223,600	6,007.19 1,343,207,800	6,392.00 1,429,251,200	0.75
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	265,200	5,120.03 1,357,834,400	5,056.00 1,340,851,200	0.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.17%
合計	98.17%

(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

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.23%
建設業	2.13%
食料品	3.21%
繊維製品	0.46%
パルプ・紙	0.20%
化学	6.64%
医薬品	4.71%
石油・石炭製品	0.39%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.78%
鉄鋼	0.73%
非鉄金属	0.68%
金属製品	0.63%
機械	5.45%
電気機器	19.81%
輸送用機器	7.99%
精密機器	2.86%
その他製品	2.18%

電気・ガス業	1.04%
陸運業	2.88%
海運業	0.51%
空運業	0.38%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	7.80%
卸売業	5.19%
小売業	4.02%
銀行業	4.62%
証券、商品先物取引業	0.71%
保険業	1.94%
その他金融業	1.12%
不動産業	1.78%
サービス業	6.18%
合計	98.17%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 040 3月	買建	169	3,362,941,950	3,366,480,000	1.77%

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

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

#### 外国株式インデックスマザーファンド

#### (1) 投資状況 (2021年12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		245,473,913,174	92.81
	内 香港	2,023,469,833	0.77
	内 シンガポール	828,318,240	0.31
	内 イスラエル	567,442,589	0.21
	内 ノルウェー	511,312,093	0.19
	内 スウェーデン	3,092,622,522	1.17
	内 デンマーク	2,069,437,747	0.78
	内 イギリス	10,674,406,453	4.04
	内 アイルランド	501,695,448	0.19
	内 オランダ	3,536,705,653	1.34
	内 ベルギー	640,414,757	0.24
	内 フランス	8,411,255,332	3.18
	内 ドイツ	6,435,905,529	2.43
	内 スイス	7,605,587,539	2.88
	内 ポルトガル	142,184,903	0.05
	内 スペイン	1,617,053,444	0.61
	内 イタリア	1,804,288,374	0.68
	内 フィンランド	744,846,176	0.28
	内 オーストリア	171,466,778	0.06
	内 カナダ	8,554,471,365	3.23
	内 アメリカ	181,014,244,554	68.44
	内 オーストラリア	4,364,713,487	1.65
	内 ニュージーランド	162,070,358	0.06
投資証券		6,231,246,234	2.36
	内 香港	92,187,574	0.03
	内 シンガポール	96,233,703	0.04
	内 イギリス	156,586,074	0.06
	内 フランス	97,130,240	0.04
	内 カナダ	27,550,349	0.01
	内 アメリカ	5,188,687,721	1.96
	内 オーストラリア	551,457,113	0.21
	内 その他	21,413,460	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,789,568,363	4.84
純資産総額		264,494,727,771	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)	12,772,511,707	4.83

	内 イギリス	583,144,312	0.22
	内 ドイツ	2,289,347,346	0.87
	内 カナダ	557,181,926	0.21
	内 アメリカ	8,832,526,700	3.34
	内 オーストラリア	510,311,423	0.19
為替予約取引(買建)		5,882,992,418	2.22
	内 日本	5,882,992,418	2.22

(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12月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	617,100	18,441.61 11,380,355,883	20,632.28 12,732,184,678	4.81
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	266,600	38,700.89 10,317,679,087	39,331.08 10,485,668,327	3.96
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	17,010	409,452.79 6,964,792,384	389,229.98 6,620,801,967	2.50
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	31,370	130,826.50 4,104,027,619	124,933.57 3,919,166,210	1.48
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	11,220	334,539.92 3,753,539,239	337,365.16 3,785,237,118	1.43

6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,737	335,979.40 3,607,411,247	337,018.95 3,618,572,485	1.37
7	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	88,900	38,845.01 3,453,331,380	39,444.95 3,506,656,837	1.33
8	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	93,380	38,363.19 3,582,359,873	34,507.15 3,222,277,686	1.22
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	35,116	51,966.03 1,824,842,794	58,151.81 2,042,059,016	0.77
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	111,270	18,540.87 2,063,053,596	18,237.57 2,029,294,547	0.77
11	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	98,100	18,362.82 1,801,393,666	19,731.68 1,935,677,906	0.73
12	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	39,350	46,777.82 1,840,711,873	47,254.81 1,859,477,041	0.70
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	90,567	17,129.58 1,551,375,652	18,885.13 1,710,369,913	0.65
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	49,450	32,441.85 1,604,250,882	34,443.88 1,703,250,321	0.64
15	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	102,700	15,103.77 1,551,157,795	16,140.03 1,657,581,944	0.63
16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	62,950	22,569.45 1,420,748,721	25,093.91 1,579,661,849	0.60
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	282,401	5,242.38 1,480,460,559	5,133.34 1,449,661,084	0.55
18	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	15,110	91,979.01 1,389,804,773	91,813.78 1,387,306,291	0.52
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	208,913	6,031.30 1,260,022,614	6,622.85 1,383,599,796	0.52
20	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	32,800	37,131.33 1,217,908,593	41,555.57 1,363,022,886	0.52
21	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	25,650	44,966.36 1,153,388,049	47,901.98 1,228,685,890	0.46



22	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	67,762	16,991.67 1,151,395,198	17,813.14 1,207,054,494	0.46
23	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技 術	15,262	64,874.15 990,111,090	77,363.60 1,180,723,297	0.45
24	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技 術	17,770	79,023.68 1,404,252,012	65,479.73 1,163,574,905	0.44
25	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	16,490	76,290.58 1,258,032,515	70,224.31 1,157,998,885	0.44
26	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	157,250	6,410.63 1,008,075,192	7,356.67 1,156,837,804	0.44
27	ACCENTURE PLC-CL A	アメリカ	株式	情報技 術	23,600	42,054.07 992,476,122	47,781.60 1,127,645,958	0.43
28	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	14,660	74,568.96 1,093,182,010	76,227.20 1,117,490,819	0.42
29	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	158,105	7,078.33 1,119,128,146	7,033.47 1,112,027,249	0.42
30	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必 需品	16,460	63,778.93 1,049,802,355	65,304.90 1,074,918,743	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.81%
投資証券	2.36%
合計	95.16%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.12%
素材	3.88%
資本財・サービス	8.88%
一般消費財・サービス	11.21%
生活必需品	6.55%
ヘルスケア	12.18%

金融	12.73%
情報技術	23.22%
コミュニケーション・サービス	7.98%
公益事業	2.70%
不動産	0.37%
合計	92.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI FUT 202203	買建	321	8,611,460,215	8,832,526,700	3.34%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202203	買建	51	570,911,439	583,144,312	0.22%
	オーストラ リア	SPI 200 FUTURES 202203	買建	33	501,854,595	510,311,423	0.19%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202203	買建	24	540,798,788	557,181,926	0.21%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202203	買建	35	549,100,072	563,404,800	0.21%
		EURO STOXX 50 202203	買建	310	1,694,449,504	1,725,942,546	0.65%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	7,840,000	1,006,938,702	1,023,404,592	0.39%
		スイス・フラン買/円売 2022年1月	買建	2,650,000	326,757,654	333,343,500	0.13%
		豪ドル買/円売 2022年1 月	買建	3,850,000	312,060,385	321,167,000	0.12%
		カナダ・ドル買/円売 2022年1月	買建	3,770,000	334,813,793	339,408,576	0.13%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	31,250,000	3,548,007,895	3,594,025,000	1.36%
		英ポンド買/円売 2022年 1月	買建	1,750,000	263,919,557	271,643,750	0.10%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資状況 (2021年12月30日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	445,625,452,750	97.49
内 日本	445,625,452,750	97.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,478,103,698	2.51
純資産総額	457,103,556,448	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	11,468,800,000	2.51
内 日本	11,468,800,000	2.51

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

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

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

### (2) 投資資産 (2021年12月30日現在)

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 日本ビルファンド	日本	投資証券	44,505	721,798.03 32,123,621,629	670,000.00 29,818,350,000	6.52
2 日本プロロジスリート	日本	投資証券	64,247	389,324.86 25,012,954,563	407,000.00 26,148,529,000	5.72

3	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	39,270	685,687.94 26,926,965,421	653,000.00 25,643,310,000	5.61
4	GLP投資法人	日本	投資証券	127,186	190,646.37 24,247,550,006	198,900.00 25,297,295,400	5.53
5	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	58,964	340,799.75 20,094,916,978	348,500.00 20,548,954,000	4.50
6	野村不動産マスターF	日本	投資証券	126,991	164,589.01 20,901,324,007	161,800.00 20,547,143,800	4.50
7	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	198,139	107,807.27 21,360,825,230	99,100.00 19,635,574,900	4.30
8	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,264	371,845.54 14,600,143,393	380,000.00 14,920,320,000	3.26
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	78,245	196,382.23 15,365,928,062	179,800.00 14,068,451,000	3.08
10	産業ファンド	日本	投資証券	55,750	214,584.97 11,963,112,271	222,100.00 12,382,075,000	2.71
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	88,404	154,062.54 13,619,745,645	135,200.00 11,952,220,800	2.61
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	25,808	405,027.64 10,452,953,584	399,000.00 10,297,392,000	2.25
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	119,202	93,707.07 11,170,070,523	85,700.00 10,215,611,400	2.23
14	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	48,074	195,826.27 9,414,152,409	202,600.00 9,739,792,400	2.13
15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,597	624,556.40 9,116,649,883	645,000.00 9,415,065,000	2.06
16	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	25,659	342,417.73 8,786,096,555	356,500.00 9,147,433,500	2.00
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	13,560	648,748.75 8,797,033,128	663,000.00 8,990,280,000	1.97
18	API投資法人	日本	投資証券	20,929	462,627.13 9,682,323,210	416,000.00 8,706,464,000	1.90
19	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,148	770,147.97 9,355,757,558	711,000.00 8,637,228,000	1.89
20	イオンリート投資	日本	投資証券	46,183	146,739.18 6,776,855,609	161,100.00 7,440,081,300	1.63
21	森ヒルズリート	日本	投資証券	46,178	157,688.67 7,281,747,579	156,100.00 7,208,385,800	1.58
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,767	477,985.09 6,580,420,762	497,000.00 6,842,199,000	1.50

23	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	120,306	64,276.58 7,732,859,151	56,200.00 6,761,197,200	1.48
24	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	36,635	178,140.52 6,526,178,032	173,100.00 6,341,518,500	1.39
25	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	172,844	42,076.91 7,272,741,660	36,400.00 6,291,521,600	1.38
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	53,063	118,317.02 6,278,256,462	118,500.00 6,287,965,500	1.38
27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	17,682	351,165.75 6,209,312,846	341,500.00 6,038,403,000	1.32
28	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	26,821	225,229.75 6,040,887,273	222,300.00 5,962,308,300	1.30
29	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	37,642	153,892.04 5,792,804,451	155,200.00 5,842,038,400	1.28
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,302	773,208.14 6,419,173,988	700,000.00 5,811,400,000	1.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.49%
合計	97.49%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 040 3月	買建	5,600	11,209,016,000	11,468,800,000	2.51%

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

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

## ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資状況 (2021年12月30日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	900,942,458	1.71
内 アメリカ	900,942,458	1.71
投資証券	50,564,722,063	95.84
内 ガーンジー	123,024,719	0.23
内 韓国	88,173,012	0.17
内 香港	653,348,454	1.24
内 シンガポール	1,699,781,079	3.22
内 イスラエル	40,071,711	0.08
内 イギリス	2,737,375,482	5.19
内 アイルランド	48,959,663	0.09
内 オランダ	71,747,709	0.14
内 ベルギー	618,259,398	1.17
内 フランス	796,508,262	1.51
内 ドイツ	134,029,082	0.25
内 スペイン	182,555,054	0.35
内 イタリア	11,695,810	0.02
内 カナダ	957,718,280	1.82
内 アメリカ	38,562,572,380	73.09
内 オーストラリア	3,644,841,593	6.91
内 ニューージーランド	194,060,375	0.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,296,425,794	2.46
純資産総額	52,762,090,315	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,348,565,182	2.56
内 ドイツ	263,316,976	0.50
内 アメリカ	1,085,248,206	2.06

為替予約取引(買建)	495,016,556	0.94
内 日本	495,016,556	0.94

(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12月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	191,213	17,631.53 3,371,398,364	19,286.55 3,687,839,774	6.99
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	23,287	94,285.22 2,195,622,192	96,846.84 2,255,272,363	4.27
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	39,456	38,178.47 1,506,373,613	42,858.75 1,691,034,935	3.21
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	84,989	18,383.41 1,562,397,460	18,260.57 1,551,948,026	2.94
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	73,396	19,409.39 1,424,573,320	20,158.40 1,479,546,308	2.80
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	146,325	8,021.49 1,173,750,651	8,269.93 1,210,098,678	2.29
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	112,576	9,438.54 1,062,565,181	9,789.35 1,102,046,113	2.09
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	36,141	27,690.37 1,000,759,987	29,048.30 1,049,834,646	1.99
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	458,260	2,049.79 939,375,158	2,230.65 1,022,218,036	1.94
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	36,471	23,610.27 861,092,714	25,715.02 937,852,545	1.78
11	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	88,262	9,915.87 875,199,997	10,415.06 919,254,114	1.74
12	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	68,000	12,764.57 867,995,244	13,249.15 900,942,458	1.71
13	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	34,629	23,358.83 808,896,881	25,927.80 897,854,077	1.70

14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	154,343	4,751.13 733,311,318	5,195.45 801,881,864	1.52
15	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	29,778	24,150.74 719,161,687	26,260.21 781,976,718	1.48
16	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	98,500	6,838.28 673,581,832	7,492.40 738,001,676	1.40
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	29,994	22,627.30 678,685,490	24,201.35 725,895,538	1.38
18	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	317,029	2,200.21 697,557,704	2,199.75 697,384,796	1.32
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	16,834	39,844.76 670,747,782	40,511.19 681,965,443	1.29
20	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	103,013	5,646.44 581,665,148	5,828.06 600,366,295	1.14
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	139,421	3,916.66 546,078,629	4,152.22 578,906,943	1.10
22	LINK REIT	香港	投資証券	563,900	1,013.14 571,315,013	1,002.26 565,175,824	1.07
23	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	162,665	3,233.09 525,921,385	3,387.33 551,001,498	1.04
24	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	26,331	19,420.20 511,355,994	20,434.45 538,059,587	1.02
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	75,167	6,610.42 496,892,481	6,880.49 517,186,273	0.98
26	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	36,764	12,691.53 466,592,414	13,294.01 488,741,042	0.93
27	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	48,243	9,055.63 436,873,110	9,552.41 460,836,964	0.87
28	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	74,886	5,390.06 403,645,523	6,068.45 454,442,336	0.86
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	44,215	9,753.23 431,243,767	10,061.94 444,889,102	0.84
30	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	159,428	2,677.43 426,858,802	2,789.23 444,682,158	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.71%
投資証券	95.84%



合計	97.54%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REAL ESTATE 202203	買建	210	1,051,557,698	1,085,248,206	2.06%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202203	買建	208	260,701,399	263,316,976	0.50%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	1,090,000	140,348,812	142,284,567	0.27%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	3,067,000	348,265,527	352,731,989	0.67%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

##### (1) 投資状況 (2021年12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	323,746,870	98.12
内 日本	323,746,870	98.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,210,393	1.88
純資産総額	329,957,263	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12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	335 10年国債	日本	国債証券	53,000,000	101.70 53,905,770	101.61 53,856,480	0.500000 2024/09/20	16.32
2	334 10年国債	日本	国債証券	52,000,000	101.80 52,937,040	101.71 52,889,720	0.600000 2024/06/20	16.03
3	430 2年国債	日本	国債証券	47,000,000	100.23 47,109,510	100.19 47,089,770	0.005000 2023/11/01	14.27
4	136 5年国債	日本	国債証券	40,000,000	100.32 40,131,600	100.29 40,116,400	0.100000 2023/06/20	12.16
5	135 5年国債	日本	国債証券	40,000,000	100.26 40,106,800	100.23 40,094,000	0.100000 2023/03/20	12.15
6	333 10年国債	日本	国債証券	35,000,000	101.61 35,566,650	101.53 35,537,600	0.600000 2024/03/20	10.77
7	137 5年国債	日本	国債証券	35,000,000	100.38 35,134,750	100.34 35,119,700	0.100000 2023/09/20	10.64
8	427 2年国債	日本	国債証券	14,000,000	100.20 14,028,140	100.16 14,023,100	0.005000 2023/08/01	4.25
9	138 5年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.45 5,022,500	100.40 5,020,100	0.100000 2023/12/20	1.52

(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	98.12%
合計	98.12%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（2021年12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	233,595,837,322	98.71
内 ユーロ	90,356,442,261	38.18
内 中国	1,018,901,766	0.43
内 シンガポール	1,005,491,452	0.42
内 マレーシア	1,133,351,340	0.48
内 イスラエル	1,109,675,890	0.47
内 ノルウェー	552,913,343	0.23
内 スウェーデン	661,580,700	0.28
内 デンマーク	1,023,305,332	0.43
内 イギリス	14,004,165,190	5.92
内 ポーランド	1,117,735,848	0.47
内 カナダ	4,560,791,537	1.93
内 アメリカ	111,538,501,988	47.13
内 メキシコ	1,646,796,197	0.70
内 オーストラリア	3,866,184,478	1.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,053,915,771	1.29
純資産総額	236,649,753,093	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)	1,634,055,746	0.69
内 日本	1,634,055,746	0.69

(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12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,700,000	96.91 1,192,684,937	96.82 1,191,626,523	1.125000 2031/02/15	0.50
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	10,300,000	97.64 1,156,847,120	97.54 1,155,585,926	1.250000 2031/08/15	0.49
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	93.01 1,069,812,522	93.03 1,070,088,570	0.625000 2030/08/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	94.91 1,069,900,627	94.88 1,069,506,108	0.875000 2030/11/15	0.45
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,700,000	101.16 1,012,281,818	101.02 1,010,950,921	1.625000 2031/05/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,729,000	102.16 908,227,314	101.60 903,293,422	1.625000 2026/05/15	0.38
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,700,000	99.52 881,464,856	99.15 878,143,654	0.250000 2023/11/15	0.37
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,699,000	118.93 884,573,379	117.78 876,049,700	2.750000 2027/10/25	0.37
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,920,000	114.61 885,511,625	112.87 872,070,743	1.500000 2031/05/25	0.37
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,500,000	98.95 853,652,560	98.55 850,141,575	0.375000 2024/09/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,700,000	109.49 843,782,579	109.12 840,923,527	2.875000 2028/08/15	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,500,000	97.44 840,574,786	97.04 837,167,319	0.250000 2025/06/30	0.35
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,800,000	93.24 836,526,197	93.27 836,804,315	0.625000 2030/05/15	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,600,000	108.20 821,403,597	108.07 820,393,952	2.625000 2029/02/15	0.35
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,664,000	175.35 838,537,253	171.08 818,094,689	4.500000 2041/04/25	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	109.25 816,785,775	108.84 813,742,920	2.875000 2028/05/15	0.34

17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	111.25 818,987,854	109.46 805,824,599	2.375000 2051/05/15	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,087,000	122.73 814,869,584	121.07 803,795,659	2.500000 2030/05/25	0.34
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	6,900,000	102.65 814,717,025	100.96 801,320,415	2.000000 2051/08/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	99.37 800,107,875	99.02 797,273,782	1.250000 2028/03/31	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,000,000	98.95 796,710,184	98.68 794,568,511	1.250000 2028/09/30	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,350,000	108.34 791,312,353	107.94 788,376,237	2.750000 2028/02/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	105.91 779,662,609	105.45 776,269,059	2.375000 2027/05/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	96.50 776,960,100	96.14 774,061,596	0.750000 2028/01/31	0.33
25	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,571,000	165.72 772,363,367	162.34 756,624,818	4.000000 2037/01/04	0.32
26	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,730,000	101.14 756,377,387	100.91 754,627,482	- 2023/04/14	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,162,000	104.36 739,676,143	103.78 735,579,550	2.375000 2024/08/15	0.31
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	101.78 736,038,623	101.50 734,028,320	2.000000 2022/11/30	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	97.10 726,016,016	96.73 723,212,404	0.250000 2025/09/30	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,800,000	93.96 734,894,985	92.25 721,520,460	1.625000 2050/11/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.71%
合計	98.71%

(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。

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2022年 1月	買建	755,000	114,944,309	117,200,107	0.05%
		米ドル買/円売 2022年2 月	買建	5,401,000	620,903,928	621,043,706	0.26%
		カナダ・ドル買/円売 2022年1月	買建	105,000	9,413,796	9,453,706	0.00%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	2,025,000	232,636,050	232,905,982	0.10%
		ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	4,698,000	605,308,222	613,201,475	0.26%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2022年2月	買建	378,000	32,163,335	32,159,030	0.01%
		豪ドル買/円売 2022年1 月	買建	97,000	8,059,322	8,091,740	0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●DCダイワ・ターゲットイヤー 2050

2021年12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	17,697円
純資産総額	4.7億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	3.5%
3か月間	3.4%
6か月間	6.3%
1年間	21.1%
3年間	53.4%
5年間	57.9%
設定来	77.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	16年12月	17年12月	18年12月	19年12月	20年12月	21年12月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	2,120	45.4%	日本円	58.5%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.8%	
外国株式・先物	1,233	29.7%	米ドル	29.5%	最終利回り(%)	ソニーグループ	日本	1.5%	
国内リート・先物	62	7.0%	ユーロ	5.1%	修正デュレーション	APPLE INC	アメリカ	1.5%	
外国リート・先物	333	6.7%	英ポンド	1.9%	残存年数	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.2%	
国内債券	9	5.8%	カナダドル	1.3%	債券格付別構成	キーエンス	日本	1.1%	
外国債券	853	4.9%	豪ドル	1.1%	AAA	91.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.5%
外国投資信託等	10	0.1%	スイス・フラン	0.9%	AA	4.1%	日本ビルファンド	日本	0.5%
			スウェーデン・クローネ	0.4%	A	4.8%	日本プロロジスリート	日本	0.4%
			香港ドル	0.3%	BBB	-	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			その他	0.9%	BB	-	GLP投資法人	日本	0.4%
コール・ローン、その他	3.0%								
合計	4,620	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.1%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

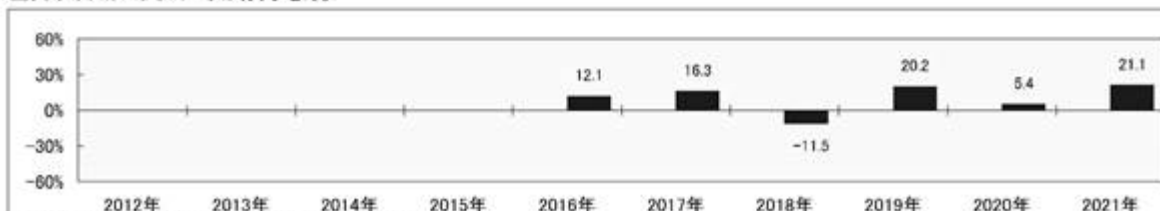
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2016年は設定日(5月13日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

#### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社



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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

委託会社は、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。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年5月13日から2016年12月18日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第36計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### <収益分配金にかかる請求権>

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

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

#### <償還金にかかる請求権>

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

< 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2020年12月19日から2021年12月20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】

DCダイワ・ターゲットイヤー2050

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2020年12月18日現在	第6期 2021年12月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	404,343	3,224,806
親投資信託受益証券	63,616,535	456,477,885
流動資産合計	64,020,878	459,702,691
資産合計	64,020,878	459,702,691
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	167,241	1,640,407
未払受託者報酬	8,866	57,072
未払委託者報酬	98,051	628,320
その他未払費用	2,141	14,181
流動負債合計	276,299	2,339,980
負債合計	276,299	2,339,980
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 43,938,030	1 266,810,312
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	19,806,549	190,552,399
(分配準備積立金)	6,471,047	20,975,986
元本等合計	63,744,579	457,362,711
純資産合計	63,744,579	457,362,711
負債純資産合計	64,020,878	459,702,691

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2019年12月19日 至 2020年12月18日	自	2020年12月19日 至 2021年12月20日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		6,164,647		25,111,945
<b>営業収益合計</b>		<b>6,164,647</b>		<b>25,111,945</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		8		229
受託者報酬		14,814		78,603
委託者報酬		164,049		865,747
その他費用		3,564		19,486
<b>営業費用合計</b>		<b>182,435</b>		<b>964,065</b>
<b>営業利益</b>		<b>5,982,212</b>		<b>24,147,880</b>
<b>経常利益</b>		<b>5,982,212</b>		<b>24,147,880</b>
<b>当期純利益</b>		<b>5,982,212</b>		<b>24,147,880</b>
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( )		121,022		6,881,285
期首剰余金又は期首欠損金( )		5,453,678		19,806,549
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>19,995,345</b>		<b>194,819,411</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		19,995,345		194,819,411
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>11,745,708</b>		<b>41,340,156</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,745,708		41,340,156
<b>分配金</b>		<b>1 -</b>		<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>19,806,549</b>		<b>190,552,399</b>



## (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6期	
	自 2020年12月19日	至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2021年12月18日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2021年12月20日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首元本額	14,293,360円	43,938,030円
期中追加設定元本額	66,431,048円	295,237,620円
期中一部解約元本額	36,786,378円	72,365,338円
2. 計算期間末日における受益権の総数	43,938,030口	266,810,312口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2019年12月19日 至 2020年12月18日	自 2020年12月19日 至 2021年12月20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(6,103,240円)、投資信託約款に規定される収益調整金(15,442,085円)及び分配準備積立金(367,807円)より分配対象額は21,913,132円(1万口当たり4,987.28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(17,266,803円)、投資信託約款に規定される収益調整金(169,576,627円)及び分配準備積立金(3,709,183円)より分配対象額は190,552,613円(1万口当たり7,141.88円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2020年12月19日 至 2021年12月20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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2021年12月20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5期	第6期
	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	6,284,374	22,715,007
合計	6,284,374	22,715,007

## （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5期	第6期
2020年12月18日現在	2021年12月20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6期
自 2020年12月19日
至 2021年12月20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5期	第6期
	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.4508円	1.7142円
（1万口当たり純資産額）	（14,508円）	（17,142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	156,996,161	207,690,221	
	外国株式インデックスマザーファンド	33,893,242	138,135,297	
	外国債券インデックスマザーファンド	7,328,602	23,023,536	
	ダイワJ-REITマザーファンド	9,585,118	32,061,261	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	8,727,395	27,884,027	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	26,486,360	27,683,543	
親投資信託受益証券 合計			456,477,885	
合計			456,477,885	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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12月18日現在	2021年12月20日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,997,284,612	7,179,034,125
株式 2 3	157,993,811,340	182,600,770,840
派生商品評価勘定	32,496,150	-
未収入金	81,864,989	-
未収配当金	30,357,584	14,675,780
未収利息	522,106	256,140
前払金	-	3,040,000
その他未収収益 4	14,127,141	3,225,355
流動資産合計	178,150,463,922	189,801,002,240
資産合計	178,150,463,922	189,801,002,240
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	51,781,600
前受金	28,224,000	-
未払金	-	1,884,400
未払解約金	10,075,447,935	335,456,741
受入担保金	8,455,151,145	4,575,987,570
流動負債合計	18,558,823,080	4,965,110,311
負債合計	18,558,823,080	4,965,110,311
純資産の部		
元本等		
元本 1	133,497,261,446	139,719,409,192
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,094,379,396	45,116,482,737
元本等合計	159,591,640,842	184,835,891,929
純資産合計	159,591,640,842	184,835,891,929
負債純資産合計	178,150,463,922	189,801,002,240

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首	2019年12月19日	2020年12月19日
期首元本額	141,422,704,097円	133,497,261,446円
期中追加設定元本額	28,240,870,154円	22,185,108,638円
期中一部解約元本額	36,166,312,805円	15,962,960,892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	3,168,441,511円	2,978,638,277円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	6,643,901,616円	5,607,664,681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	930,510円	923,930円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	30,535,580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)	623,575,767円	393,869,554円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	33,892,315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)	874,355,172円	711,960,045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)	131,839,212円	258,479,084円
D-I's TOPIXイン デックス	32,837,839円	45,380,499円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	9,520,635円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	24,968,635円	156,996,161円
iFree TOPIXイン デックス	2,220,877,385円	4,963,260,757円
iFree 8資産バランス	2,611,434,527円	3,417,146,307円
iFree 年金バランス	149,162,339円	555,794,606円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,990,219,547円	66,550,525,465円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,947,069,676円	3,090,855,667円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,732,560,786円	4,277,017,878円

ダイワ・ライフ・バランス70	3,318,474,811円	4,166,224,676円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,179,124,291円	6,020,536,360円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,810,118円	57,114,876円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	35,945,672円	60,560,892円
ダイワつみたてインデックス日本株式	839,698,602円	1,584,089,956円
ダイワつみたてインデックスバランス30	10,903,922円	10,529,649円
ダイワつみたてインデックスバランス50	7,976,371円	10,044,699円
ダイワつみたてインデックスバランス70	11,919,728円	19,885,938円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	- 円	721,017円
ダイワ世界バランスファンド40VA	129,490,275円	112,385,430円
ダイワ世界バランスファンド60VA	139,591,744円	130,510,052円
ダイワ・バランスファンド35VA	7,527,954,251円	5,933,455,693円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	637,068,308円	526,703,681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	143,373,446円	200,986,677円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	10,039,033,330円	10,254,224,365円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	830,852,621円	1,693,854,823円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	2,194,547,687円	2,722,760,705円



	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,231,058,118円	1,175,396,118円
	ダイワライフスタイル25	171,113,439円	151,975,951円
	ダイワライフスタイル50	649,847,886円	602,441,788円
	ダイワライフスタイル75	515,941,191円	481,386,482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)	11,331,795,874円	10,531,528,511円
計		133,497,261,446円	139,719,409,192円
2.	期末日における受益権の総数	133,497,261,446口	139,719,409,192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 8,062,258,000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 4,212,804,300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 798,510,000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 957,120,000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13,252,105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2,813,260円が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年12月18日現在	2021年12月20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	12,743,260,123	11,214,867,666

合計	12,743,260,123	11,214,867,666
----	----------------	----------------

(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12月18日まで、及び2021年9月22日から2021年12月20日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

種類	2020年12月18日 現在			2021年12月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	1,529,106,000	-	1,561,650,000	32,544,000	2,223,960,000	-	2,172,240,000	51,720,000
合計	1,529,106,000	-	1,561,650,000	32,544,000	2,223,960,000	-	2,172,240,000	51,720,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.1955円	1.3229円
(1万口当たり純資産額)	(11,955円)	(13,229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	3,020.00	9,664,000	貸付株式数	1,200株
日本水産	92,800	532.00	49,369,600		
マルハニチロ	14,500	2,365.00	34,292,500		
ハウスイ	600	816.00	489,600	貸付株式数	100株
カネコ種苗	2,800	1,445.00	4,046,000		
サカタのタネ	11,200	3,270.00	36,624,000		
ホクト	7,900	1,887.00	14,907,300	貸付株式数	1,200株
ホクリヨウ	1,500	681.00	1,021,500		
ヒノキヤグループ	2,300	2,204.00	5,069,200		
ショーボンドHD	13,300	5,130.00	68,229,000	貸付株式数	3,200株
ミライト・ホールディングス	29,900	1,894.00	56,630,600	貸付株式数	3,400株
タマホーム	5,900	2,208.00	13,027,200	貸付株式数	2,100株
サンヨーホームズ	1,500	727.00	1,090,500	貸付株式数	400株
日本アクア	4,400	671.00	2,952,400		
ファーストコーポレーション	2,500	697.00	1,742,500	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,900	1,230.00	2,337,000	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	1,148.00	11,020,800		
住石ホールディングス	21,600	129.00	2,786,400	貸付株式数	6,300株
日鉄鉱業	2,300	6,100.00	14,030,000		
三井松島HLDGS	3,600	1,468.00	5,284,800	貸付株式数	1,400株
INPEX	374,600	971.00	363,736,600		
石油資源開発	10,800	2,491.00	26,902,800		
K&Oエナジーグループ	4,400	1,450.00	6,380,000		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,509.00	2,716,200		
第一カッター興業	2,300	1,309.00	3,010,700		
明豊ファシリティワークス	2,900	778.00	2,256,200	貸付株式数	1,100株
安藤・間	50,800	870.00	44,196,000		
東急建設	29,000	638.00	18,502,000		
コムシスホールディングス	30,000	2,539.00	76,170,000		
ピーアールホールディングス	12,700	335.00	4,254,500	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクションGP	5,700	1,954.00	11,137,800	貸付株式数	2,200株
東建コーポレーション	2,900	9,090.00	26,361,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,000	999.00	999,000	貸付株式数	300株

ヤマウラ	4,400	952.00	4,188,800	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	62,400	3,470.00	216,528,000		
大林組	215,900	882.00	190,423,800		
清水建設	202,100	709.00	143,288,900		
飛鳥建設	5,500	995.00	5,472,500	貸付株式数	600株
長谷工コーポレーション	64,500	1,386.00	89,397,000		
松井建設	8,400	740.00	6,216,000		
銭高組	900	3,830.00	3,447,000		
鹿島建設	158,200	1,313.00	207,716,600		
不動テトラ	4,400	1,665.00	7,326,000		
大末建設	2,200	1,274.00	2,802,800		
鉄建建設	4,500	1,799.00	8,095,500		
西松建設	12,900	3,585.00	46,246,500	貸付株式数	5,100株
三井住友建設	47,600	419.00	19,944,400	貸付株式数	5,100株
大豊建設	3,100	3,710.00	11,501,000	貸付株式数	1,800株
佐田建設	4,600	469.00	2,157,400	貸付株式数	500株
ナカノフドー建設	5,000	322.00	1,610,000	貸付株式数	1,500株
奥村組	12,500	3,220.00	40,250,000		
東鉄工業	9,900	2,432.00	24,076,800	貸付株式数	3,400株
イチケン	1,500	1,837.00	2,755,500		
富士ピー・エス	2,900	493.00	1,429,700	貸付株式数	1,000株
浅沼組	2,400	5,260.00	12,624,000	貸付株式数	200株
戸田建設	89,700	718.00	64,404,600		
熊谷組	10,800	2,851.00	30,790,800		
北野建設	1,200	2,074.00	2,488,800	貸付株式数	400株
植木組	1,800	1,474.00	2,653,200	貸付株式数	700株
矢作建設	9,400	734.00	6,899,600	貸付株式数	1,500株
ピーエス三菱	6,900	588.00	4,057,200		
日本ハウスHLDGS	14,700	454.00	6,673,800	貸付株式数	5,700株
大東建託	22,100	13,050.00	288,405,000		
新日本建設	9,100	819.00	7,452,900		
NIPPO	17,700	3,985.00	70,534,500		
東亜道路	1,100	4,625.00	5,087,500	貸付株式数	300株
日本道路	2,100	8,100.00	17,010,000		
東亜建設	5,200	2,392.00	12,438,400	貸付株式数	2,600株
日本国土開発	21,100	554.00	11,689,400		
若築建設	3,500	1,856.00	6,496,000		
東洋建設	24,200	566.00	13,697,200		
五洋建設	85,500	658.00	56,259,000	貸付株式数	8,900株

世紀東急	10,200	818.00	8,343,600	
福田組	2,400	4,190.00	10,056,000	貸付株式数 900株
日本ドライケミカル	1,600	1,967.00	3,147,200	貸付株式数 200株
住友林業	55,100	2,233.00	123,038,300	
日本基礎技術	5,800	572.00	3,317,600	
巴コーポレーション	9,000	450.00	4,050,000	
大和ハウス	199,400	3,238.00	645,657,200	
ライト工業	13,400	1,971.00	26,411,400	
積水ハウス	234,400	2,336.50	547,675,600	
日特建設	4,300	651.00	2,799,300	貸付株式数 400株
北陸電気工事	3,800	1,065.00	4,047,000	
ユアテック	12,300	644.00	7,921,200	
日本リーテック	4,500	1,510.00	6,795,000	貸付株式数 500株
四電工	2,400	1,674.00	4,017,600	
中電工	10,100	2,086.00	21,068,600	
関電工	35,400	839.00	29,700,600	
きんでん	48,700	1,733.00	84,397,100	
東京エネシス	6,800	1,076.00	7,316,800	
トーエネック	2,200	3,225.00	7,095,000	
住友電設	5,400	2,000.00	10,800,000	貸付株式数 1,200株
日本電設工業	12,000	1,626.00	19,512,000	
エクシオグループ	32,800	2,430.00	79,704,000	
新日本空調	5,700	2,287.00	13,035,900	貸付株式数 1,600株
日本工営	3,900	3,115.00	12,148,500	
九電工	16,700	3,430.00	57,281,000	
三機工業	13,700	1,408.00	19,289,600	貸付株式数 1,900株
日揮ホールディングス	66,300	944.00	62,587,200	
中外炉工業	2,000	1,549.00	3,098,000	
ヤマト	6,200	735.00	4,557,000	
太平電業	4,900	2,803.00	13,734,700	
高砂熱学	19,400	1,887.00	36,607,800	
三晃金属	900	2,298.00	2,068,200	
NEC ネットズエスアイ	22,300	1,720.00	38,356,000	
朝日工業社	1,400	3,120.00	4,368,000	貸付株式数 200株
明星工業	13,800	725.00	10,005,000	
大気社	10,400	3,070.00	31,928,000	貸付株式数 800株
ダイダン	4,800	2,195.00	10,536,000	
日比谷総合設備	7,000	1,995.00	13,965,000	
ニッポン	20,200	1,639.00	33,107,800	貸付株式数 1,100株
日清製粉G本社	78,100	1,694.00	132,301,400	

日東富士製粉	1,000	3,655.00	3,655,000	
昭和産業	6,500	2,613.00	16,984,500	
鳥越製粉	6,400	690.00	4,416,000	貸付株式数 2,400株
中部飼料	7,800	940.00	7,332,000	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	9,300	684.00	6,361,200	
東洋精糖	1,300	1,080.00	1,404,000	貸付株式数 100株
日本甜菜糖	3,500	1,632.00	5,712,000	
D M三井製糖ホールディ	6,100	1,905.00	11,620,500	貸付株式数 400株
塩水港精糖	10,300	209.00	2,152,700	貸付株式数 1,500株
日新製糖	3,300	1,684.00	5,557,200	貸付株式数 200株
L I F U L L	22,500	230.00	5,175,000	貸付株式数 7,100株
ミクシィ	14,800	1,995.00	29,526,000	貸付株式数 1,400株
ジェイエシーリクルート メント	5,500	2,151.00	11,830,500	
日本M & A センターホール デ	107,800	3,025.00	326,095,000	
メンバーズ	2,000	2,293.00	4,586,000	貸付株式数 700株
中広	1,100	388.00	426,800	貸付株式数 400株
UTグループ	9,500	4,035.00	38,332,500	貸付株式数 2,900株
アイティメディア	3,100	1,774.00	5,499,400	貸付株式数 200株
E・Jホールディングス	3,300	1,168.00	3,854,400	貸付株式数 1,300株
夢真ビーネックスグルーフ	17,600	1,590.00	27,984,000	
コシダカホールディングス	18,600	578.00	10,750,800	貸付株式数 6,100株
アルトナー	1,300	822.00	1,068,600	貸付株式数 500株
パソナグループ	7,300	3,185.00	23,250,500	
C D S	1,500	1,614.00	2,421,000	
リンクアンドモチベーショ ン	14,500	531.00	7,699,500	貸付株式数 5,600株
エス・エム・エス	22,300	4,215.00	93,994,500	
サニーサイドアップG	2,100	720.00	1,512,000	貸付株式数 800株
パーソルホールディングス	65,700	3,200.00	210,240,000	
リニカル	3,500	749.00	2,621,500	貸付株式数 1,400株
クックパッド	21,700	240.00	5,208,000	貸付株式数 7,800株
エスクリ	3,100	404.00	1,252,400	貸付株式数 700株
アイ・ケイ・ケイホール ディンク	3,400	591.00	2,009,400	貸付株式数 1,200株
森永製菓	16,200	3,770.00	61,074,000	
中 村 屋	1,600	3,625.00	5,800,000	
江崎グリコ	19,000	3,710.00	70,490,000	
名糖産業	3,000	1,695.00	5,085,000	貸付株式数 600株

井村屋グループ	3,800	2,196.00	8,344,800	
不二家	4,100	2,302.00	9,438,200	貸付株式数 1,600株
山崎製パン	51,700	1,569.00	81,117,300	
第一屋製パン	1,300	539.00	700,700	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,100	5,690.00	6,259,000	
亀田製菓	3,900	4,365.00	17,023,500	
寿スピリッツ	6,600	5,570.00	36,762,000	貸付株式数 2,600株
カルビー	31,500	2,719.00	85,648,500	
森永乳業	12,700	5,430.00	68,961,000	
六甲バター	5,000	1,630.00	8,150,000	貸付株式数 2,000株
ヤクルト	51,100	6,130.00	313,243,000	
明治ホールディングス	45,700	7,040.00	321,728,000	
雪印メグミルク	16,500	2,072.00	34,188,000	
プリマハム	8,600	2,403.00	20,665,800	貸付株式数 2,500株
日本ハム	26,400	4,060.00	107,184,000	
林兼産業	2,200	502.00	1,104,400	
丸大食品	6,600	1,506.00	9,939,600	貸付株式数 2,400株
S Foods	6,200	3,350.00	20,770,000	貸付株式数 2,400株
柿安本店	2,300	2,737.00	6,295,100	貸付株式数 900株
伊藤ハム米久HLDGS	44,700	649.00	29,010,300	貸付株式数 1,400株
学情	2,800	1,061.00	2,970,800	貸付株式数 200株
スタジオアリス	3,000	2,034.00	6,102,000	貸付株式数 1,200株
クロスキャット	1,700	1,556.00	2,645,200	貸付株式数 600株
シミックホールディングス	3,600	1,484.00	5,342,400	貸付株式数 1,400株
エプロ	1,500	773.00	1,159,500	貸付株式数 500株
システナ	96,000	432.00	41,472,000	
NJS	1,400	1,873.00	2,622,200	
デジタルアーツ	3,600	8,650.00	31,140,000	貸付株式数 500株
日鉄ソリューションズ	9,800	3,480.00	34,104,000	
総合警備保障	26,200	4,595.00	120,389,000	
キューブシステム	3,100	929.00	2,879,900	
いちご	75,100	278.00	20,877,800	
WOW WORLD	900	1,443.00	1,298,700	貸付株式数 300株
日本駐車場開発	73,500	135.00	9,922,500	
コア	2,600	1,546.00	4,019,600	
カカクコム	48,000	3,075.00	147,600,000	
アイロムグループ	2,400	1,581.00	3,794,400	貸付株式数 900株
セントケア・ホールディング	4,300	731.00	3,143,300	
サイネックス	1,300	597.00	776,100	貸付株式数 200株



ルネサンス	4,700	1,080.00	5,076,000	貸付株式数	1,800株
ディップ	11,400	3,705.00	42,237,000	貸付株式数	4,500株
SBSホールディングス	5,400	3,210.00	17,334,000		
デジタルホールディングス	4,900	1,354.00	6,634,600	貸付株式数	1,100株
新日本科学	8,100	1,475.00	11,947,500	貸付株式数	3,100株
キャリアデザインセンター	1,600	954.00	1,526,400		
ベネフィット・ワン	23,900	4,765.00	113,883,500		
エムスリー	115,900	5,573.00	645,910,700		
ツカダ・グローバルHOLD	4,900	287.00	1,406,300	貸付株式数	1,600株
プラス	1,400	684.00	957,600	貸付株式数	300株
アウトソーシング	37,500	1,602.00	60,075,000	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	447.00	2,816,100	貸付株式数	1,900株
ワールドホールディングス	2,600	2,499.00	6,497,400		
ディー・エヌ・エー	24,600	1,699.00	41,795,400		
博報堂DYHLDGS	91,700	1,848.00	169,461,600		
ぐるなび	10,700	423.00	4,526,100	貸付株式数	900株
タカミヤ	7,800	445.00	3,471,000		
ジャパンベストレスキューS	5,000	937.00	4,685,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	415.00	6,806,000	貸付株式数	6,300株
ライク	1,900	1,646.00	3,127,400	貸付株式数	600株
ビジネス・ブレークスルー	2,600	421.00	1,094,600	貸付株式数	1,000株
エスプール	19,100	1,163.00	22,213,300		
WDBホールディングス	3,000	3,005.00	9,015,000	貸付株式数	600株
手間いらず	1,000	4,975.00	4,975,000	貸付株式数	300株
ティア	4,200	433.00	1,818,600		
CDG	600	1,375.00	825,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	5,300	4,215.00	22,339,500		
インフォマート	71,900	914.00	65,716,600		
サッポロホールディングス	23,400	2,240.00	52,416,000		
アサヒグループホールディングン	162,500	4,500.00	731,250,000		
麒麟HD	253,900	1,885.50	478,728,450		
宝ホールディングス	46,800	1,197.00	56,019,600		
オエノンホールディングス	19,900	360.00	7,164,000	貸付株式数	7,700株
養命酒	2,100	1,768.00	3,712,800	貸付株式数	400株
コカ・コーラボトラーズJHD	48,400	1,337.00	64,710,800		

サントリー食品インター	46,200	4,230.00	195,426,000		
ダイドーグループHD	3,500	4,750.00	16,625,000	貸付株式数	1,500株
伊藤園	21,000	6,110.00	128,310,000		
キーコーヒー	6,900	2,000.00	13,800,000		
ユニカフェ	2,000	1,014.00	2,028,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	900	1,221.00	1,098,900	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,600	2,849.00	24,501,400		
不二製油グループ	15,100	2,294.00	34,639,400	貸付株式数	2,800株
かどや製油	800	4,020.00	3,216,000	貸付株式数	200株
J-オイルミルズ	6,400	1,630.00	10,432,000	貸付株式数	200株
ローソン	15,000	5,800.00	87,000,000	貸付株式数	200株
サンエー	5,100	4,240.00	21,624,000	貸付株式数	2,000株
カワチ薬品	5,200	2,181.00	11,341,200	貸付株式数	2,000株
エービーシー・マート	10,600	4,915.00	52,099,000	貸付株式数	4,100株
ハードオフコーポレーション	3,000	703.00	2,109,000		
高千穂交易	2,500	1,436.00	3,590,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	11,200	1,492.00	16,710,400	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	8,900	1,214.00	10,804,600	貸付株式数	1,800株
アダストリア	7,200	1,669.00	12,016,800	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,100	376.00	1,541,600	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	390.00	390,000	貸付株式数	400株
オルバヘルスケアHLDGS	1,000	1,511.00	1,511,000		
伊藤忠食品	1,600	4,780.00	7,648,000		
くら寿司	7,100	3,485.00	24,743,500	貸付株式数	2,800株
キャンドゥ	1,800	2,320.00	4,176,000	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,800	1,018.00	5,904,400		
パルグループHLDGS	5,900	1,595.00	9,410,500	貸付株式数	2,300株
JALUX	1,700	2,547.00	4,329,900	貸付株式数	700株
エディオン	30,800	1,044.00	32,155,200	貸付株式数	12,100株
あらた	5,300	4,160.00	22,048,000	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	13,600	620.00	8,432,000	貸付株式数	5,400株
ワッツ	3,300	743.00	2,451,900	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,000	6,360.00	6,360,000	貸付株式数	300株
ハローズ	3,100	2,712.00	8,407,200	貸付株式数	1,200株
JPHホールディングス	17,600	238.00	4,188,800	貸付株式数	7,200株
フジオフードG本社	5,700	1,390.00	7,923,000	貸付株式数	2,200株 (100株)

あみやき亭	1,600	2,900.00	4,640,000	貸付株式数	600株
東京エレクトロニクス	2,000	6,350.00	12,700,000	貸付株式数	300株
ひらまつ	14,200	184.00	2,612,800	貸付株式数	100株
フィールズ	5,900	508.00	2,997,200		
双日	74,200	1,653.00	122,652,600		
アルフレッサホールディングス	75,300	1,550.00	116,715,000		
大黒天物産	2,100	5,460.00	11,466,000	貸付株式数	800株
ハニーズホールディングス	5,300	992.00	5,257,600		
ファーマライズHD	1,900	725.00	1,377,500		
キッコーマン	49,700	9,170.00	455,749,000		
味の素	152,500	3,457.00	527,192,500		
キューピー	36,200	2,487.00	90,029,400		
ハウス食品G本社	25,800	2,948.00	76,058,400	貸付株式数	300株
カゴメ	26,200	3,000.00	78,600,000		
焼津水産化工	3,400	935.00	3,179,000	貸付株式数	1,200株
アリアケジャパン	6,300	6,430.00	40,509,000		
ピエトロ	900	1,787.00	1,608,300	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,500	2,665.00	3,997,500		
やまみ	800	1,822.00	1,457,600		
ニチレイ	32,900	2,705.00	88,994,500		
横浜冷凍	18,600	822.00	15,289,200	貸付株式数	6,900株
東洋水産	33,100	4,860.00	160,866,000	貸付株式数	3,500株
イトアンドHLDGS	2,600	2,117.00	5,504,200	貸付株式数	1,000株
大冷	800	1,932.00	1,545,600	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,600	619.00	2,228,400	貸付株式数	1,400株
日清食品HD	27,100	8,770.00	237,667,000		
永谷園ホールディングス	3,000	1,940.00	5,820,000		
一正蒲鉾	2,800	805.00	2,254,000		
フジッコ	7,500	1,872.00	14,040,000		
ロックフィールド	7,500	1,477.00	11,077,500	貸付株式数	2,900株
日本たばこ産業	370,800	2,378.00	881,762,400		
ケンコーマヨネーズ	3,900	1,320.00	5,148,000	貸付株式数	1,500株
わらべや日洋HD	4,500	1,975.00	8,887,500	貸付株式数	1,700株
なとり	3,800	2,000.00	7,600,000	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,500	948.00	1,422,000	貸付株式数	300株
ピクルスコーポレーション	3,400	1,840.00	6,256,000	貸付株式数	1,200株

北の達人コーポ	24,000	336.00	8,064,000	貸付株式数 9,400株 (2,500株)
ユーグレナ	35,300	705.00	24,886,500	貸付株式数 13,600株
スター・マイカ・HLDGS	3,500	1,288.00	4,508,000	貸付株式数 500株
ADワークスグループ	13,100	154.00	2,017,400	貸付株式数 5,200株
片倉工業	8,800	2,360.00	20,768,000	
グンゼ	4,700	3,980.00	18,706,000	貸付株式数 600株
ヒューリック	162,400	1,083.00	175,879,200	貸付株式数 53,800株
神栄	1,200	819.00	982,800	貸付株式数 300株
ラサ商事	4,400	968.00	4,259,200	
アルペン	5,300	2,115.00	11,209,500	貸付株式数 2,000株
ハブ	2,200	650.00	1,430,000	貸付株式数 800株
ラクーンホールディングス	4,700	1,413.00	6,641,100	貸付株式数 1,800株
クオールホールディングス	8,200	1,348.00	11,053,600	貸付株式数 1,200株
アルコニックス	7,900	1,254.00	9,906,600	
神戸物産	52,500	4,060.00	213,150,000	貸付株式数 20,500株
ソリトンシステムズ	3,600	1,221.00	4,395,600	
ジンスホールディングス	4,600	6,650.00	30,590,000	貸付株式数 1,700株
ビックカメラ	40,200	935.00	37,587,000	貸付株式数 15,700株 (300株)
DCMホールディングス	41,800	1,074.00	44,893,200	
ペッパーフードサービス	9,200	379.00	3,486,800	貸付株式数 3,600株 (300株)
ハイパー	1,700	557.00	946,900	貸付株式数 600株
MonotaRO	85,700	2,037.00	174,570,900	
東京一番フーズ	1,700	581.00	987,700	貸付株式数 600株
DDホールディングス	3,500	489.00	1,711,500	貸付株式数 1,400株
あいホールディングス	9,700	1,883.00	18,265,100	
ディーブイエックス	2,100	1,097.00	2,303,700	貸付株式数 800株
きちりホールディングス	1,400	445.00	623,000	貸付株式数 500株
アークランドサービスHD	5,500	2,281.00	12,545,500	貸付株式数 2,000株
J. フロントリテイリング	80,800	949.00	76,679,200	
ドトール・日レスHD	11,400	1,553.00	17,704,200	貸付株式数 4,500株
マツキヨココカラ&カンパニー	41,600	4,380.00	182,208,000	
ブロンコビリー	3,800	2,382.00	9,051,600	貸付株式数 1,500株
ZOZO	46,500	3,425.00	159,262,500	
トレジャー・ファクトリー	2,100	912.00	1,915,200	貸付株式数 200株

物語コーポレーション	3,600	6,410.00	23,076,000	貸付株式数	1,400株
三越伊勢丹HD	118,200	790.00	93,378,000		
東洋紡	27,200	1,228.00	33,401,600		
ユニチカ	18,500	286.00	5,291,000		
富士紡ホールディングス	2,900	3,900.00	11,310,000	貸付株式数	400株
日清紡ホールディングス	41,700	865.00	36,070,500	貸付株式数	16,300株
倉敷紡績	5,600	1,956.00	10,953,600		
ダイワボウHD	32,800	1,779.00	58,351,200		
シキボウ	3,200	896.00	2,867,200	貸付株式数	400株
日東紡績	10,300	2,829.00	29,138,700		
トヨタ紡織	28,000	2,144.00	60,032,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	16,100	2,530.00	40,733,000	貸付株式数	1,400株
Hamee	1,900	1,272.00	2,416,800	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,347.00	7,041,000	貸付株式数	900株
ウエルシアHD	35,800	3,855.00	138,009,000		
クリエイトSDH	10,000	3,260.00	32,600,000	貸付株式数	3,700株
バイタルKSKHD	11,800	796.00	9,392,800	貸付株式数	3,300株
八洲電機	4,600	936.00	4,305,600	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	3,900	925.00	3,607,500	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,400	1,893.00	12,115,200	貸付株式数	1,000株
ジューテックHD	1,600	1,055.00	1,688,000	貸付株式数	500株
丸善CHIHD	7,700	355.00	2,733,500	貸付株式数	2,500株
大光	2,500	686.00	1,715,000	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	2,000	1,275.00	2,550,000	貸付株式数	700株
TOKAIホールディングス	32,800	844.00	27,683,200		
黒谷	1,500	600.00	900,000	貸付株式数	700株
ミサワ	1,900	675.00	1,282,500	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,400	1,317.00	1,843,800	貸付株式数	300株
Cominix	500	722.00	361,000	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	445.00	756,500	貸付株式数	400株
三洋貿易	7,700	971.00	7,476,700		
チムニー	2,000	1,190.00	2,380,000	貸付株式数	800株
シュッピン	5,500	1,008.00	5,544,000	貸付株式数	2,200株
ビューティガレージ	1,100	2,964.00	3,260,400	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,700	2,917.00	28,294,900	貸付株式数	3,800株
ウイン・パートナーズ	4,600	967.00	4,448,200	貸付株式数	1,800株

ネクステージ	13,700	2,251.00	30,838,700		
ジョイフル本田	19,700	1,431.00	28,190,700	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,600	1,684.00	4,378,400	貸付株式数	900株
ホットランド	4,900	1,308.00	6,409,200	貸付株式数	1,900株 (300株)
すかいらくHD	92,600	1,507.00	139,548,200	貸付株式数	34,200株
SFPホールディングス	3,300	1,327.00	4,379,100	貸付株式数	1,300株
綿半ホールディングス	5,000	1,243.00	6,215,000	貸付株式数	1,400株
日本毛織	20,300	912.00	18,513,600	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	12,100	99.00	1,197,900	貸付株式数	4,400株
トーア紡コーポレーション	2,300	426.00	979,800	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	7,600	152.00	1,155,200	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,300	1,875.00	2,437,500	貸付株式数	500株
ユニテッド・スーパー マーケ	19,700	1,047.00	20,625,900	貸付株式数	7,600株
三栄建築設計	2,600	1,650.00	4,290,000		
野村不動産HLDGS	35,100	2,488.00	87,328,800		
三重交通グループHD	13,300	468.00	6,224,400	貸付株式数	5,200株
サムティ	10,400	2,153.00	22,391,200	貸付株式数	4,100株
日本商業開発	4,600	1,784.00	8,206,400	貸付株式数	1,700株
プレサンスコーポレーション	8,800	1,916.00	16,860,800	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,152.00	2,582,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,255.00	1,129,500	貸付株式数	200株
日本管理センター	3,700	994.00	3,677,800		
サンセイランディック	1,200	810.00	972,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	625.00	687,500		
フージャースHD	8,600	637.00	5,478,200	貸付株式数	3,600株
オープンハウス	21,500	5,870.00	126,205,000		
東急不動産HD	200,200	596.00	119,319,200		
飯田GHHD	56,700	2,478.00	140,502,600		
イーグランド	800	1,452.00	1,161,600		
帝国繊維	7,600	2,031.00	15,435,600	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	1,109.00	4,325,100	貸付株式数	1,400株
ミタチ産業	1,300	927.00	1,205,100	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,600	2,366.00	8,517,600		
あさひ	5,600	1,337.00	7,487,200	貸付株式数	2,100株
日本調剤	4,200	1,296.00	5,443,200	貸付株式数	1,000株

コスモス薬品	6,800	17,540.00	119,272,000	貸付株式数	2,600株
シップヘルスケアHD	21,600	2,606.00	56,289,600	貸付株式数	3,200株
トーエル	3,100	800.00	2,480,000	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイイトHD	2,900	4,235.00	12,281,500	貸付株式数	100株
オンリー	1,100	759.00	834,900		
セブン&アイ・HLDGS	265,200	4,883.00	1,294,971,600		
クリエイイト・レストランツ・ホール	35,800	687.00	24,594,600	貸付株式数	14,200株
明治電機工業	1,900	1,234.00	2,344,600	貸付株式数	400株
ツルハホールディングス	14,800	11,960.00	177,008,000		
デリカフーズHLDGS	2,800	598.00	1,674,400	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディングス	1,600	1,047.00	1,675,200	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,200	1,420.00	7,384,000	貸付株式数	300株
フェリシモ	1,600	1,362.00	2,179,200	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	16,600	2,386.00	39,607,600	貸付株式数	6,500株
帝人	63,600	1,374.00	87,386,400		
東レ	487,000	666.80	324,731,600		
クラレ	98,700	990.00	97,713,000		
旭化成	447,000	1,063.50	475,384,500		
TOKYO BASE	6,900	577.00	3,981,300	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,700	1,323.00	4,895,100	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,000	3,185.00	6,370,000	貸付株式数	100株
トーカロ	17,300	1,425.00	24,652,500		
アルファCO	2,500	1,101.00	2,752,500	貸付株式数	1,000株
SUMCO	104,600	2,225.00	232,735,000	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,400	4,005.00	5,607,000		
RS TECHNOLOGIES	2,200	5,910.00	13,002,000		
信和	5,600	790.00	4,424,000		
ビーロット	4,000	532.00	2,128,000	貸付株式数	1,500株
ファーストブラザーズ	1,500	888.00	1,332,000	貸付株式数	600株 (200株)
ハウスドゥ	3,100	892.00	2,765,200	貸付株式数	600株
シーアールイー	1,900	1,630.00	3,097,000	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	700	1,650.00	1,155,000	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	3,000	8,040.00	24,120,000		
アグレ都市デザイン	900	1,476.00	1,328,400	貸付株式数	400株

ジェイ・エス・ビー	1,400	2,862.00	4,006,800	貸付株式数	500株
テンポイノベーション	1,600	850.00	1,360,000	貸付株式数	600株
グローバルリンクマネジメン ト	800	954.00	763,200	貸付株式数	400株
住江織物	1,300	1,471.00	1,912,300		
日本フェルト	4,100	441.00	1,808,100	貸付株式数	1,500株
イチカワ	800	1,363.00	1,090,400		
エコナックホールディング ス	13,500	89.00	1,201,500	貸付株式数	4,600株
日東製網	900	1,400.00	1,260,000	貸付株式数	200株
芦森工業	1,200	903.00	1,083,600	貸付株式数	100株
アツギ	5,200	563.00	2,927,600		
ウイルプラスHLDGS	1,000	897.00	897,000	貸付株式数	400株
JMホールディングス	4,900	1,629.00	7,982,100		
コマダホールディングス	14,600	1,996.00	29,141,600	貸付株式数	5,700株
サツドラホールディングス	3,000	642.00	1,926,000		
アレンザホールディングス	5,100	1,010.00	5,151,000	貸付株式数	2,000株
串カツ田中HLDGS	1,800	1,947.00	3,504,600	貸付株式数	700株
バロックジャパン	4,900	825.00	4,042,500	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキHLDGS	6,700	7,380.00	49,446,000	貸付株式数	2,600株
ダイニック	2,500	693.00	1,732,500		
共和レザー	3,800	630.00	2,394,000		
ピーバンドットコム	1,200	507.00	608,400	貸付株式数	400株
力の源HD	3,300	577.00	1,904,100	貸付株式数	1,300株
FOOD & LIFE CO MPAN	39,600	4,090.00	161,964,000		
アセンテック	2,200	949.00	2,087,800	貸付株式数	800株
セーレン	13,600	2,335.00	31,756,000	貸付株式数	6,400株
ソトー	2,000	809.00	1,618,000	貸付株式数	400株
東海染工	800	1,131.00	904,800	貸付株式数	100株
小松マテーレ	10,900	1,224.00	13,341,600	貸付株式数	2,700株
ワコールホールディングス	16,800	2,124.00	35,683,200		
ホギメディカル	8,900	3,225.00	28,702,500	貸付株式数	2,700株
クラウドシアHLDGS	1,000	228.00	228,000	貸付株式数	600株
TSIホールディングス	22,100	325.00	7,182,500	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,100	1,188.00	2,494,800	貸付株式数	800株
ワールド	8,600	1,111.00	9,554,600		
TIS	64,300	3,435.00	220,870,500		
JNSホールディングス	2,900	462.00	1,339,800	貸付株式数	1,100株
グリー	42,600	740.00	31,524,000	貸付株式数	16,200株



コーエーテクモHD	21,100	4,670.00	98,537,000		
三菱総合研究所	2,800	3,910.00	10,948,000		
ボルテージ	2,000	350.00	700,000	貸付株式数	900株
電算	800	2,331.00	1,864,800	貸付株式数	100株
AGS	3,100	866.00	2,684,600	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	6,100	985.00	6,008,500	貸付株式数	1,600株
ブレインパッド	1,700	4,465.00	7,590,500	貸付株式数	200株
KLab	12,100	485.00	5,868,500	貸付株式数	4,800株
ポルトゥウィン・ピット クル	9,600	942.00	9,043,200		
イーブックイニシアティブ	300	4,725.00	1,417,500		
ネクソン	152,300	2,226.00	339,019,800		
アイスタイル	21,600	256.00	5,529,600	貸付株式数	8,000株
エムアップホールディング ス	2,000	3,930.00	7,860,000		
エイチーム	4,600	864.00	3,974,400		
エニグモ	7,200	760.00	5,472,000	貸付株式数	2,800株
テクノスジャパン	5,300	480.00	2,544,000	貸付株式数	2,000株
enish	4,100	361.00	1,480,100	貸付株式数	1,600株
コロプラ	22,000	651.00	14,322,000		
オルトプラス	5,100	316.00	1,611,600	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	33,800	450.00	15,210,000	貸付株式数	13,200株
クロス・マーケティングG	3,300	954.00	3,148,200	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツHLDGS	3,000	2,262.00	6,786,000		
システム情報	5,400	806.00	4,352,400	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,400	4,100.00	9,840,000	貸付株式数	900株
じげん	18,300	285.00	5,215,500		
ブイキューブ	7,000	1,024.00	7,168,000	貸付株式数	2,600株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	599.00	658,900	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,600	996.00	2,589,600	貸付株式数	800株
ディー・エル・イー	4,300	256.00	1,100,800		
フィックスターズ	7,100	761.00	5,403,100	貸付株式数	2,800株
CARTA HOLDING GS	2,700	1,942.00	5,243,400	貸付株式数	1,200株
オプティム	4,600	1,271.00	5,846,600	貸付株式数	1,800株
セレス	2,600	2,384.00	6,198,400	貸付株式数	900株
SHIFT	3,400	23,070.00	78,438,000		
特種東海製紙	4,100	4,010.00	16,441,000		
ティーガイア	5,900	1,588.00	9,369,200	貸付株式数	1,400株
セック	800	2,316.00	1,852,800	貸付株式数	300株

テクマトリックス	11,300	1,911.00	21,594,300	貸付株式数	3,900株
プロシップ	2,200	1,484.00	3,264,800	貸付株式数	800株
ガンホー・オンライン・エンター	18,200	2,627.00	47,811,400		
GMOペイメントゲートウェイ	13,100	13,510.00	176,981,000		
ザッパラス	4,100	565.00	2,316,500	貸付株式数	300株
システムリサーチ	2,100	1,941.00	4,076,100	貸付株式数	600株
インターネットイニシアティブ	18,000	4,565.00	82,170,000		
さくらインターネット	7,800	544.00	4,243,200	貸付株式数	2,800株 (100株)
ヴィンクス	1,700	787.00	1,337,900	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,500	4,080.00	6,120,000	貸付株式数	500株 (400株)
SRAホールディングス	3,000	2,785.00	8,355,000		
システムインテグレータ	1,800	533.00	959,400	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,200	587.00	3,639,400		
eBASE	8,600	608.00	5,228,800	貸付株式数	3,100株
アバント	7,700	1,155.00	8,893,500		
アドソル日進	2,700	1,646.00	4,444,200	貸付株式数	600株
フリービット	4,000	1,031.00	4,124,000	貸付株式数	1,500株 (100株)
コムチュア	7,500	3,240.00	24,300,000		
サイバーコム	800	1,132.00	905,600	貸付株式数	400株
アステリア	4,700	750.00	3,525,000	貸付株式数	1,800株
アイル	3,600	1,376.00	4,953,600		
王子ホールディングス	281,600	550.00	154,880,000		
日本製紙	32,200	1,081.00	34,808,200		
三菱製紙	8,600	311.00	2,674,600		
北越コーポレーション	43,500	693.00	30,145,500		
中越パルプ	2,300	945.00	2,173,500	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,100	793.00	1,665,300		
大王製紙	32,500	1,835.00	59,637,500		
阿波製紙	1,200	333.00	399,600	貸付株式数	400株
マークライNZ	3,600	2,609.00	9,392,400		
メディカル・データ・ビジ	8,900	1,099.00	9,781,100	貸付株式数	3,000株
gumi	9,500	667.00	6,336,500	貸付株式数	3,600株
ショーケース	1,900	484.00	919,600	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	2,100	827.00	1,736,700	貸付株式数	600株

テラスカイ	2,500	1,799.00	4,497,500	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,800	1,258.00	3,522,400	貸付株式数	1,100株
P C Iホールディングス	2,900	1,144.00	3,317,600	貸付株式数	1,200株
パイプドHD	1,600	2,491.00	3,985,600		
アイビーシー	900	701.00	630,900	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,800	1,370.00	2,466,000	貸付株式数	700株
P R T I M E S	1,800	2,937.00	5,286,600	貸付株式数	500株
ラクス	23,100	3,025.00	69,877,500		
ランドコンピュータ	1,500	819.00	1,228,500		
ダブルスタンダード	2,000	2,920.00	5,840,000		
オープンドア	3,900	1,857.00	7,242,300	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,600	536.00	1,393,600	貸付株式数	1,000株
アカツキ	3,000	2,545.00	7,635,000		
ベネフィットジャパン	700	2,562.00	1,793,400		
U B I C O Mホールディングス	1,700	2,511.00	4,268,700	貸付株式数	700株
カナミックネットワーク	7,500	474.00	3,555,000	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	255.00	994,500	貸付株式数	1,400株
レンゴー	63,500	850.00	53,975,000	貸付株式数	3,200株
トーモク	4,100	1,708.00	7,002,800		
ザ・パック	5,100	2,714.00	13,841,400	貸付株式数	2,000株
チェンジ	12,600	1,736.00	21,873,600		
シンクロ・フード	3,700	325.00	1,202,500	貸付株式数	400株
オークネット	3,900	1,523.00	5,939,700	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	2,000	745.00	1,490,000	貸付株式数	600株
エイトレッド	900	2,266.00	2,039,400	貸付株式数	500株
マクロミル	13,500	997.00	13,459,500	貸付株式数	1,500株
ビーグリー	1,700	1,788.00	3,039,600		
オロ	2,100	3,065.00	6,436,500	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,000	1,566.00	3,132,000	貸付株式数	800株
テモナ	2,000	464.00	928,000	貸付株式数	600株
ニーズウェル	1,800	558.00	1,004,400	貸付株式数	500株
マネーフォワード	10,200	6,170.00	62,934,000	貸付株式数	1,000株
サインポスト	2,100	1,120.00	2,352,000	貸付株式数	800株
昭和電工	58,300	2,397.00	139,745,100		
住友化学	495,200	517.00	256,018,400		
住友精化	2,900	3,020.00	8,758,000	貸付株式数	400株
日産化学	36,600	6,470.00	236,802,000		

ラサ工業	2,200	1,601.00	3,522,200		
クレハ	5,300	8,020.00	42,506,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,600	5,510.00	14,326,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,700	1,238.00	5,818,600		
石原産業	10,800	1,104.00	11,923,200	貸付株式数	1,300株
片倉コープアグリ	1,100	1,151.00	1,266,100	貸付株式数	200株
日本曹達	8,500	3,205.00	27,242,500	貸付株式数	1,200株
東ソー	97,300	1,666.00	162,101,800		
トクヤマ	21,500	1,778.00	38,227,000		
セントラル硝子	11,500	2,024.00	23,276,000	貸付株式数	2,800株
東亜合成	39,000	1,163.00	45,357,000		
大阪ソーダ	6,100	2,845.00	17,354,500	貸付株式数	800株
関東電化	14,200	1,013.00	14,384,600	貸付株式数	1,800株
デンカ	24,600	3,570.00	87,822,000		
イビデン	36,000	6,530.00	235,080,000		
信越化学	115,700	19,225.00	2,224,332,500		
日本カ-バイド	1,900	1,267.00	2,407,300	貸付株式数	300株
電算システムHD	2,700	2,685.00	7,249,500	貸付株式数	1,000株
堺化学	4,400	2,214.00	9,741,600	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,000	1,216.00	7,296,000	貸付株式数	800株
エア・ウォーター	63,700	1,770.00	112,749,000	貸付株式数	2,500株
日本酸素HLDGS	64,800	2,523.00	163,490,400		
日本化学工業	2,000	2,562.00	5,124,000		
東邦アセチレン	1,200	1,217.00	1,460,400	貸付株式数	300株
日本パ-カラヱジング	34,000	1,085.00	36,890,000		
高圧ガス	10,300	756.00	7,786,800		
チタン工業	600	1,622.00	973,200	貸付株式数	300株
四国化成	8,600	1,346.00	11,575,600		
戸田工業	1,500	3,715.00	5,572,500	貸付株式数	500株
ステラケミファ	3,200	2,462.00	7,878,400	貸付株式数	1,000株
保土谷化学	2,100	5,390.00	11,319,000		
日本触媒	11,300	5,250.00	59,325,000	貸付株式数	1,300株
大日精化	5,500	2,206.00	12,133,000		
カネカ	17,400	3,645.00	63,423,000		
協和キリン	80,800	3,160.00	255,328,000		
三菱瓦斯化学	62,700	1,874.00	117,499,800		
三井化学	61,200	3,045.00	186,354,000		
JSR	62,700	4,255.00	266,788,500		
東京応化工業	11,600	6,770.00	78,532,000		
大阪有機化学	6,100	3,320.00	20,252,000		

三菱ケミカルHLDGS	450,700	828.10	373,224,670	
KHネオケム	11,100	2,979.00	33,066,900	
ダイセル	96,000	776.00	74,496,000	
住友ベークライト	10,500	5,470.00	57,435,000	
積水化学	141,100	1,891.00	266,820,100	
日本ゼオン	60,300	1,240.00	74,772,000	
アイカ工業	18,800	3,435.00	64,578,000	
宇部興産	32,100	1,943.00	62,370,300	
積水樹脂	10,200	2,023.00	20,634,600	
タキロンシーアイ	16,400	533.00	8,741,200	
旭有機材	5,000	1,614.00	8,070,000	
ニチバン	3,900	1,795.00	7,000,500	貸付株式数 1,200株
リケンテクノス	16,200	491.00	7,954,200	貸付株式数 700株
大倉工業	3,300	2,141.00	7,065,300	貸付株式数 1,300株
積水化成製品	14,700	474.00	6,967,800	
群栄化学	1,400	3,440.00	4,816,000	
タイガース ポリマー	9,600	448.00	4,300,800	
ミライアル	2,100	1,753.00	3,681,300	
ダイキアクシス	2,600	830.00	2,158,000	貸付株式数 1,000株
ダイキョーニシカワ	16,500	546.00	9,009,000	
竹本容器	2,900	850.00	2,465,000	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,500	1,781.00	6,233,500	
日本化薬	52,900	1,178.00	62,316,200	
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	443.00	2,658,000	
レッグス	1,300	1,356.00	1,762,800	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	24,700	663.00	16,376,100	貸付株式数 8,000株
フェイス	1,900	678.00	1,288,200	貸付株式数 700株
プロトコーポレーション	7,100	1,311.00	9,308,100	貸付株式数 3,000株
ハイマックス	1,600	1,060.00	1,696,000	貸付株式数 100株
アミューズ	3,600	2,001.00	7,203,600	
野村総合研究所	130,500	4,835.00	630,967,500	
ドリームインキュベータ	1,800	1,321.00	2,377,800	貸付株式数 700株
サイバネットシステム	5,300	696.00	3,688,800	
クイック	4,300	1,438.00	6,183,400	
TAC	4,200	221.00	928,200	
CEホールディングス	3,300	474.00	1,564,200	貸付株式数 1,400株
日本システム技術	1,300	2,453.00	3,188,900	貸付株式数 400株
電通グループ	67,900	3,950.00	268,205,000	

インテージホールディングス	8,800	1,643.00	14,458,400	貸付株式数	3,200株
テイクアンドギヴニーズ	3,100	945.00	2,929,500	貸付株式数	1,200株
東邦システムサイエンス	1,500	1,016.00	1,524,000	貸付株式数	600株
びあ	2,300	3,310.00	7,613,000	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	2,500	1,751.00	4,377,500	貸付株式数	900株
ソースネクスト	28,000	181.00	5,068,000	貸付株式数	9,100株
シーティーエス	7,300	756.00	5,518,800	貸付株式数	2,900株
ネクシィーズグループ	2,300	687.00	1,580,100	貸付株式数	800株
インフォコム	7,400	1,976.00	14,622,400		
メディカルシステムネットワーク	6,500	562.00	3,653,000		
日本精化	5,300	2,154.00	11,416,200		
扶桑化学工業	6,000	4,575.00	27,450,000		
トリケミカル	6,900	3,495.00	24,115,500	貸付株式数	2,000株
HEROZ	1,800	1,269.00	2,284,200	貸付株式数	700株
ラクスル	7,400	4,985.00	36,889,000	貸付株式数	2,800株
FIG	6,800	316.00	2,148,800	貸付株式数	2,700株
システムサポート	1,900	1,127.00	2,141,300		
ADEKA	30,800	2,463.00	75,860,400		
日油	22,900	5,610.00	128,469,000	貸付株式数	1,800株
ミヨシ油脂	2,400	1,311.00	3,146,400	貸付株式数	900株
新日本理化	13,000	246.00	3,198,000	貸付株式数	4,200株
ハリマ化成グループ	5,000	792.00	3,960,000		
イーソル	4,000	602.00	2,408,000	貸付株式数	1,600株
アルテリア・ネットワークス	8,600	1,550.00	13,330,000	貸付株式数	1,800株
東海ソフト	900	966.00	869,400	貸付株式数	400株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,500	2,155.00	3,232,500	貸付株式数	500株
トピラスシステムズ	1,300	765.00	994,500	貸付株式数	500株
Sansan	24,000	2,336.00	56,064,000	貸付株式数	700株
花王	152,300	6,062.00	923,242,600		
第一工業製薬	2,400	2,987.00	7,168,800		
石原ケミカル	3,400	1,300.00	4,420,000		
日華化学	2,100	819.00	1,719,900	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,122.00	2,970,800	貸付株式数	100株
三洋化成	4,000	5,110.00	20,440,000		
武田薬品	541,000	3,126.00	1,691,166,000		
アステラス製薬	596,800	1,837.50	1,096,620,000		

大日本住友製薬	42,400	1,335.00	56,604,000	
塩野義製薬	86,500	7,712.00	667,088,000	
わかもと製薬	8,500	290.00	2,465,000	貸付株式数 3,200株
日本新薬	18,000	7,960.00	143,280,000	貸付株式数 800株
中外製薬	215,300	3,617.00	778,740,100	
科研製薬	10,700	4,225.00	45,207,500	貸付株式数 500株
エーザイ	82,400	6,876.00	566,582,400	
理研ビタミン	7,100	1,666.00	11,828,600	貸付株式数 800株
ロート製薬	35,300	3,400.00	120,020,000	
小野薬品	158,000	2,821.00	445,718,000	
久光製薬	18,200	3,940.00	71,708,000	
有機合成薬品	4,300	264.00	1,135,200	貸付株式数 1,900株
持田製薬	8,600	3,385.00	29,111,000	貸付株式数 1,300株
参天製薬	128,400	1,391.00	178,604,400	
扶桑薬品	2,400	2,529.00	6,069,600	貸付株式数 100株
日本ケミファ	900	2,001.00	1,800,900	
ツムラ	21,200	3,260.00	69,112,000	
日医工	21,000	688.00	14,448,000	貸付株式数 8,300株
テルモ	194,800	4,721.00	919,650,800	
HUグループHD	17,000	2,792.00	47,464,000	貸付株式数 6,700株
キッセイ薬品工業	12,100	2,200.00	26,620,000	
生化学工業	12,000	925.00	11,100,000	
栄研化学	12,000	1,905.00	22,860,000	
日水製薬	2,700	1,073.00	2,897,100	貸付株式数 800株
鳥居薬品	3,700	2,867.00	10,607,900	
JCRファーマ	19,300	2,198.00	42,421,400	
東和薬品	9,800	2,680.00	26,264,000	
富士製薬工業	4,500	981.00	4,414,500	
ゼリア新薬工業	12,300	1,948.00	23,960,400	貸付株式数 4,900株
第一三共	540,700	2,771.00	1,498,279,700	
キョーリン製薬HD	13,600	1,774.00	24,126,400	貸付株式数 2,000株
大幸薬品	10,500	705.00	7,402,500	貸付株式数 4,000株
ダイト	4,400	2,927.00	12,878,800	
大塚ホールディングス	143,100	4,204.00	601,592,400	
大正製薬HD	16,400	5,340.00	87,576,000	貸付株式数 800株
ペプチドリーム	36,000	2,727.00	98,172,000	
大日本塗料	7,800	820.00	6,396,000	貸付株式数 3,100株
日本ペイントHOLD	253,400	1,207.00	305,853,800	
関西ペイント	70,000	2,538.00	177,660,000	貸付株式数 3,100株
神東塗料	5,800	175.00	1,015,000	貸付株式数 1,800株

中国塗料	16,400	903.00	14,809,200	
日本特殊塗料	4,900	821.00	4,022,900	
藤倉化成	7,700	472.00	3,634,400	貸付株式数 1,000株
太陽ホールディングス	9,900	3,215.00	31,828,500	
D I C	28,600	2,875.00	82,225,000	
サカティンクス	13,700	990.00	13,563,000	貸付株式数 4,400株
東洋インキ S C ホールディ ン	14,300	1,935.00	27,670,500	貸付株式数 1,400株
T & K T O K A	5,200	790.00	4,108,000	
アルプス技研	5,800	1,875.00	10,875,000	
サニックス	11,300	228.00	2,576,400	貸付株式数 4,500株
ダイオーズ	1,100	1,021.00	1,123,100	貸付株式数 400株
日本空調サービス	6,400	782.00	5,004,800	
オリエンタルランド	77,700	19,260.00	1,496,502,000	
フォーカスシステムズ	4,200	937.00	3,935,400	貸付株式数 1,300株
ダスキン	15,000	2,760.00	41,400,000	
パーク 2 4	36,200	1,456.00	52,707,200	
明光ネットワークジャパン	8,100	551.00	4,463,100	貸付株式数 3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,997.00	5,791,300	貸付株式数 400株
クレスコ	4,700	1,949.00	9,160,300	貸付株式数 1,100株
フジ・メディア・HD	65,200	1,109.00	72,306,800	
秀英予備校	2,200	405.00	891,000	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	1,256.00	22,608,000	貸付株式数 6,100株
リゾートトラスト	29,900	1,807.00	54,029,300	貸付株式数 11,200株
オービック	21,300	21,130.00	450,069,000	
ジャストシステム	9,600	5,400.00	51,840,000	
T D C ソフト	5,900	1,049.00	6,189,100	
Zホールディングス	980,400	642.20	629,612,880	
ビー・エム・エル	8,400	3,455.00	29,022,000	
トレンドマイクロ	36,100	6,710.00	242,231,000	
りらいあコミュニケーショ	10,000	953.00	9,530,000	
I D ホールディングス	3,700	846.00	3,130,200	貸付株式数 900株
リソー教育	29,700	379.00	11,256,300	貸付株式数 5,000株
日本オラクル	13,700	10,190.00	139,603,000	
早稲田アカデミー	3,800	1,038.00	3,944,400	貸付株式数 400株
アルファシステムズ	1,700	3,850.00	6,545,000	貸付株式数 700株
フューチャー	7,900	3,365.00	26,583,500	
C A C H O L D I N G S	3,700	1,464.00	5,416,800	貸付株式数 1,400株
S B テクノロジー	2,900	2,439.00	7,073,100	貸付株式数 1,000株



トーセ	1,700	716.00	1,217,200	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	73,800	1,763.00	130,109,400		
オービックビジネスC	6,500	4,920.00	31,980,000	貸付株式数	2,500株
伊藤忠テクノソリューションズ	30,800	3,710.00	114,268,000		
アイティフォー	7,500	778.00	5,835,000	貸付株式数	500株
東京個別指導学院	5,900	613.00	3,616,700	貸付株式数	2,200株
東計電算	900	5,080.00	4,572,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	161,600	1,852.00	299,283,200		
楽天グループ	337,000	1,111.00	374,407,000		
エクスネット	900	982.00	883,800	貸付株式数	200株
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,966.00	6,881,000		
テー・オー・ダブリュー	10,800	305.00	3,294,000	貸付株式数	4,200株
大塚商会	36,500	5,480.00	200,020,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,200	1,824.00	16,780,800		
山田コンサルティンググループ	3,200	1,136.00	3,635,200	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,500	2,359.00	5,897,500	貸付株式数	900株
パラカ	1,900	1,528.00	2,903,200	貸付株式数	600株
電通国際情報サービス	9,800	3,730.00	36,554,000		
ACCESS	7,300	695.00	5,073,500	貸付株式数	500株
デジタルガレージ	11,100	4,715.00	52,336,500		
イーエムシステムズ	11,700	761.00	8,903,700	貸付株式数	2,800株
ウェザーニューズ	2,000	8,980.00	17,960,000	貸付株式数	700株
CIJ	4,000	847.00	3,388,000	貸付株式数	1,600株
ビジネスエンジニアリング	800	3,640.00	2,912,000	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	8,400	170.00	1,428,000	貸付株式数	400株
WOWOW	3,300	1,828.00	6,032,400	貸付株式数	1,300株
スカラ	6,500	650.00	4,225,000	貸付株式数	2,300株
インテリジェントウェイブ	3,300	519.00	1,712,700		
フルキャストホールディングス	5,700	2,417.00	13,776,900		
エン・ジャパン	10,600	3,280.00	34,768,000	貸付株式数	1,500株
あすか製薬HD	7,800	931.00	7,261,800		
サワイグループHD	15,000	4,440.00	66,600,000		
富士フイルムホールディングス	120,900	8,405.00	1,016,164,500		
コニカミノルタ	149,700	496.00	74,251,200		
資生堂	128,200	6,508.00	834,325,600		
ライオン	83,100	1,605.00	133,375,500		
高砂香料	4,600	2,764.00	12,714,400		

マンダム	14,500	1,363.00	19,763,500	貸付株式数	5,300株
ミルボン	8,500	5,720.00	48,620,000	貸付株式数	3,200株
ファンケル	27,800	3,475.00	96,605,000		
コーセー	12,900	13,270.00	171,183,000		
コタ	4,700	1,564.00	7,350,800		
シーボン	800	1,690.00	1,352,000	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスHD	29,300	1,994.00	58,424,200		
ノエビアホールディングス	5,800	5,370.00	31,146,000	貸付株式数	2,100株
アジュバンホールディング	1,900	1,115.00	2,118,500	貸付株式数	600株
エステー	4,400	1,511.00	6,648,400		
アグロカネショウ	2,500	1,265.00	3,162,500	貸付株式数	900株
コニシ	11,500	1,662.00	19,113,000	貸付株式数	1,200株
長谷川香料	11,700	2,708.00	31,683,600	貸付株式数	700株
星光PMC	3,500	687.00	2,404,500		
小林製薬	19,300	9,170.00	176,981,000		
荒川化学工業	5,400	1,162.00	6,274,800	貸付株式数	1,900株
メック	5,200	3,825.00	19,890,000	貸付株式数	2,000株
日本高純度化学	1,700	2,501.00	4,251,700		
タカラバイオ	17,900	2,633.00	47,130,700		
JCU	7,700	4,940.00	38,038,000		
新田ゼラチン	4,100	595.00	2,439,500	貸付株式数	1,600株
OATアグリオ	1,300	1,854.00	2,410,200	貸付株式数	500株
デクセリアルズ	17,800	3,775.00	67,195,000	貸付株式数	2,000株
アース製薬	5,600	6,210.00	34,776,000	貸付株式数	2,200株
北興化学	6,400	860.00	5,504,000		
大成ラミック	2,000	2,790.00	5,580,000		
クミアイ化学	27,100	771.00	20,894,100		
日本農薬	12,100	470.00	5,687,000		
富士興産	2,100	998.00	2,095,800		
ニチレキ	8,700	1,393.00	12,119,100		
ユシロ化学	3,400	1,067.00	3,627,800	貸付株式数	500株
ビーピー・カストロール	2,400	1,385.00	3,324,000		
富士石油	18,900	244.00	4,611,600	貸付株式数	7,100株
MORESCO	1,800	1,118.00	2,012,400	貸付株式数	700株
出光興産	76,400	2,881.00	220,108,400		
ENEOSホールディングス	1,037,000	424.40	440,102,800		
コスモエネルギーHLDGS	19,700	2,240.00	44,128,000	貸付株式数	1,100株
インフロニアHD	91,600	1,000.00	91,600,000		

横浜ゴム	39,500	1,762.00	69,599,000	
TOYO TIRE	36,000	1,729.00	62,244,000	
ブリヂストン	198,200	4,748.00	941,053,600	
住友ゴム	61,500	1,137.00	69,925,500	
藤倉コンポジット	6,200	789.00	4,891,800	貸付株式数 2,400株
オカモト	4,500	4,025.00	18,112,500	
アキレス	4,500	1,235.00	5,557,500	貸付株式数 500株
フコク	2,700	942.00	2,543,400	
ニッタ	8,200	2,843.00	23,312,600	
クリエートメディック	1,800	991.00	1,783,800	
住友理工	15,500	585.00	9,067,500	
三ツ星ベルト	9,600	2,079.00	19,958,400	
バンドー化学	11,100	866.00	9,612,600	貸付株式数 1,500株
A G C	62,900	5,400.00	339,660,000	
日本板硝子	34,200	489.00	16,723,800	
石塚硝子	1,000	1,972.00	1,972,000	貸付株式数 400株
有沢製作所	9,800	937.00	9,182,600	貸付株式数 3,600株
日本山村硝子	2,400	776.00	1,862,400	貸付株式数 900株
日本電気硝子	28,000	2,933.00	82,124,000	
オハラ	2,800	1,229.00	3,441,200	貸付株式数 1,000株 (100株)
住友大阪セメント	13,300	3,535.00	47,015,500	
太平洋セメント	39,100	2,261.00	88,405,100	
リソルホールディングス	800	4,135.00	3,308,000	貸付株式数 200株
日本ヒュム	6,900	678.00	4,678,200	
日本コンクリート	13,300	262.00	3,484,600	貸付株式数 1,800株
三谷セキサン	3,200	7,560.00	24,192,000	貸付株式数 1,200株
アジアパイルHD	10,300	436.00	4,490,800	
東海カーボン	57,600	1,187.00	68,371,200	
日本カーボン	4,200	4,220.00	17,724,000	
東洋炭素	5,100	3,250.00	16,575,000	
ノリタケ	3,900	4,715.00	18,388,500	
TOTO	49,100	5,170.00	253,847,000	
日本碍子	73,500	1,878.00	138,033,000	
日本特殊陶業	52,300	1,947.00	101,828,100	
ダントーホールディングス	6,200	217.00	1,345,400	貸付株式数 1,600株
MARUWA	2,400	14,860.00	35,664,000	
品川リフラクトリーズ	1,900	3,620.00	6,878,000	
黒崎播磨	1,400	4,010.00	5,614,000	
ヨータイ	5,000	1,220.00	6,100,000	貸付株式数 800株

イソライト	4,300	845.00	3,633,500	
東京窯業	14,700	306.00	4,498,200	貸付株式数 3,000株
ニッカトー	4,300	677.00	2,911,100	
フジインコーポレーテッド	5,600	7,270.00	40,712,000	
クニミネ工業	3,000	1,012.00	3,036,000	
エーアンドエーマテリアル	900	894.00	804,600	貸付株式数 300株
ニチアス	15,800	2,655.00	41,949,000	貸付株式数 800株
日本製鉄	304,500	1,848.50	562,868,250	
神戸製鋼所	126,700	560.00	70,952,000	
中山製鋼所	9,800	420.00	4,116,000	
合同製鐵	3,500	1,360.00	4,760,000	
J F E ホールディングス	183,500	1,449.00	265,891,500	
東京製鐵	22,900	1,345.00	30,800,500	貸付株式数 4,900株
共英製鋼	7,600	1,324.00	10,062,400	貸付株式数 700株
大和工業	13,000	3,580.00	46,540,000	貸付株式数 2,100株
東京鐵鋼	2,800	1,311.00	3,670,800	
大阪製鐵	3,500	1,155.00	4,042,500	貸付株式数 1,300株
淀川製鋼所	8,900	2,448.00	21,787,200	貸付株式数 400株
丸一鋼管	24,100	2,538.00	61,165,800	貸付株式数 300株
モリ工業	1,900	2,639.00	5,014,100	
大同特殊鋼	11,000	4,035.00	44,385,000	
日本高周波	2,300	332.00	763,600	貸付株式数 800株
日本冶金工	4,700	2,160.00	10,152,000	
山陽特殊製鋼	6,900	1,955.00	13,489,500	貸付株式数 1,700株
愛知製鋼	3,800	2,470.00	9,386,000	
日立金属	71,500	2,115.00	151,222,500	
日本金属	1,700	964.00	1,638,800	貸付株式数 500株
大平洋金属	4,000	2,033.00	8,132,000	
新日本電工	44,300	288.00	12,758,400	貸付株式数 6,900株
栗本鉄工所	3,000	1,498.00	4,494,000	
虹 技	600	968.00	580,800	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	700	1,090.00	763,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	20,600	3,520.00	72,512,000	
三菱製鋼	4,400	990.00	4,356,000	貸付株式数 1,800株
日亜鋼業	8,100	268.00	2,170,800	
日本精線	1,100	4,780.00	5,258,000	貸付株式数 400株
エンビプロHD	2,800	1,710.00	4,788,000	貸付株式数 1,100株
大紀アルミニウム	10,100	1,398.00	14,119,800	
日本軽金属HD	17,200	1,656.00	28,483,200	

三井金属	18,300	3,010.00	55,083,000	
東邦亜鉛	3,700	2,143.00	7,929,100	
三菱マテリアル	44,700	1,944.00	86,896,800	
住友鉱山	87,000	4,304.00	374,448,000	
DOWAホールディングス	18,500	4,515.00	83,527,500	
古河機金	11,200	1,225.00	13,720,000	貸付株式数 700株
エス・サイエンス	23,300	25.00	582,500	貸付株式数 9,300株
大阪チタニウム	7,600	760.00	5,776,000	貸付株式数 2,800株
東邦チタニウム	12,500	884.00	11,050,000	貸付株式数 200株
UACJ	10,300	2,436.00	25,090,800	
CKサンエツ	1,400	3,990.00	5,586,000	
古河電工	21,400	2,212.00	47,336,800	
住友電工	254,200	1,461.00	371,386,200	
フジクラ	75,500	539.00	40,694,500	
昭和電線HLDGS	5,800	1,679.00	9,738,200	貸付株式数 1,000株
東京特殊電線	1,100	2,928.00	3,220,800	貸付株式数 400株
タツタ電線	12,500	458.00	5,725,000	
カナレ電気	800	1,735.00	1,388,000	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	3,700	1,182.00	4,373,400	貸付株式数 1,400株
リョービ	8,100	1,064.00	8,618,400	貸付株式数 1,600株
アールステイ	6,600	357.00	2,356,200	貸付株式数 1,700株
アサヒHD	27,200	1,987.00	54,046,400	
東洋製罐グループHD	43,500	1,402.00	60,987,000	
ホッカンホールディングス	5,100	1,426.00	7,272,600	貸付株式数 1,400株
コロナ	3,700	898.00	3,322,600	貸付株式数 200株
横河ブリッジHLDGS	11,600	2,160.00	25,056,000	
駒井ハルテック	1,200	2,208.00	2,649,600	貸付株式数 200株
高田機工	600	2,728.00	1,636,800	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	64,200	1,179.00	75,691,800	
文化シャツタ-	21,200	1,031.00	21,857,200	貸付株式数 8,400株
三協立山	9,400	709.00	6,664,600	
アルインコ	4,600	945.00	4,347,000	貸付株式数 1,800株
東洋シャツタ-	1,600	587.00	939,200	
LIXIL	107,100	2,972.00	318,301,200	
日本フィルコン	7,900	519.00	4,100,100	
ノーリツ	13,600	1,688.00	22,956,800	
長府製作所	6,900	2,033.00	14,027,700	貸付株式数 2,600株
リンナイ	12,800	10,340.00	132,352,000	
ユニプレス	9,900	723.00	7,157,700	貸付株式数 1,600株
ダイニチ工業	3,800	755.00	2,869,000	

日東精工	9,500	592.00	5,624,000		
三洋工業	900	1,818.00	1,636,200	貸付株式数	100株
岡 部	13,100	725.00	9,497,500	貸付株式数	5,100株
ジーテクト	8,200	1,376.00	11,283,200		
東 プ レ	12,400	1,096.00	13,590,400		
高周波熱錬	11,800	567.00	6,690,600	貸付株式数	4,200株
東京製綱	2,900	867.00	2,514,300		
サンコール	5,400	452.00	2,440,800		
モリテックスチル	5,400	361.00	1,949,400		
パイオラックス	9,800	1,682.00	16,483,600	貸付株式数	1,100株
エイチワン	6,400	647.00	4,140,800	貸付株式数	1,000株
日本発条	61,600	979.00	60,306,400	貸付株式数	7,600株
中央発條	4,400	828.00	3,643,200		
アドバネクス	1,100	1,261.00	1,387,100	貸付株式数	300株
三浦工業	29,500	3,935.00	116,082,500		
タ ク マ	22,900	1,412.00	32,334,800		
テクノプロ・ホールディング グ	39,300	3,320.00	130,476,000		
アトラグループ	1,900	283.00	537,700	貸付株式数	600株
インターワークス	1,300	399.00	518,700	貸付株式数	500株
アイ・アールジャパンHD	3,000	6,480.00	19,440,000		
K e e P e r 技研	4,400	2,237.00	9,842,800		
ファーストロジック	1,500	780.00	1,170,000	貸付株式数	500株
三機サービス	1,300	1,003.00	1,303,900	貸付株式数	400株
G u n o s y	4,800	757.00	3,633,600	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	2,100	186.00	390,600	貸付株式数	700株
イー・ガーディアン	3,200	3,275.00	10,480,000		
リブセンス	4,400	182.00	800,800	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	20,000	1,783.00	35,660,000		
ベクトル	9,000	1,109.00	9,981,000	貸付株式数	3,600株
ウチヤマホールディングス	3,000	296.00	888,000	貸付株式数	1,200株
チャームケアコーポレー ション	5,400	1,382.00	7,462,800	貸付株式数	1,900株
キャリアリンク	2,500	1,249.00	3,122,500	貸付株式数	900株
I B J	5,900	885.00	5,221,500	貸付株式数	2,000株
アサンテ	2,700	1,714.00	4,627,800	貸付株式数	1,000株
バリューHR	2,700	2,601.00	7,022,700	貸付株式数	1,000株
M & A キャピタルパート ナー	5,500	5,380.00	29,590,000	貸付株式数	300株

ライドオンエクスプレスHD	2,600	1,577.00	4,100,200	貸付株式数	1,000株
E R Iホールディングス	1,700	1,299.00	2,208,300	貸付株式数	300株
アビスト	900	2,810.00	2,529,000	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス・ホールディング	3,900	2,522.00	9,835,800		
ウィルグループ	4,700	1,254.00	5,893,800	貸付株式数	1,800株
エスクローAJ	8,300	167.00	1,386,100	貸付株式数	3,800株
リクルートホールディングス	507,200	6,480.00	3,286,656,000		
エラン	9,700	1,108.00	10,747,600		
ツガミ	16,000	1,582.00	25,312,000	貸付株式数	5,800株
オークマ	8,000	4,890.00	39,120,000		
芝浦機械	7,500	3,580.00	26,850,000		
アマダ	107,400	1,078.00	115,777,200		
アイダエンジニア	17,400	952.00	16,564,800		
滝澤鉄工所	1,400	1,142.00	1,598,800		
F U J I	31,300	2,572.00	80,503,600		
牧野フライス	7,400	3,830.00	28,342,000	貸付株式数	700株
オーエスジー	31,400	1,708.00	53,631,200		
ダイジェット	500	972.00	486,000		
旭ダイヤモンド	17,000	609.00	10,353,000		
D M G森精機	40,200	1,860.00	74,772,000		
ソディック	16,100	771.00	12,413,100		
ディスコ	10,000	32,900.00	329,000,000		
日東工器	4,100	1,751.00	7,179,100		
日進工具	5,100	1,548.00	7,894,800	貸付株式数	600株
パンチ工業	5,800	504.00	2,923,200		
富士ダイス	2,800	644.00	1,803,200		
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	401.00	1,844,600	貸付株式数	1,200株
日本郵政	859,200	882.60	758,329,920		
ベルシステム24HLDGS	9,500	1,206.00	11,457,000		
鎌倉新書	7,300	620.00	4,526,000	貸付株式数	2,900株 (1,800株)
S M N	2,100	606.00	1,272,600	貸付株式数	500株
一蔵	1,000	380.00	380,000	貸付株式数	300株
グローバルキッズCOMP	1,700	731.00	1,242,700	貸付株式数	400株

エアトリ	4,600	3,265.00	15,019,000	貸付株式数	1,600株
アトラエ	4,900	2,438.00	11,946,200		
ストライク	2,600	5,160.00	13,416,000		
ソラスト	16,200	1,158.00	18,759,600		
セラク	2,000	1,576.00	3,152,000	貸付株式数	800株
インソース	6,700	2,724.00	18,250,800	貸付株式数	2,400株
豊田自動織機	55,800	9,030.00	503,874,000		
豊和工業	3,700	786.00	2,908,200		
OKK	2,900	800.00	2,320,000		
石川製作所	1,700	1,403.00	2,385,100	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,400	488.00	1,659,200	貸付株式数	700株
津田駒工業	1,000	661.00	661,000		
エンシュウ	900	631.00	567,900		
島精機製作所	9,900	1,967.00	19,473,300	貸付株式数	3,800株
オプトラン	8,400	2,337.00	19,630,800		
NCホールディングス	2,200	1,450.00	3,190,000	貸付株式数	100株
イワキポンプ	4,000	1,012.00	4,048,000		
フリーー	6,000	1,223.00	7,338,000	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	14,800	479.00	7,089,200	貸付株式数	5,500株
日阪製作所	8,100	804.00	6,512,400		
やまびこ	13,200	1,243.00	16,407,600		
平田機工	3,200	5,860.00	18,752,000		
ペガサスミシン製造	6,600	491.00	3,240,600		
マルマエ	2,800	2,743.00	7,680,400	貸付株式数	1,000株
タツモ	3,100	1,480.00	4,588,000		
ナプテスコ	39,000	3,155.00	123,045,000		
三井海洋開発	7,300	1,358.00	9,913,400		
レオン自動機	7,100	1,327.00	9,421,700	貸付株式数	2,700株
SMC	20,000	75,120.00	1,502,400,000		
ホソカワミクロン	4,700	3,070.00	14,429,000		
ユニオンツール	2,600	3,705.00	9,633,000	貸付株式数	900株
オイレス工業	11,600	1,743.00	20,218,800	貸付株式数	3,500株
日精エーエスピー	2,200	2,949.00	6,487,800		
サト - ホールディングス	8,800	2,098.00	18,462,400		
技研製作所	5,900	4,175.00	24,632,500		
日本エアテック	3,000	1,228.00	3,684,000	貸付株式数	1,200株
カワタ	2,000	887.00	1,774,000		
日精樹脂工業	4,500	1,001.00	4,504,500	貸付株式数	700株
オカダアイヨン	1,800	1,482.00	2,667,600	貸付株式数	700株



ワイエイシイホールディングス	2,600	857.00	2,228,200	貸付株式数	1,000株
小松製作所	312,000	2,597.00	810,264,000		
住友重機械	39,400	2,587.00	101,927,800		
日立建機	27,600	3,175.00	87,630,000		
日工	8,500	607.00	5,159,500	貸付株式数	2,200株
巴工業	3,400	2,250.00	7,650,000	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,300	1,357.00	8,549,100		
TOWA	5,800	3,080.00	17,864,000	貸付株式数	800株
丸山製作所	1,200	1,566.00	1,879,200		
北川鉄工所	3,000	1,457.00	4,371,000		
シンニッタン	14,200	219.00	3,109,800		
ローツェ	3,400	11,370.00	38,658,000		
タカキタ	2,300	620.00	1,426,000	貸付株式数	900株
クボタ	335,600	2,480.00	832,288,000		
荏原実業	3,100	2,487.00	7,709,700		
東洋エンジニア	9,100	684.00	6,224,400	貸付株式数	3,100株
三菱化工機	2,100	2,129.00	4,470,900		
月島機械	12,500	1,084.00	13,550,000	貸付株式数	2,700株
帝国電機製作所	4,500	1,470.00	6,615,000		
東京機械	3,400	1,072.00	3,644,800		
新東工業	14,800	686.00	10,152,800	貸付株式数	1,700株
渋谷工業	6,000	2,900.00	17,400,000		
アイチ コーポレーション	9,700	793.00	7,692,100	貸付株式数	3,600株
小森コーポレーション	17,100	706.00	12,072,600	貸付株式数	6,700株
鶴見製作所	5,100	1,593.00	8,124,300		
住友精密	900	2,038.00	1,834,200		
日本ギア工業	2,400	265.00	636,000	貸付株式数	900株
酒井重工業	1,100	2,705.00	2,975,500		
荏原製作所	28,500	6,090.00	173,565,000	貸付株式数	11,100株
石井鉄工所	800	2,982.00	2,385,600	貸付株式数	100株
西島製作所	5,900	898.00	5,298,200	貸付株式数	900株
北越工業	6,100	974.00	5,941,400	貸付株式数	2,400株
ダイキン工業	87,600	25,035.00	2,193,066,000		
オルガノ	1,900	7,570.00	14,383,000	貸付株式数	400株
ト - ヨ - カネツ	2,600	2,471.00	6,424,600		
栗田工業	37,200	5,140.00	191,208,000		
椿本チエイン	9,500	2,947.00	27,996,500	貸付株式数	1,200株
大同工業	2,800	934.00	2,615,200	貸付株式数	400株
日機装	21,500	823.00	17,694,500		

木村化工機	6,300	828.00	5,216,400	貸付株式数	2,200株
レイズネクスト	10,100	1,163.00	11,746,300	貸付株式数	1,900株
アネスト岩田	10,200	880.00	8,976,000	貸付株式数	3,600株
ダイフク	37,900	9,540.00	361,566,000		
サムコ	1,700	2,627.00	4,465,900	貸付株式数	700株
加藤製作所	2,700	783.00	2,114,100	貸付株式数	700株
油研工業	900	1,703.00	1,532,700	貸付株式数	200株
タダノ	35,800	1,026.00	36,730,800		
フジテック	25,500	2,350.00	59,925,000		
C K D	20,300	2,206.00	44,781,800		
キトー	5,600	1,826.00	10,225,600	貸付株式数	300株
平和	19,200	1,861.00	35,731,200		
理想科学工業	5,700	2,066.00	11,776,200		
S A N K Y O	14,800	3,010.00	44,548,000	貸付株式数	6,300株
日本金銭機械	6,600	659.00	4,349,400		
マースグループH L D G S	4,400	1,618.00	7,119,200		
フクシマガリレイ	4,700	4,510.00	21,197,000	貸付株式数	300株
オーズミ	2,300	379.00	871,700	貸付株式数	200株
ダイコク電機	3,100	1,195.00	3,704,500	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	10,400	2,608.00	27,123,200	貸付株式数	900株
ア マ ノ	18,000	2,512.00	45,216,000	貸付株式数	5,500株
J U K I	9,200	867.00	7,976,400		
サンデンホールディングス	9,300	218.00	2,027,400	貸付株式数	100株
ジャノメ	5,600	650.00	3,640,000	貸付株式数	2,400株
ブラザー工業	84,000	2,089.00	175,476,000		
マックス	8,900	1,807.00	16,082,300	貸付株式数	1,900株
モリタホールディングス	11,000	1,293.00	14,223,000		
グローリー	17,500	2,162.00	37,835,000	貸付株式数	4,900株
新晃工業	6,500	1,892.00	12,298,000		
大和冷機工業	10,900	1,188.00	12,949,200		
セガサミーホールディングス	68,200	1,815.00	123,783,000		
日本ピストンリング	2,700	1,231.00	3,323,700	貸付株式数	900株
リ ケ ン	2,800	2,475.00	6,930,000	貸付株式数	400株
T P R	9,100	1,341.00	12,203,100	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	15,000	1,407.00	21,105,000		
ホシザキ	20,100	8,480.00	170,448,000		
大豊工業	6,000	767.00	4,602,000		
日本精工	127,800	725.00	92,655,000		
N T N	154,300	223.00	34,408,900		

ジェイテクト	66,400	986.00	65,470,400	
不二越	6,000	3,930.00	23,580,000	
ミネベアミツミ	118,500	3,085.00	365,572,500	
日本トムソン	21,600	620.00	13,392,000	
T H K	40,000	2,577.00	103,080,000	
ユーシン精機	4,900	728.00	3,567,200	
前澤給装工業	5,100	1,015.00	5,176,500	
イーグル工業	8,500	1,051.00	8,933,500	
前澤工業	4,900	582.00	2,851,800	
日本ピラ - 工業	7,400	3,170.00	23,458,000	貸付株式数 2,600株
キッツ	26,500	684.00	18,126,000	貸付株式数 4,100株
日立	330,900	6,165.00	2,039,998,500	
東芝	120,200	4,545.00	546,309,000	
三菱電機	688,000	1,451.00	998,288,000	
富士電機	41,300	5,900.00	243,670,000	
東洋電機製造	3,200	1,014.00	3,244,800	
安川電機	74,000	5,560.00	411,440,000	
シンフォニア テクノロ ジー	8,300	1,243.00	10,316,900	貸付株式数 3,000株
明電舎	11,600	2,558.00	29,672,800	
オリジン	1,400	1,235.00	1,729,000	貸付株式数 200株
山洋電気	3,000	5,610.00	16,830,000	貸付株式数 400株
デンヨー	6,100	1,731.00	10,559,100	
ベイカレントコンサルティ ング	4,600	44,000.00	202,400,000	
ORCHESTRA HL DGS	1,200	3,395.00	4,074,000	貸付株式数 400株
アイモバイル	2,600	1,209.00	3,143,400	
キャリアインデックス	2,300	900.00	2,070,000	貸付株式数 400株
MS - J a p a n	3,000	936.00	2,808,000	貸付株式数 900株
船場	1,200	774.00	928,800	貸付株式数 400株
グレイステクノロジー	8,400	357.00	2,998,800	貸付株式数 3,300株
ジャパンエレベーターSH D	20,800	1,902.00	39,561,600	
フルテック	1,600	1,472.00	2,355,200	貸付株式数 300株
グリーンズ	2,800	528.00	1,478,400	貸付株式数 1,000株
ツナググループHL DGS	2,100	251.00	527,100	貸付株式数 600株
GAMEWITH	1,700	444.00	754,800	貸付株式数 100株
ソウルドアウト	1,500	1,201.00	1,801,500	貸付株式数 600株

MS&CONSULTING	800	707.00	565,600	貸付株式数	300株
ミダックホールディングス	2,800	3,740.00	10,472,000	貸付株式数	1,100株
日総工産	5,300	838.00	4,441,400	貸付株式数	1,100株
キュービーネットHLDGS	3,100	1,627.00	5,043,700		
RPAホールディングス	9,000	344.00	3,096,000	貸付株式数	3,600株
三桜工業	9,500	893.00	8,483,500	貸付株式数	3,700株 (100株)
マキタ	83,700	4,894.00	409,627,800	貸付株式数	3,000株
東芝テック	7,400	4,495.00	33,263,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	8,310.00	9,972,000		
マブチモーター	16,200	3,720.00	60,264,000	貸付株式数	6,200株
日本電産	178,300	13,275.00	2,366,932,500		
ユーエムシーエレクトロニクス	2,900	427.00	1,238,300	貸付株式数	1,100株
トレックス・セミコンダクター	3,400	3,115.00	10,591,000	貸付株式数	300株
東光高岳	4,000	1,343.00	5,372,000	貸付株式数	1,300株
ダブル・スコープ	19,600	752.00	14,739,200	貸付株式数	6,200株
宮越ホールディングス	2,700	979.00	2,643,300	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,500	4,440.00	33,300,000		
ヤーマン	11,500	926.00	10,649,000	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	857.00	5,313,400		
I-PEX	3,200	1,895.00	6,064,000	貸付株式数	500株
日新電機	16,000	1,479.00	23,664,000		
大崎電気	13,200	446.00	5,887,200	貸付株式数	1,900株
オムロン	57,000	11,440.00	652,080,000		
日東工業	9,500	1,568.00	14,896,000	貸付株式数	1,400株
IDEC	8,400	2,561.00	21,512,400	貸付株式数	1,000株
正興電機製作所	2,300	1,135.00	2,610,500	貸付株式数	800株
不二電機工業	1,000	1,159.00	1,159,000	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサコーポ	22,800	2,376.00	54,172,800		
サクサホールディングス	1,500	1,329.00	1,993,500		
メルコホールディングス	1,900	3,980.00	7,562,000	貸付株式数	700株
テクノメディカ	1,400	1,657.00	2,319,800	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリックHD	1,900	1,165.00	2,213,500	貸付株式数	700株
日本電気	87,500	5,150.00	450,625,000		

富士通	61,900	19,130.00	1,184,147,000	
沖電気	27,900	882.00	24,607,800	
岩崎通信機	2,500	836.00	2,090,000	
電気興業	3,500	2,419.00	8,466,500	
サンケン電気	7,500	5,890.00	44,175,000	
ナカヨ	1,100	1,188.00	1,306,800	
アイホン	3,800	2,073.00	7,877,400	貸付株式数 1,500株
ルネサスエレクトロニクス	372,800	1,354.00	504,771,200	
セイコーエプソン	85,300	1,974.00	168,382,200	
ワコム	53,100	910.00	48,321,000	貸付株式数 20,800株
アルバック	12,600	6,920.00	87,192,000	
アクセル	2,800	1,007.00	2,819,600	貸付株式数 1,100株
E I Z O	5,300	3,980.00	21,094,000	貸付株式数 700株
ジャパディスプレイ	61,700	36.00	2,221,200	
日本信号	18,000	900.00	16,200,000	
京三製作所	15,200	449.00	6,824,800	
能美防災	9,300	2,183.00	20,301,900	
ホーチキ	5,400	1,300.00	7,020,000	
星和電機	4,400	496.00	2,182,400	
エレコム	15,800	1,451.00	22,925,800	
パナソニック	734,100	1,222.00	897,070,200	
シャープ	78,500	1,228.00	96,398,000	貸付株式数 30,700株
アンリツ	44,200	1,740.00	76,908,000	貸付株式数 17,300株
富士通ゼネラル	18,700	2,678.00	50,078,600	
ソニーグループ	431,000	13,440.00	5,792,640,000	
T D K	99,700	4,415.00	440,175,500	
帝国通信工業	2,800	1,282.00	3,589,600	貸付株式数 1,000株
タムラ製作所	26,100	624.00	16,286,400	貸付株式数 10,300株
アルプスアルパイン	61,000	1,078.00	65,758,000	
池上通信機	2,000	682.00	1,364,000	貸付株式数 800株
日本電波工業	6,100	1,523.00	9,290,300	貸付株式数 2,400株
鈴木	2,900	843.00	2,444,700	貸付株式数 1,100株
日本トリム	1,300	3,230.00	4,199,000	貸付株式数 300株
ローランド ディー . ジー .	4,000	2,909.00	11,636,000	貸付株式数 1,000株
フオスタ - 電機	7,000	721.00	5,047,000	
S M K	1,600	2,183.00	3,492,800	貸付株式数 600株
ヨコオ	5,000	2,744.00	13,720,000	
ティアック	11,200	149.00	1,668,800	
ホシデン	16,400	1,156.00	18,958,400	貸付株式数 2,000株

ヒロセ電機	10,600	19,070.00	202,142,000	
日本航空電子	15,800	1,920.00	30,336,000	
T O A	7,400	782.00	5,786,800	貸付株式数 1,000株
マクセル	13,400	1,414.00	18,947,600	
古野電気	8,100	1,162.00	9,412,200	
ユニデンホールディングス	1,400	3,425.00	4,795,000	
スミダコーポレーション	6,400	1,170.00	7,488,000	
アイコム	2,500	2,358.00	5,895,000	貸付株式数 400株
リオン	2,600	2,268.00	5,896,800	貸付株式数 400株
本多通信工業	4,700	420.00	1,974,000	貸付株式数 1,800株
横河電機	68,900	2,033.00	140,073,700	
新電元工業	2,700	3,430.00	9,261,000	
アズビル	40,200	4,935.00	198,387,000	
東亜ディーケーケー	2,800	860.00	2,408,000	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	28,400	3,210.00	91,164,000	
チノー	1,900	1,574.00	2,990,600	貸付株式数 700株
共和電業	6,600	390.00	2,574,000	貸付株式数 1,900株
日本電子材料	3,300	2,470.00	8,151,000	貸付株式数 1,200株
堀場製作所	12,700	6,570.00	83,439,000	
アドバンテスト	51,100	10,200.00	521,220,000	
小野測器	2,300	486.00	1,117,800	
エスペック	5,400	2,104.00	11,361,600	貸付株式数 800株
キーエンス	62,300	71,580.00	4,459,434,000	
日置電機	3,300	8,620.00	28,446,000	貸付株式数 100株
シスメックス	58,200	14,775.00	859,905,000	
日本マイクロニクス	11,700	1,719.00	20,112,300	貸付株式数 3,400株
メガチップス	6,300	4,860.00	30,618,000	
O B A R A G R O U P	3,100	3,360.00	10,416,000	貸付株式数 1,400株
I M A G I C A G R O U P	5,600	583.00	3,264,800	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
澤藤電機	800	1,650.00	1,320,000	貸付株式数 300株
デンソー	151,500	9,031.00	1,368,196,500	
原田工業	2,900	983.00	2,850,700	貸付株式数 1,100株 (1,000株)
コーセル	8,200	833.00	6,830,600	
イリソ電子工業	5,800	4,280.00	24,824,000	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,300	1,560.00	17,628,000	
千代田インテグレ	2,800	2,012.00	5,633,600	
アイ・オー・データ	2,400	751.00	1,802,400	貸付株式数 900株
レーザーテック	30,200	30,230.00	912,946,000	

スタンレー電気	48,200	2,852.00	137,466,400	
岩崎電気	2,600	2,297.00	5,972,200	
ウシオ電機	35,200	1,892.00	66,598,400	
岡谷電機	4,600	318.00	1,462,800	貸付株式数 1,800株
ヘリオステクノH	6,200	268.00	1,661,600	貸付株式数 500株
エノモト	1,800	1,633.00	2,939,400	
日本セラミック	6,700	2,737.00	18,337,900	
遠藤照明	3,300	1,019.00	3,362,700	貸付株式数 500株
古河電池	4,900	1,358.00	6,654,200	貸付株式数 1,900株
双信電機	3,300	657.00	2,168,100	
山一電機	4,800	2,173.00	10,430,400	
図 研	4,600	3,560.00	16,376,000	貸付株式数 1,700株
日本電子	14,300	8,600.00	122,980,000	
カ シ オ	49,800	1,459.00	72,658,200	
ファナック	60,400	23,535.00	1,421,514,000	
日本シイエムケイ	13,000	638.00	8,294,000	貸付株式数 5,500株
エンプラス	1,700	2,518.00	4,280,600	貸付株式数 100株
大真空	10,000	1,393.00	13,930,000	貸付株式数 3,700株
ロ - ム	30,800	10,300.00	317,240,000	
浜松ホトニクス	49,400	7,140.00	352,716,000	
三井ハイテック	6,700	10,310.00	69,077,000	
新光電気工業	20,100	5,150.00	103,515,000	貸付株式数 100株
京 セ ラ	96,900	7,105.00	688,474,500	
協栄産業	500	1,464.00	732,000	
太陽誘電	33,400	6,300.00	210,420,000	
村田製作所	202,200	9,102.00	1,840,424,400	
双葉電子工業	11,500	681.00	7,831,500	
日東電工	41,400	8,530.00	353,142,000	
北陸電気工業	2,300	1,340.00	3,082,000	
東海理化電機	18,200	1,500.00	27,300,000	貸付株式数 500株
ニチコン	21,800	1,211.00	26,399,800	
日本ケミコン	6,400	1,694.00	10,841,600	貸付株式数 700株
K O A	10,200	1,529.00	15,595,800	
三井E & S H D	21,700	365.00	7,920,500	
日立造船	57,600	741.00	42,681,600	
三菱重工業	108,000	2,587.00	279,396,000	
川崎重工業	50,100	1,991.00	99,749,100	
I H I	42,900	2,171.00	93,135,900	
名村造船所	21,900	210.00	4,599,000	貸付株式数 8,100株
サノヤホールディングス	9,800	121.00	1,185,800	貸付株式数 3,000株

スプリックス	1,900	1,748.00	3,321,200	
マネジメントソリューションズ	3,400	2,901.00	9,863,400	貸付株式数 1,200株
プロレド・パートナーズ	1,700	982.00	1,669,400	貸付株式数 500株
AND FACTORY	1,200	370.00	444,000	貸付株式数 400株
ギークス	1,200	1,700.00	2,040,000	
カーブスホールディングス	18,200	763.00	13,886,600	貸付株式数 6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,500	806.00	3,627,000	
日本車輛	2,400	2,018.00	4,843,200	
三菱ロジスネクスト	9,100	1,140.00	10,374,000	貸付株式数 1,400株
近畿車輛	600	990.00	594,000	貸付株式数 200株
一家ホールディングス	1,500	520.00	780,000	
フルサト・マルカHD	6,300	2,155.00	13,576,500	貸付株式数 2,500株
ヤマエグループHD	4,500	1,016.00	4,572,000	貸付株式数 1,700株
F P G	22,700	556.00	12,621,200	貸付株式数 2,900株
島根銀行	2,200	545.00	1,199,000	貸付株式数 300株
じもとホールディングス	5,000	633.00	3,165,000	
全国保証	16,100	4,880.00	78,568,000	貸付株式数 6,400株
めぶきフィナンシャルG	351,900	230.00	80,937,000	
東京きらぼしFG	8,800	1,466.00	12,900,800	
九州フィナンシャルG	138,800	407.00	56,491,600	
かんぼ生命保険	68,300	1,784.00	121,847,200	
ゆうちょ銀行	161,000	1,007.00	162,127,000	貸付株式数 62,600株
富山第一銀行	16,100	282.00	4,540,200	
コンコルディア・フィナンシャル	388,400	415.00	161,186,000	
ジェイリース	2,500	1,857.00	4,642,500	貸付株式数 800株
西日本フィナンシャルHD	44,100	720.00	31,752,000	
イントラスト	3,100	690.00	2,139,000	貸付株式数 900株
日本モーゲージサービス	3,900	1,065.00	4,153,500	貸付株式数 1,400株
C a s a	2,600	890.00	2,314,000	貸付株式数 900株
アルヒ	10,100	1,006.00	10,160,600	貸付株式数 3,900株
プレミアグループ	3,400	3,490.00	11,866,000	
日産自動車	811,600	548.10	444,837,960	
いすゞ自動車	215,800	1,432.00	309,025,600	
トヨタ自動車	3,485,200	2,051.00	7,148,145,200	
日野自動車	85,800	923.00	79,193,400	
三菱自動車工業	253,700	315.00	79,915,500	
エフテック	5,300	495.00	2,623,500	



レシップホールディングス	2,900	579.00	1,679,100	
G M B	1,600	737.00	1,179,200	
ファルテック	1,000	694.00	694,000	
武蔵精密工業	15,400	1,704.00	26,241,600	
日産車体	10,000	684.00	6,840,000	貸付株式数 3,700株
新明和工業	19,500	857.00	16,711,500	
極東開発工業	12,400	1,518.00	18,823,200	
トピー工業	5,400	1,068.00	5,767,200	
ティラド	2,000	2,557.00	5,114,000	貸付株式数 300株
タチエス	11,900	1,146.00	13,637,400	貸付株式数 3,900株
N O K	33,300	1,185.00	39,460,500	
フタバ産業	16,900	405.00	6,844,500	
K Y B	7,100	2,940.00	20,874,000	貸付株式数 800株
市光工業	9,800	492.00	4,821,600	
大同メタル工業	12,200	582.00	7,100,400	貸付株式数 5,200株
プレス工業	33,300	379.00	12,620,700	
ミクニ	9,000	334.00	3,006,000	貸付株式数 3,600株
太平洋工業	14,200	1,120.00	15,904,000	
河西工業	7,400	275.00	2,035,000	貸付株式数 1,200株
アイシン	50,400	4,275.00	215,460,000	
マ ッ ダ	215,800	877.00	189,256,600	
今仙電機製作所	4,100	575.00	2,357,500	貸付株式数 2,000株
本田技研	542,000	3,086.00	1,672,612,000	
スズキ	157,400	4,319.00	679,810,600	
S U B A R U	197,300	2,010.50	396,671,650	
安永	3,200	932.00	2,982,400	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	89,800	2,700.00	242,460,000	
小糸製作所	37,800	5,940.00	224,532,000	貸付株式数 2,200株
T B K	6,900	400.00	2,760,000	貸付株式数 900株
エクセディ	10,200	1,658.00	16,911,600	
ミツバ	12,700	429.00	5,448,300	
豊田合成	22,300	2,341.00	52,204,300	
愛三工業	10,600	752.00	7,971,200	
盟和産業	400	975.00	390,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	4,700	503.00	2,364,100	貸付株式数 600株
ヨ ロ ズ	6,300	1,088.00	6,854,400	貸付株式数 2,400株
エフ・シー・シー	11,300	1,439.00	16,260,700	貸付株式数 400株
新家工業	1,600	1,603.00	2,564,800	
シマノ	27,700	32,030.00	887,231,000	
テイ・エス テック	29,100	1,333.00	38,790,300	貸付株式数 1,900株

33FG	6,000	1,452.00	8,712,000		
第四北越フィナンシャルG	11,000	2,448.00	26,928,000		
ひろぎんHLDGS	100,300	659.00	66,097,700	貸付株式数	600株
マーキュリアホールディングス	2,200	584.00	1,284,800	貸付株式数	800株 (500株)
おきなわFG	5,900	2,181.00	12,867,900		
LITALICO	5,600	3,865.00	21,644,000		
十六FG	8,900	2,116.00	18,832,400		
北國FHD	6,200	2,436.00	15,103,200		
ジャムコ	3,800	852.00	3,237,600	貸付株式数	1,500株
小野建	6,200	1,630.00	10,106,000		
はるやまHLDGS	3,100	472.00	1,463,200	貸付株式数	1,200株
南陽	1,200	1,880.00	2,256,000		
ノジマ	10,900	2,311.00	25,189,900	貸付株式数	700株
佐島電機	4,000	939.00	3,756,000		
カッパ・クリエイト	9,300	1,326.00	12,331,800	貸付株式数	3,700株
エコートレーディング	1,300	623.00	809,900	貸付株式数	500株
伯東	4,400	2,346.00	10,322,400		
コンドーテック	5,300	934.00	4,950,200		
中山福	3,300	352.00	1,161,600	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,000	721.00	3,605,000	貸付株式数	1,800株
ナガイレーベン	8,900	2,224.00	19,793,600	貸付株式数	3,400株
三菱食品	6,500	2,730.00	17,745,000	貸付株式数	1,400株
良品計画	77,900	1,750.00	136,325,000		
三城ホールディングス	7,900	218.00	1,722,200	貸付株式数	3,100株
松田産業	5,200	2,360.00	12,272,000		
第一興商	12,900	3,450.00	44,505,000	貸付株式数	5,000株
メディパルHD	73,100	2,119.00	154,898,900		
アドヴァングループ	6,900	953.00	6,575,700	貸付株式数	400株
SPK	2,500	1,368.00	3,420,000	貸付株式数	600株
萩原電気HLDGS	2,400	2,005.00	4,812,000		
アルピス	2,100	2,150.00	4,515,000	貸付株式数	800株
アズワン	4,900	14,370.00	70,413,000		
スズデン	2,200	1,735.00	3,817,000		
尾家産業	1,800	1,017.00	1,830,600	貸付株式数	400株
シモジマ	4,200	1,136.00	4,771,200	貸付株式数	1,600株
ドウシヤ	7,100	1,542.00	10,948,200	貸付株式数	200株
小津産業	1,200	1,919.00	2,302,800		
コナカ	7,800	318.00	2,480,400		
高速	3,900	1,562.00	6,091,800		

ハウス ローゼ	800	1,650.00	1,320,000	貸付株式数	300株
G - 7ホールディングス	7,800	1,585.00	12,363,000		
たけびし	3,000	1,430.00	4,290,000		
イオン北海道	11,800	1,310.00	15,458,000	貸付株式数	4,600株
コジマ	12,300	528.00	6,494,400	貸付株式数	4,500株
ヒマラヤ	2,200	945.00	2,079,000		
コーナン商事	9,600	3,275.00	31,440,000	貸付株式数	3,700株
ネットワンシステムズ	25,700	3,205.00	82,368,500	貸付株式数	2,700株
エコス	2,500	1,841.00	4,602,500	貸付株式数	900株
ワタミ	8,200	871.00	7,142,200	貸付株式数	3,400株
マルシェ	1,500	406.00	609,000	貸付株式数	600株
リックス	3,400	1,491.00	5,069,400	貸付株式数	600株
システムソフト	18,400	112.00	2,060,800	貸付株式数	2,700株
パンパシフィックHD	135,500	1,606.00	217,613,000		
丸文	5,600	775.00	4,340,000		
西松屋チェーン	14,900	1,335.00	19,891,500	貸付株式数	5,800株
ゼンショーホールディングス	33,000	2,647.00	87,351,000	貸付株式数	300株
ハピネット	6,000	1,459.00	8,754,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,410.00	5,922,000	貸付株式数	1,600株
ハークスレイ	3,200	471.00	1,507,200	貸付株式数	600株
橋本総業HLDGS	1,400	2,010.00	2,814,000	貸付株式数	500株
日本ライフライン	19,600	1,043.00	20,442,800	貸付株式数	1,100株
サイゼリヤ	10,200	2,958.00	30,171,600	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,100	724.00	3,692,400	貸付株式数	2,000株
V Tホールディングス	25,200	446.00	11,239,200	貸付株式数	9,500株
アルゴグラフィックス	5,300	3,030.00	16,059,000		
魚力	1,900	2,001.00	3,801,900	貸付株式数	700株
IDOM	20,200	681.00	13,756,200	貸付株式数	3,300株
日本エム・ディ・エム	3,900	1,804.00	7,035,600		
ポプラ	1,800	143.00	257,400	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	3,600	1,125.00	4,050,000		
ユナイテッドアローズ	7,000	1,795.00	12,565,000	貸付株式数	2,100株
進和	3,700	2,037.00	7,536,900	貸付株式数	1,500株
エスケイジャパン	2,600	420.00	1,092,000	貸付株式数	600株
ダイترون	2,700	2,049.00	5,532,300		
ハイデイ日高	9,600	1,610.00	15,456,000	貸付株式数	3,800株
シークス	9,600	1,341.00	12,873,600	貸付株式数	3,700株
YU - WA C R E A T I O N H	3,600	206.00	741,600	貸付株式数	400株

コロワイド	27,700	1,572.00	43,544,400	貸付株式数 10,900株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	7,900	291.00	2,298,900	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	1,340.00	4,690,000	
壱番屋	4,800	4,505.00	21,624,000	貸付株式数 1,800株
白銅	2,000	2,767.00	5,534,000	貸付株式数 500株
トップカルチャー	2,500	294.00	735,000	貸付株式数 1,000株
P L A N T	1,600	696.00	1,113,600	貸付株式数 600株
スギホールディングス	13,500	6,830.00	92,205,000	貸付株式数 5,200株
ダイコー通産	800	1,194.00	955,200	貸付株式数 300株
薬王堂ホールディングス	3,300	2,170.00	7,161,000	貸付株式数 1,300株
島津製作所	88,500	4,815.00	426,127,500	
J M S	5,900	593.00	3,498,700	貸付株式数 2,100株
クボテック	1,000	254.00	254,000	貸付株式数 600株
長野計器	5,100	1,498.00	7,639,800	
ブイ・テクノロジー	2,900	3,335.00	9,671,500	貸付株式数 1,000株
スター精密	10,400	1,568.00	16,307,200	
東京計器	4,100	970.00	3,977,000	貸付株式数 1,600株
愛知時計	1,000	4,570.00	4,570,000	
インターアクション	3,400	2,341.00	7,959,400	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
オーバル	6,600	237.00	1,564,200	貸付株式数 200株
東京精密	11,600	4,720.00	54,752,000	
マニー	27,500	1,545.00	42,487,500	貸付株式数 10,500株
ニコン	104,900	1,174.00	123,152,600	
トプコン	32,200	1,602.00	51,584,400	貸付株式数 3,300株
オリンパス	360,900	2,449.00	883,844,100	
理研計器	5,500	5,470.00	30,085,000	貸付株式数 700株
S C R E E Nホールディングス	11,900	11,420.00	135,898,000	
キヤノン電子	6,200	1,580.00	9,796,000	
タムロン	5,600	2,740.00	15,344,000	
H O Y A	134,200	16,550.00	2,221,010,000	
シード	2,900	533.00	1,545,700	貸付株式数 1,100株
ノーリツ鋼機	6,200	2,498.00	15,487,600	
エー・アンド・デイ	6,100	1,120.00	6,832,000	
朝日インテック	75,400	2,501.00	188,575,400	
キヤノン	341,900	2,785.00	952,191,500	
リコー	190,800	1,026.00	195,760,800	

シチズン時計	79,600	485.00	38,606,000		
リズム	2,000	1,173.00	2,346,000	貸付株式数	800株
大研医器	5,000	533.00	2,665,000	貸付株式数	2,000株
メニコン	22,700	3,470.00	78,769,000	貸付株式数	5,200株
シンシア	800	587.00	469,600	貸付株式数	200株
中本パックス	1,800	1,625.00	2,925,000	貸付株式数	700株
スノーピーク	9,000	3,500.00	31,500,000	貸付株式数	400株
パラマウントベッドHD	13,100	1,895.00	24,824,500		
トランザクション	4,500	982.00	4,419,000	貸付株式数	1,400株
粧美堂	1,900	393.00	746,700	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	5,800	1,013.00	5,875,400	貸付株式数	1,300株
前田工織	7,600	3,695.00	28,082,000	貸付株式数	2,000株
永大産業	8,800	279.00	2,455,200	貸付株式数	400株
アートネイチャー	6,000	700.00	4,200,000	貸付株式数	1,100株
バンダイナムコHLDGS	61,600	8,936.00	550,457,600		
アイフィスジャパン	1,800	670.00	1,206,000	貸付株式数	700株
共立印刷	9,700	136.00	1,319,200	貸付株式数	3,800株
SHOEI	6,500	4,540.00	29,510,000		
フランスベッドHLDGS	9,800	914.00	8,957,200	貸付株式数	3,400株
マーベラス	10,400	707.00	7,352,800		
パイロットコーポレーション	11,600	4,150.00	48,140,000	貸付株式数	4,500株
萩原工業	4,300	1,237.00	5,319,100	貸付株式数	1,700株
エイベックス	11,700	1,550.00	18,135,000	貸付株式数	4,500株
トッパン・フォームズ	9,300	1,547.00	14,387,100	貸付株式数	3,700株
フジシールインターナショナル	16,600	2,043.00	33,913,800	貸付株式数	4,700株
タカラトミー	28,300	1,076.00	30,450,800	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,200	757.00	3,179,400	貸付株式数	1,600株
エステールホールディングス	1,300	639.00	830,700	貸付株式数	700株
レック	8,800	818.00	7,198,400		
タカノ	2,100	663.00	1,392,300	貸付株式数	800株
三光合成	8,500	364.00	3,094,000	貸付株式数	300株
プロネクサス	5,300	1,057.00	5,602,100		
ホクシン	6,900	150.00	1,035,000		
ウッドワン	2,000	981.00	1,962,000	貸付株式数	200株
大建工業	4,000	2,132.00	8,528,000	貸付株式数	800株
きもと	12,700	213.00	2,705,100		
凸版印刷	104,800	2,001.00	209,704,800		

大日本印刷	81,500	2,728.00	222,332,000	
共同印刷	2,100	3,125.00	6,562,500	
N I S S H A	14,100	1,612.00	22,729,200	
光村印刷	600	1,438.00	862,800	貸付株式数 200株
藤森工業	6,100	3,810.00	23,241,000	
ヴィア・ホールディングス	8,500	150.00	1,275,000	貸付株式数 3,300株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,755.00	5,791,500	貸付株式数 1,200株
前澤化成工業	4,500	1,285.00	5,782,500	貸付株式数 1,700株
未来工業	2,500	1,583.00	3,957,500	
アシックス	60,800	2,452.00	149,081,600	
ツ ツ ミ	1,700	1,905.00	3,238,500	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	2,300	731.00	1,681,300	貸付株式数 900株
ジェイ エス ピー	3,800	1,583.00	6,015,400	貸付株式数 1,400株
ニ チ ハ	9,500	2,912.00	27,664,000	
エフピコ	12,600	3,865.00	48,699,000	
小松ウオール工業	2,000	1,900.00	3,800,000	
ヤマハ	41,000	5,650.00	231,650,000	
河合楽器	1,900	3,420.00	6,498,000	
クリナップ	6,300	529.00	3,332,700	
ビジョン	41,600	2,345.00	97,552,000	貸付株式数 16,200株
天馬	6,300	2,561.00	16,134,300	
兼松サステック	500	1,791.00	895,500	
キングジム	5,700	880.00	5,016,000	
象印マホービン	18,500	1,577.00	29,174,500	
リンテック	16,500	2,610.00	43,065,000	
信越ポリマー	12,100	1,084.00	13,116,400	
東 リ	16,500	220.00	3,630,000	
イトーキ	12,900	357.00	4,605,300	
任 天 堂	38,800	53,510.00	2,076,188,000	
三菱鉛筆	11,200	1,208.00	13,529,600	
松 風	2,700	1,981.00	5,348,700	貸付株式数 1,200株
タカラスタンダ-ド	14,000	1,410.00	19,740,000	貸付株式数 200株
コ ク ヨ	32,700	1,698.00	55,524,600	
ナカバヤシ	5,800	489.00	2,836,200	貸付株式数 600株
ニ フ コ	23,100	3,380.00	78,078,000	
立川ブラインド	3,200	1,122.00	3,590,400	貸付株式数 1,100株
グローブライド	6,000	3,245.00	19,470,000	貸付株式数 700株
オカムラ	23,600	1,280.00	30,208,000	
バルカー	7,200	2,479.00	17,848,800	

MUTOHホールディングス	900	1,660.00	1,494,000	
伊藤忠	473,600	3,417.00	1,618,291,200	
丸紅	668,300	1,053.50	704,054,050	
スクロール	10,200	756.00	7,711,200	
高島	1,000	2,169.00	2,169,000	貸付株式数 100株
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,670.00	10,354,000	貸付株式数 2,400株
三陽商会	3,200	886.00	2,835,200	貸付株式数 900株
長瀬産業	37,300	1,796.00	66,990,800	
ナイガイ	2,700	306.00	826,200	貸付株式数 900株
蝶理	3,700	1,713.00	6,338,100	貸付株式数 800株
豊田通商	68,000	5,050.00	343,400,000	
オンワードホールディングス	41,800	282.00	11,787,600	貸付株式数 15,800株
三共生興	8,500	551.00	4,683,500	貸付株式数 1,900株
兼松	25,900	1,251.00	32,400,900	貸付株式数 900株
美津濃	6,800	2,173.00	14,776,400	
ツカモトコーポレーション	1,100	1,293.00	1,422,300	貸付株式数 400株
ルックホールディングス	2,100	1,233.00	2,589,300	貸付株式数 800株
三井物産	525,800	2,599.00	1,366,554,200	
日本紙パルプ	3,600	3,855.00	13,878,000	
東京エレクトロン	43,700	59,600.00	2,604,520,000	
カメイ	7,900	996.00	7,868,400	貸付株式数 1,100株
東都水産	400	4,010.00	1,604,000	
OUGホールディングス	1,000	2,653.00	2,653,000	貸付株式数 400株
スターゼン	5,000	1,924.00	9,620,000	
セイコーHD	9,700	2,212.00	21,456,400	
山善	29,200	1,027.00	29,988,400	貸付株式数 1,900株
椿本興業	1,500	4,260.00	6,390,000	
住友商事	427,100	1,628.50	695,532,350	
日本ユニシス	21,100	3,220.00	67,942,000	貸付株式数 1,600株
内田洋行	2,900	5,150.00	14,935,000	
三菱商事	507,400	3,594.00	1,823,595,600	
第一実業	3,300	4,830.00	15,939,000	
キヤノンマーケティングJPN	16,900	2,264.00	38,261,600	
西華産業	3,300	1,615.00	5,329,500	
佐藤商事	5,600	1,111.00	6,221,600	
菱洋エレクトロ	3,900	2,300.00	8,970,000	貸付株式数 1,500株

東京産業	6,600	746.00	4,923,600	貸付株式数	2,000株
ユアサ商事	6,600	2,850.00	18,810,000	貸付株式数	700株
神鋼商事	1,700	3,250.00	5,525,000		
トルク	9,200	198.00	1,821,600	貸付株式数	3,000株
阪和興業	13,500	3,045.00	41,107,500		
正栄食品	4,300	3,810.00	16,383,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	6,900	1,017.00	7,017,300	貸付株式数	2,100株
菱電商事	6,300	1,756.00	11,062,800	貸付株式数	2,100株
ニプロ	51,100	1,079.00	55,136,900		
岩谷産業	16,100	5,730.00	92,253,000		
ナイス	2,500	1,647.00	4,117,500		
ニチモウ	1,000	2,315.00	2,315,000	貸付株式数	100株
極東貿易	2,100	2,414.00	5,069,400	貸付株式数	700株
アステナホールディングス	10,800	474.00	5,119,200		
兼松エレクトロニクス	3,700	3,855.00	14,263,500		
三愛石油	16,600	1,267.00	21,032,200		
稲畑産業	15,600	1,611.00	25,131,600	貸付株式数	2,000株
G S Iクレオス	3,200	1,102.00	3,526,400	貸付株式数	1,200株
明和産業	6,400	845.00	5,408,000	貸付株式数	2,400株
クワザワホールディングス	2,700	585.00	1,579,500	貸付株式数	1,000株
ゴ - ルドウィン	12,100	6,370.00	77,077,000		
ユニ・チャ - ム	132,600	4,870.00	645,762,000		
デサント	13,100	3,925.00	51,417,500		
キ ン グ	3,200	549.00	1,756,800	貸付株式数	100株
ワ キ タ	14,100	1,031.00	14,537,100		
ヤマトインタ - ナショナル	5,800	290.00	1,682,000	貸付株式数	2,200株
東邦ホールディングス	21,700	1,747.00	37,909,900	貸付株式数	8,300株
サンゲツ	17,700	1,564.00	27,682,800		
ミツウロコグループ	9,900	1,192.00	11,800,800		
シナネンホールディングス	2,500	3,460.00	8,650,000	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,900	967.00	14,408,300		
サンリオ	20,700	2,387.00	49,410,900	貸付株式数	500株
サンワ テクノス	3,900	1,560.00	6,084,000	貸付株式数	500株
リョーサン	7,300	2,083.00	15,205,900		
新光商事	9,900	898.00	8,890,200	貸付株式数	3,600株
トーホー	3,100	1,258.00	3,899,800	貸付株式数	1,200株
三信電気	3,100	1,401.00	4,343,100		
東陽テクニカ	6,900	1,075.00	7,417,500		
モスフード サービス	8,700	3,040.00	26,448,000	貸付株式数	3,400株
加賀電子	6,200	2,999.00	18,593,800		



三益半導体	5,200	2,382.00	12,386,400		
ソーダニツカ	6,400	750.00	4,800,000		
立花エレテック	5,200	1,562.00	8,122,400	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,700	2,160.00	18,792,000	貸付株式数	3,400株
S R S ホールディングス	9,100	768.00	6,988,800	貸付株式数	3,600株
千 趣 会	11,900	401.00	4,771,900	貸付株式数	4,700株
タカキュー	7,300	119.00	868,700	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	8,100	1,326.00	10,740,600	貸付株式数	3,200株
ケーヨー	12,300	820.00	10,086,000	貸付株式数	4,900株
上新電機	7,800	2,095.00	16,341,000		
日本瓦斯	32,800	1,516.00	49,724,800		
ロイヤルホールディングス	11,600	1,858.00	21,552,800	貸付株式数	4,500株
東 天 紅	500	985.00	492,500		
いなげや	8,400	1,360.00	11,424,000	貸付株式数	3,200株
チヨダ	6,400	742.00	4,748,800	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	6,300	3,425.00	21,577,500		
リンガーハット	8,200	2,177.00	17,851,400	貸付株式数	3,200株
M r M a x H D	8,300	561.00	4,656,300	貸付株式数	3,500株
テンアライド	6,600	306.00	2,019,600	貸付株式数	2,600株
A O K I ホールディングス	13,300	598.00	7,953,400	貸付株式数	2,500株
オークワ	10,500	964.00	10,122,000	貸付株式数	4,000株
コメリ	10,400	2,523.00	26,239,200		
青山商事	13,700	642.00	8,795,400	貸付株式数	2,900株
しまむら	7,900	9,570.00	75,603,000		
はせがわ	3,400	249.00	846,600	貸付株式数	600株
高 島 屋	49,200	1,021.00	50,233,200		
松 屋	13,400	800.00	10,720,000	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,500	796.00	25,870,000	貸付株式数	12,400株
近鉄百貨店	2,600	2,505.00	6,513,000	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	57,200	2,105.00	120,406,000		
クレディセゾン	43,200	1,133.00	48,945,600		
アクシアル リテイリング	5,200	3,290.00	17,108,000	貸付株式数	2,100株
井 筒 屋	3,100	413.00	1,280,300	貸付株式数	1,200株
イオン	260,900	2,694.00	702,864,600		
イ ズ ミ	12,200	3,230.00	39,406,000	貸付株式数	4,700株
フォーバル	3,000	1,027.00	3,081,000		
平 和 堂	12,500	1,929.00	24,112,500	貸付株式数	5,200株
フ ジ	8,100	1,902.00	15,406,200	貸付株式数	3,200株
ヤオコー	7,700	6,940.00	53,438,000	貸付株式数	3,000株

ゼビオホールディングス	9,000	881.00	7,929,000	貸付株式数	2,900株
ケーズホールディングス	62,400	1,097.00	68,452,800		
PALTA C	9,500	4,610.00	43,795,000	貸付株式数	2,000株
三谷産業	9,400	304.00	2,857,600	貸付株式数	3,100株
OLYMPICグループ	3,400	618.00	2,101,200	貸付株式数	700株
日産東京販売HD	8,900	224.00	1,993,600		
あおぞら銀行	37,700	2,516.00	94,853,200		
三菱UFJフィナンシャルG	4,353,900	617.40	2,688,097,860		
りそなホールディングス	775,800	436.50	338,636,700		
三井住友トラストHD	128,200	3,803.00	487,544,600		
三井住友フィナンシャルG	470,100	3,812.00	1,792,021,200		
千葉銀行	226,900	661.00	149,980,900		
群馬銀行	129,700	341.00	44,227,700	貸付株式数	13,600株
武蔵野銀行	9,900	1,676.00	16,592,400	貸付株式数	3,000株
千葉興業銀行	15,800	251.00	3,965,800	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	26,200	166.00	4,349,200	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	21,300	1,270.00	27,051,000	貸付株式数	4,500株
青森銀行	5,100	1,715.00	8,746,500		
秋田銀行	4,200	1,580.00	6,636,000		
山形銀行	7,400	846.00	6,260,400		
岩手銀行	4,400	1,782.00	7,840,800		
東邦銀行	54,800	208.00	11,398,400	貸付株式数	22,600株
東北銀行	3,100	1,000.00	3,100,000		
みちのく銀行	4,500	790.00	3,555,000		
ふくおかフィナンシャルG	57,300	1,902.00	108,984,600		
静岡銀行	165,600	826.00	136,785,600		
スルガ銀行	63,000	494.00	31,122,000		
八十二銀行	153,400	372.00	57,064,800		
山梨中央銀行	7,200	833.00	5,997,600	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	13,400	1,874.00	25,111,600	貸付株式数	2,600株
福井銀行	5,900	1,367.00	8,065,300		
清水銀行	2,800	1,547.00	4,331,600		
富山銀行	1,200	1,773.00	2,127,600	貸付株式数	400株 (300株)
滋賀銀行	12,800	1,971.00	25,228,800	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,600	1,881.00	19,938,600	貸付株式数	400株
百五銀行	65,000	339.00	22,035,000		
京都銀行	24,300	4,875.00	118,462,500		

紀陽銀行	24,100	1,405.00	33,860,500	
ほくほくフィナンシャルG	42,300	794.00	33,586,200	貸付株式数 4,100株
山陰合同銀行	39,800	624.00	24,835,200	貸付株式数 3,600株
中国銀行	54,100	884.00	47,824,400	貸付株式数 6,100株
鳥取銀行	2,000	1,130.00	2,260,000	
伊予銀行	90,400	565.00	51,076,000	貸付株式数 10,800株
百十四銀行	6,900	1,441.00	9,942,900	
四国銀行	9,900	742.00	7,345,800	貸付株式数 2,700株
阿波銀行	10,400	2,123.00	22,079,200	
大分銀行	3,900	1,743.00	6,797,700	
宮崎銀行	4,100	2,037.00	8,351,700	
佐賀銀行	3,700	1,432.00	5,298,400	貸付株式数 200株
琉球銀行	14,600	752.00	10,979,200	
セブン銀行	200,500	235.00	47,117,500	貸付株式数 88,100株
みずほフィナンシャルG	868,700	1,442.00	1,252,665,400	
高知銀行	2,500	730.00	1,825,000	
山口フィナンシャルG	79,300	633.00	50,196,900	
芙蓉総合リース	7,100	7,770.00	55,167,000	
みずほリース	10,500	3,055.00	32,077,500	貸付株式数 4,000株
東京センチュリー	13,100	5,360.00	70,216,000	
SBIホールディングス	83,600	2,897.00	242,189,200	
日本証券金融	26,300	828.00	21,776,400	
アイフル	113,800	339.00	38,578,200	
日本アジア投資	5,900	190.00	1,121,000	貸付株式数 500株
長野銀行	2,200	1,185.00	2,607,000	貸付株式数 700株
名古屋銀行	5,000	2,670.00	13,350,000	貸付株式数 600株
北洋銀行	101,200	245.00	24,794,000	
愛知銀行	2,400	3,705.00	8,892,000	
中京銀行	2,600	1,492.00	3,879,200	
大光銀行	2,300	1,276.00	2,934,800	貸付株式数 900株
愛媛銀行	9,400	784.00	7,369,600	貸付株式数 3,700株
トマト銀行	2,300	1,064.00	2,447,200	貸付株式数 300株
京葉銀行	28,100	442.00	12,420,200	貸付株式数 10,000株
栃木銀行	31,700	184.00	5,832,800	
北日本銀行	2,100	1,523.00	3,198,300	貸付株式数 700株
東和銀行	12,200	516.00	6,295,200	
福島銀行	7,700	221.00	1,701,700	
大東銀行	3,100	739.00	2,290,900	
リコーリース	6,000	3,730.00	22,380,000	貸付株式数 2,300株

イオンフィナンシャルサー ビス	36,800	1,214.00	44,675,200	貸付株式数	3,800株
アコム	133,700	327.00	43,719,900		
ジャックス	7,700	2,840.00	21,868,000		
オリコ	181,600	119.00	21,610,400		
オリックス	412,100	2,239.50	922,897,950	貸付株式数	161,200株
三菱HCキャピタル	250,500	552.00	138,276,000		
ジャフコグループ	8,700	6,350.00	55,245,000		
九州リースサービス	3,300	571.00	1,884,300	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	51,200	300.00	15,360,000		
大和証券G本社	497,100	636.00	316,155,600		
野村ホールディングス	1,036,000	488.30	505,878,800		
岡三証券グループ	52,600	376.00	19,777,600	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	76,400	389.00	29,719,600	貸付株式数	500株
光世証券	1,400	493.00	690,200	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	266.00	4,734,800	貸付株式数	5,000株
いちよし証券	12,400	634.00	7,861,600	貸付株式数	5,200株
松井証券	33,000	777.00	25,641,000		
SOMPPOホールディング ス	119,600	4,937.00	590,465,200		
日本取引所グループ	171,800	2,415.00	414,897,000		
マネックスG	54,800	689.00	37,757,200		
極東証券	8,900	727.00	6,470,300	貸付株式数	1,700株
岩井コスモホールディング	6,300	1,310.00	8,253,000	貸付株式数	800株
アイザワ証券グループ	11,000	1,036.00	11,396,000	貸付株式数	4,000株
フィデアホール	5,900	1,245.00	7,345,500	貸付株式数	400株
池田泉州HD	74,900	159.00	11,909,100		
アニコムホールディング ス	20,500	761.00	15,600,500		
MS&AD	152,400	3,500.00	533,400,000		
マネーパートナーズGP	9,100	215.00	1,956,500	貸付株式数	2,900株
スパークス・グループ	31,600	302.00	9,543,200	貸付株式数	12,100株
小林洋行	2,300	238.00	547,400		
第一生命HLDGS	334,000	2,337.00	780,558,000		
東京海上HD	223,600	6,242.00	1,395,711,200		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	732.00	2,415,600	貸付株式数	300株
イー・ギャランティ	9,800	2,342.00	22,951,600		
アサックス	4,200	701.00	2,944,200	貸付株式数	1,300株

NECキャピタルソリューション	3,000	1,966.00	5,898,000	貸付株式数	1,000株
T&Dホールディングス	175,800	1,425.00	250,515,000		
アドバンスクリエイト	3,200	1,075.00	3,440,000	貸付株式数	1,200株
三井不動産	309,600	2,211.50	684,680,400		
三菱地所	446,700	1,563.00	698,192,100		
平和不動産	11,600	3,630.00	42,108,000		
東京建物	67,000	1,611.00	107,937,000		
ダイビル	16,900	2,218.00	37,484,200	貸付株式数	400株
京阪神ビルディング	10,500	1,494.00	15,687,000		
住友不動産	142,600	3,283.00	468,155,800		
太平洋興発	2,200	599.00	1,317,800	貸付株式数	200株
テーオーシー	12,500	639.00	7,987,500	貸付株式数	3,300株
東京楽天地	1,100	3,995.00	4,394,500	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	9,200	2,393.00	22,015,600		
フジ住宅	7,700	657.00	5,058,900		
空港施設	7,200	538.00	3,873,600		
明和地所	3,400	564.00	1,917,600	貸付株式数	500株
ゴールドクレスト	5,300	1,558.00	8,257,400	貸付株式数	2,300株
リログループ	36,000	2,054.00	73,944,000	貸付株式数	9,100株
エスリード	2,500	1,630.00	4,075,000	貸付株式数	1,000株
日神グループHLDGS	10,500	477.00	5,008,500	貸付株式数	4,100株
日本エスコ	13,100	785.00	10,283,500		
タカラレーベン	29,300	277.00	8,116,100	貸付株式数	11,200株
AVANTIA	3,400	851.00	2,893,400	貸付株式数	600株
イオンモール	34,300	1,591.00	54,571,300	貸付株式数	13,200株
毎日コムネット	2,700	726.00	1,960,200		
ファースト住建	2,900	1,221.00	3,540,900	貸付株式数	100株
ランド	371,200	11.00	4,083,200	貸付株式数	144,600株
カチタス	16,800	4,080.00	68,544,000		
東祥	4,900	1,589.00	7,786,100	貸付株式数	1,500株
トーセイ	9,300	977.00	9,086,100	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,400	1,866.00	2,612,400	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	9,000	945.00	8,505,000		
インテリックス	1,000	615.00	615,000		
ランドビジネス	2,800	259.00	725,200		
サンネクスタグループ	2,300	1,062.00	2,442,600	貸付株式数	800株
グランディハウス	5,200	470.00	2,444,000	貸付株式数	1,800株
東武鉄道	67,200	2,633.00	176,937,600		
相鉄ホールディングス	22,000	2,062.00	45,364,000	貸付株式数	2,600株

東急	173,600	1,545.00	268,212,000	
京浜急行	88,300	1,143.00	100,926,900	
小田急電鉄	102,400	2,190.00	224,256,000	
京王電鉄	35,700	5,080.00	181,356,000	
京成電鉄	47,900	3,025.00	144,897,500	
富士急行	8,200	4,130.00	33,866,000	貸付株式数 3,600株
新京成電鉄	1,600	2,015.00	3,224,000	貸付株式数 300株
東日本旅客鉄道	121,100	7,022.00	850,364,200	
西日本旅客鉄道	83,400	4,848.00	404,323,200	
東海旅客鉄道	57,200	15,545.00	889,174,000	
西武ホールディングス	89,600	1,069.00	95,782,400	貸付株式数 32,300株
鴻池運輸	10,900	1,159.00	12,633,100	
西日本鉄道	19,100	2,574.00	49,163,400	
ハマキョウレックス	4,800	2,857.00	13,713,600	貸付株式数 600株
サカイ引越センター	3,200	4,260.00	13,632,000	貸付株式数 100株
近鉄グループHLDGS	65,200	3,245.00	211,574,000	
阪急阪神HLDGS	81,500	3,340.00	272,210,000	貸付株式数 2,800株
南海電鉄	29,000	2,116.00	61,364,000	貸付株式数 11,500株
京阪ホールディングス	29,100	2,557.00	74,408,700	
神戸電鉄	1,500	3,140.00	4,710,000	貸付株式数 600株
名古屋鉄道	53,700	1,706.00	91,612,200	貸付株式数 3,800株
山陽電鉄	4,900	1,993.00	9,765,700	貸付株式数 1,800株
トランコム	1,800	8,590.00	15,462,000	貸付株式数 700株
日本通運	22,600	6,730.00	152,098,000	
ヤマトホールディングス	91,400	2,654.00	242,575,600	
山 九	18,100	4,750.00	85,975,000	
日 新	5,100	1,599.00	8,154,900	貸付株式数 2,000株
丸 運	4,300	252.00	1,083,600	貸付株式数 1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,185.00	16,562,000	
センコーグループHLDGS	32,400	932.00	30,196,800	貸付株式数 13,900株
トナミホールディングス	1,600	3,670.00	5,872,000	貸付株式数 500株
ニッコンホールディングス	21,900	2,090.00	45,771,000	
日石輸送	600	2,618.00	1,570,800	貸付株式数 200株
福山通運	10,700	3,930.00	42,051,000	
セイノーホールディングス	44,500	1,167.00	51,931,500	貸付株式数 6,500株
エスライン	1,800	900.00	1,620,000	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	1,600	3,370.00	5,392,000	
日立物流	12,500	5,240.00	65,500,000	貸付株式数 200株
丸和運輸機関	13,800	1,402.00	19,347,600	貸付株式数 5,300株

C & F ロジホールディングス	6,500	1,533.00	9,964,500	
日本郵船	54,400	8,350.00	454,240,000	
商船三井	36,000	7,910.00	284,760,000	
川崎汽船	20,000	6,800.00	136,000,000	
N S ユナイテッド海運	3,500	3,345.00	11,707,500	
明治海運	7,500	686.00	5,145,000	貸付株式数 3,000株
飯野海運	29,800	519.00	15,466,200	貸付株式数 3,900株
共栄タンカー	1,100	830.00	913,000	貸付株式数 400株
九州旅客鉄道	50,200	2,377.00	119,325,400	
S G ホールディングス	123,200	2,616.00	322,291,200	
日本航空	149,200	2,058.00	307,053,600	
A N A ホールディングス	165,500	2,302.00	380,981,000	
パスコ	1,100	1,300.00	1,430,000	
T R E ホールディングス	8,800	1,687.00	14,845,600	貸付株式数 100株
人・夢・技術グループ	2,600	1,759.00	4,573,400	
西本W I S M E T T A C H D	1,500	3,100.00	4,650,000	貸付株式数 600株
シルバーライフ	1,500	1,313.00	1,969,500	貸付株式数 500株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	900	1,933.00	1,739,700	貸付株式数 200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,900	5,220.00	15,138,000	貸付株式数 1,100株
国際紙パルプ商事	15,900	287.00	4,563,300	貸付株式数 5,500株
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	911.00	1,457,600	貸付株式数 500株
ブックオフG H D	3,800	985.00	3,743,000	貸付株式数 1,500株
三菱倉庫	20,800	2,827.00	58,801,600	
三井倉庫H O L D	6,900	2,342.00	16,159,800	
住友倉庫	22,800	1,922.00	43,821,600	
渋沢倉庫	3,800	2,239.00	8,508,200	貸付株式数 600株
ヤマタネ	3,000	1,588.00	4,764,000	
東陽倉庫	10,600	318.00	3,370,800	貸付株式数 300株
乾汽船	4,500	2,163.00	9,733,500	貸付株式数 1,700株
日本トランスシティ	14,200	643.00	9,130,600	
ケイヒン	1,000	1,330.00	1,330,000	
中央倉庫	3,900	955.00	3,724,500	貸付株式数 1,400株
川西倉庫	1,200	1,101.00	1,321,200	貸付株式数 200株
安田倉庫	5,300	961.00	5,093,300	
ファイズホールディングス	1,400	525.00	735,000	貸付株式数 500株

東洋埠頭	1,900	1,429.00	2,715,100		
宇徳	5,400	723.00	3,904,200		
上組	35,900	2,168.00	77,831,200		
サンリツ	1,900	841.00	1,597,900	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,500	1,305.00	1,957,500	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	3,000	895.00	2,685,000	貸付株式数	1,200株
近鉄エクスプレス	12,300	3,025.00	37,207,500	貸付株式数	400株
東海運	3,600	303.00	1,090,800	貸付株式数	1,400株
エーアイティー	4,100	1,288.00	5,280,800	貸付株式数	600株
内外トランスライン	2,700	2,079.00	5,613,300	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,500	635.00	1,587,500	貸付株式数	900株
日本コンセプト	2,100	1,766.00	3,708,600	貸付株式数	800株
TBSホールディングス	41,100	1,662.00	68,308,200	貸付株式数	5,500株
日本テレビHLD S	56,400	1,154.00	65,085,600		
朝日放送グループHD	6,400	691.00	4,422,400		
テレビ朝日HD	16,100	1,432.00	23,055,200	貸付株式数	8,100株
スカパーJ S A T H D	57,300	412.00	23,607,600		
テレビ東京HD	4,800	1,992.00	9,561,600		
日本BS放送	2,400	1,092.00	2,620,800	貸付株式数	900株
ビジョン	11,900	1,189.00	14,149,100	貸付株式数	400株
スマートバリュー	1,800	411.00	739,800	貸付株式数	600株
USEN-NEXT H L D G S	6,800	2,991.00	20,338,800	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	2,900	319.00	925,100	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,600	1,425.00	6,555,000		
日本通信	55,100	200.00	11,020,000	貸付株式数	18,500株
クロップス	1,100	958.00	1,053,800	貸付株式数	400株
日本電信電話	789,800	3,183.00	2,513,933,400		
KDDI	492,200	3,363.00	1,655,268,600		
ソフトバンク	1,022,100	1,450.50	1,482,556,050		
光通信	8,000	17,600.00	140,800,000		
エムティーアイ	7,600	582.00	4,423,200	貸付株式数	2,500株
GMOインターネット	23,700	2,663.00	63,113,100	貸付株式数	9,000株
ファイバーゲート	2,200	1,167.00	2,567,400	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコ ミュ	1,000	293.00	293,000	貸付株式数	600株
KADOKAWA	19,600	5,610.00	109,956,000		
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	959.00	10,453,100	貸付株式数	4,600株
昭文社ホールディングス	2,700	477.00	1,287,900		



インプレスホールディングス	8,900	213.00	1,895,700		
東京電力HD	514,100	300.00	154,230,000	貸付株式数	94,500株
中部電力	211,000	1,204.00	254,044,000		
関西電力	261,100	1,064.00	277,810,400		
中国電力	107,800	944.00	101,763,200		
北陸電力	62,700	593.00	37,181,100		
東北電力	161,000	815.00	131,215,000		
四国電力	61,600	806.00	49,649,600		
九州電力	141,900	861.00	122,175,900	貸付株式数	5,200株
北海道電力	59,200	509.00	30,132,800	貸付株式数	22,400株
沖縄電力	14,400	1,461.00	21,038,400		
電源開発	58,700	1,547.00	90,808,900		
エフオン	4,500	586.00	2,637,000	貸付株式数	200株
イーレックス	10,200	2,196.00	22,399,200	貸付株式数	3,900株
レノバ	13,400	4,645.00	62,243,000		
東京瓦斯	131,900	2,090.00	275,671,000		
大阪瓦斯	124,700	1,918.00	239,174,600		
東邦瓦斯	31,500	3,135.00	98,752,500		
北海道瓦斯	3,100	1,504.00	4,662,400	貸付株式数	400株
広島ガス	12,700	361.00	4,584,700	貸付株式数	1,600株
西部ガスHLDGS	7,700	2,266.00	17,448,200		
静岡ガス	19,300	985.00	19,010,500		
メタウォーター	7,900	1,945.00	15,365,500		
アイネット	3,200	1,335.00	4,272,000		
松竹	4,400	11,540.00	50,776,000	貸付株式数	800株
東宝	39,800	4,970.00	197,806,000		
エイチ・アイ・エス	14,500	1,821.00	26,404,500	貸付株式数	5,700株
東映	2,200	17,550.00	38,610,000	貸付株式数	200株
ラックランド	1,700	3,030.00	5,151,000	貸付株式数	600株
NTTデータ	179,900	2,338.00	420,606,200		
共立メンテナンス	11,700	3,850.00	45,045,000	貸付株式数	4,500株
イチネンホールディングス	6,400	1,306.00	8,358,400		
建設技術研究所	3,800	2,278.00	8,656,400		
スペース	4,000	963.00	3,852,000	貸付株式数	1,500株
アインホールディングス	9,800	5,710.00	55,958,000	貸付株式数	3,800株
燦ホールディングス	2,700	1,506.00	4,066,200		
ピー・シー・エー	3,900	1,597.00	6,228,300	貸付株式数	1,100株
スバル興業	400	8,520.00	3,408,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,225.00	2,817,500		

タナベ経営	2,100	687.00	1,442,700	
ビジネス B 太田昭和	2,600	1,894.00	4,924,400	
ナガワ	2,100	11,330.00	23,793,000	貸付株式数 800株
東京都競馬	4,800	4,130.00	19,824,000	
常磐興産	2,600	1,391.00	3,616,600	貸付株式数 1,000株
カナモト	11,400	2,302.00	26,242,800	
D T S	12,800	2,497.00	31,961,600	貸付株式数 1,600株
スクウェア・エニックス・HD	31,400	6,090.00	191,226,000	
シーイーシー	7,200	1,049.00	7,552,800	
カプコン	63,700	2,699.00	171,926,300	
西尾レントオール	5,900	2,658.00	15,682,200	
アイ・エス・ビー	3,000	969.00	2,907,000	
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	25,900	4,600.00	119,140,000	
トランス・コスモス	8,300	3,090.00	25,647,000	
乃村工藝社	28,000	939.00	26,292,000	
ジャステック	3,700	1,021.00	3,777,700	貸付株式数 1,400株
S C S K	46,800	2,228.00	104,270,400	
藤田観光	2,900	2,321.00	6,730,900	貸付株式数 1,100株
K N T - C Tホールディングス	4,100	1,348.00	5,526,800	貸付株式数 1,600株
日本管財	7,000	2,709.00	18,963,000	貸付株式数 1,700株
トーカイ	5,700	1,967.00	11,211,900	貸付株式数 2,200株
白洋舎	800	1,766.00	1,412,800	貸付株式数 300株
セコム	64,900	7,932.00	514,786,800	
日本システムウエア	2,300	2,171.00	4,993,300	
セントラル警備保障	3,100	2,282.00	7,074,200	貸付株式数 1,200株
アイネス	5,900	1,430.00	8,437,000	貸付株式数 2,700株
丹青社	13,000	781.00	10,153,000	
メイテック	7,900	6,530.00	51,587,000	
T K C	11,500	3,330.00	38,295,000	
富士ソフト	7,200	5,410.00	38,952,000	貸付株式数 2,800株
応用地質	7,100	1,991.00	14,136,100	
船井総研ホールディング	13,400	2,504.00	33,553,600	
N S D	21,700	2,084.00	45,222,800	
進学会ホールディングス	2,100	268.00	562,800	貸付株式数 900株
丸紅建材リース	400	1,732.00	692,800	貸付株式数 100株
オオバ	4,300	764.00	3,285,200	貸付株式数 1,800株

コナミホールディングス	24,500	5,580.00	136,710,000		
いであ	1,700	1,884.00	3,202,800	貸付株式数	600株
学 究 社	2,200	1,487.00	3,271,400	貸付株式数	800株
ベネッセホールディングス	21,800	2,227.00	48,548,600	貸付株式数	3,300株
イオンディライト	8,100	3,305.00	26,770,500	貸付株式数	3,100株
ナック	3,200	951.00	3,043,200	貸付株式数	300株
福井コンピュータH L D S	3,000	3,295.00	9,885,000	貸付株式数	1,200株
ダイセキ	12,100	4,865.00	58,866,500	貸付株式数	5,100株
ステップ	2,600	1,818.00	4,726,800	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,800	4,750.00	22,800,000	貸付株式数	500株
泉州電業	1,900	5,550.00	10,545,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,800	2,443.00	4,397,400		
トラスコ中山	14,200	2,670.00	37,914,000	貸付株式数	600株
ヤマダホールディングス	247,800	380.00	94,164,000		
オートバックスセブン	22,500	1,368.00	30,780,000	貸付株式数	9,300株
モリト	4,900	690.00	3,381,000		
アークランドサカモト	10,500	1,605.00	16,852,500		
ニトリホールディングス	26,900	18,255.00	491,059,500		
グルメ杵屋	5,300	981.00	5,199,300	貸付株式数	2,100株
愛 眼	4,100	178.00	729,800		
ケーユーホールディングス	3,400	1,033.00	3,512,200	貸付株式数	1,300株
吉野家ホールディングス	23,500	2,297.00	53,979,500	貸付株式数	9,200株
加藤産業	9,800	3,230.00	31,654,000		
北恵	1,700	853.00	1,450,100	貸付株式数	600株
イノテック	3,900	1,387.00	5,409,300		
イエローハット	11,600	1,588.00	18,420,800	貸付株式数	4,500株
松屋フーズH L D G S	3,200	3,530.00	11,296,000	貸付株式数	1,200株
J B C Cホールディングス	4,300	1,789.00	7,692,700		
J Kホールディングス	5,300	1,076.00	5,702,800	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	10,300	1,021.00	10,516,300	貸付株式数	4,000株
日 伝	6,300	2,246.00	14,149,800	貸付株式数	100株
関西スーパーマーケット	5,000	1,034.00	5,170,000	貸付株式数	400株
ミロク情報サービス	5,900	1,357.00	8,006,300	貸付株式数	2,600株
北沢産業	4,400	244.00	1,073,600		
杉本商事	3,000	2,162.00	6,486,000	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,400	2,642.00	48,612,800		
王将フードサービス	4,400	6,000.00	26,400,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	7,500	1,937.00	14,527,500		
ミニストップ	5,400	1,394.00	7,527,600	貸付株式数	1,900株
アークス	13,000	2,135.00	27,755,000	貸付株式数	5,000株

パローホールディングス	15,000	2,138.00	32,070,000	
東 テ ク	2,300	2,432.00	5,593,600	
ミスミグループ本社	84,800	4,615.00	391,352,000	
藤 久	1,600	783.00	1,252,800	
アルテック	6,300	292.00	1,839,600	貸付株式数 300株
ベ ル ク	3,000	5,440.00	16,320,000	貸付株式数 1,100株
大 庄	3,500	935.00	3,272,500	貸付株式数 1,400株
タキヒヨー	2,000	1,650.00	3,300,000	貸付株式数 800株
ファーストリテイリング	9,100	66,560.00	605,696,000	
ソフトバンクグループ	404,900	5,344.00	2,163,785,600	
蔵王産業	900	1,973.00	1,775,700	
スズケン	26,500	3,290.00	87,185,000	貸付株式数 700株
サンドラッグ	25,500	3,090.00	78,795,000	
サックスパーホールディング グ	6,100	516.00	3,147,600	
ジェコス	4,500	778.00	3,501,000	
ヤマザワ	1,500	1,659.00	2,488,500	貸付株式数 500株
や ま や	1,300	2,400.00	3,120,000	貸付株式数 500株
グローセル	7,300	396.00	2,890,800	貸付株式数 2,700株
ベルーナ	14,900	704.00	10,489,600	貸付株式数 5,700株
合計			182,600,770,840	

(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。

「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12月18日現在	2021年12月20日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	273,117,006	1,253,840,414
コール・ローン	4,342,148,797	5,197,745,150
株式	155,418,316,420	233,939,162,230
投資証券	3,675,537,050	5,936,676,564
派生商品評価勘定	35,304,583	15,064,734
未収入金	59,317,136	2,238,533
未収配当金	129,709,291	175,151,202
差入委託証拠金	2,484,597,565	5,012,129,733
流動資産合計	166,418,047,848	251,532,008,560
資産合計	166,418,047,848	251,532,008,560
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,756,178	117,532,109
未払金	8,961,660	-
未払解約金	2,439,902,053	52,225,700
流動負債合計	2,463,619,891	169,757,809
負債合計	2,463,619,891	169,757,809
純資産の部		
元本等		
元本	1 53,363,008,733	61,674,819,062
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	110,591,419,224	189,687,431,689
元本等合計	163,954,427,957	251,362,250,751
純資産合計	163,954,427,957	251,362,250,751
負債純資産合計	166,418,047,848	251,532,008,560

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首	2019年12月19日	2020年12月19日
期首元本額	47,884,230,145円	53,363,008,733円
期中追加設定元本額	16,305,439,478円	13,771,213,468円
期中一部解約元本額	10,826,660,890円	5,459,403,139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	413,652,679円	371,481,601円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	6,008,769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)	104,337,898円	55,423,826円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	13,282,741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)	341,490,682円	234,345,757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)	23,557,605円	39,683,312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)	532,054,270円	504,665,975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)	2,224,733,038円	2,509,703,166円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	642,685,076円	510,646,780円
D-I's 外国株式インデックス	11,166,825円	15,516,248円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	6,448,626円	33,893,242円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	2,155,017,720円	4,215,042,571円
iFree 8資産バランス	1,024,708,121円	1,121,933,019円
iFree 年金バランス	58,404,777円	184,000,246円
DCダイワ外国株式インデックス	33,252,767,831円	38,684,682,327円
ダイワ・ライフ・バランス30	573,806,614円	506,389,345円
ダイワ・ライフ・バランス50	971,059,550円	933,195,084円
ダイワ・ライフ・バランス70	720,326,091円	757,548,873円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,544,063,117円	1,729,006,952円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	11,346,854円	12,891,171円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	7,806,988円	11,150,747円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	470,237,646円	833,306,342円
ダイワつみたてインデックス バランス30	2,119,892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	2,174,143円



ダイワつみたてインデックス バランス70	2,584,033円	3,645,733円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	151,581,899円	107,772,790円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	273,109,607円	208,616,060円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,200,857,974円	1,455,327,992円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	106,162,087円	73,750,723円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	251,457,589円	194,296,563円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	-円	209,089,795円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	795,415,836円	943,001,516円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	187,448,192円	333,687,374円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	1,428,539,384円	1,912,422,156円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,722,831,827円	2,851,280,025円
ダイワライフスタイル25	16,727,001円	12,394,062円
ダイワライフスタイル50	63,073,407円	49,684,792円
ダイワライフスタイル75	50,068,112円	39,615,746円
計	53,363,008,733円	61,674,819,062円
2. 期末日における受益権の総数	53,363,008,733口	61,674,819,062口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年12月18日現在	2021年12月20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	3,551,878,921	1,641,386,529

投資証券	30,358,987	139,215,780
合計	3,582,237,908	1,502,170,749

(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12月1日から2020年12月18日まで、及び2021年12月1日から2021年12月20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12月18日 現在				2021年12月20日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	4,738,563,197	-	4,766,828,344	28,265,147	11,789,789,327	-	11,689,355,558	100,433,769
合計	4,738,563,197	-	4,766,828,344	28,265,147	11,789,789,327	-	11,689,355,558	100,433,769

(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12月18日 現在				2021年12月20日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								

為替予約取引								
買 建	1,869,292,542	-	1,861,575,800	7,716,742	5,341,793,100	-	5,339,759,494	2,033,606
アメリカ・ドル	1,468,702,530	-	1,454,979,000	13,723,530	3,209,117,795	-	3,214,039,490	4,921,695
イギリス・ポンド	63,973,902	-	64,395,400	421,498	253,116,898	-	252,600,432	516,466
オーストラリア・ドル	53,655,910	-	55,013,000	1,357,090	282,982,560	-	283,180,450	197,890
カナダ・ドル	49,761,572	-	50,238,600	477,028	325,848,643	-	323,516,372	2,332,271
スイス・フラン	11,489,660	-	11,673,000	183,340	307,969,224	-	307,656,500	312,724
ユーロ	221,708,968	-	225,276,800	3,567,832	962,757,980	-	958,766,250	3,991,730
合計	1,869,292,542	-	1,861,575,800	7,716,742	5,341,793,100	-	5,339,759,494	2,033,606

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	3.0724円	4.0756円
(1万口当たり純資産額)	(30,724円)	(40,756円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	4,250	175.790	747,107.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,640	530.140	1,929,709.600	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,900	197.200	1,360,680.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,100	81.940	417,894.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,300	125.290	288,167.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	46.650	984,315.000	
	ABBOTT LABORATORIES	66,166	137.110	9,072,020.260	
	HOWMET AEROSPACE INC	14,133	29.960	423,424.680	
	VERISK ANALYTICS INC	5,650	222.140	1,255,091.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	12,650	35.440	448,316.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	22,400	82.480	1,847,552.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,610	482.990	777,613.900	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23,162	107.980	2,501,032.760	
	QORVO INC	4,220	147.680	623,209.600	
	AFLAC INC	23,600	56.840	1,341,424.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,950	139.830	692,158.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,050	105.140	636,097.000	
	ADOBE INC	17,770	556.640	9,891,492.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,050	64.810	521,720.500	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,530	384.660	1,742,509.800	
	GARMIN LTD	5,850	132.230	773,545.500	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,300	298.330	2,476,139.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,750	205.170	5,283,127.500	
	WR BERKLEY CORP	5,275	80.400	424,110.000	
	AUTOZONE INC	820	1,996.370	1,637,023.400	
	DOLLAR TREE INC	8,321	136.320	1,134,318.720	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	41,900	8.200	343,580.000		
CELANESE CORP	4,150	159.230	660,804.500		
DR HORTON INC	12,816	103.020	1,320,304.320		
DENTSPLY SIRONA INC	7,950	53.410	424,609.500		
AUTODESK INC	8,270	277.650	2,296,165.500		

MOODY'S CORP	6,310	393.640	2,483,868.400	
DEVON ENERGY CORP	24,100	39.200	944,720.000	
ALBEMARLE CORP	4,420	229.870	1,016,025.400	
ATMOS ENERGY CORP	4,850	98.830	479,325.500	
ALLIANT ENERGY CORP	9,400	59.770	561,838.000	
CITIGROUP INC	75,773	59.540	4,511,524.420	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,850	229.410	3,636,148.500	
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,850	86.540	1,631,279.000	
ALLEGHANY CORP	520	657.830	342,071.600	
DOMINO'S PIZZA INC	1,430	528.380	755,583.400	
HESS CORP	10,500	71.620	752,010.000	
DAVITA INC	2,750	104.870	288,392.500	
DANAHER CORP	23,950	313.410	7,506,169.500	
FORTIVE CORP	12,800	72.890	932,992.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	21,100	133.380	2,814,318.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,950	65.270	1,367,406.500	
BUNGE LTD	5,400	88.080	475,632.000	
TE CONNECTIVITY LTD	12,345	156.410	1,930,881.450	
APPLE INC	617,100	171.140	105,610,494.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,250	114.110	1,283,737.500	
BOEING CO/THE	20,780	192.630	4,002,851.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,765	113.000	651,445.000	
BECTON DICKINSON AND CO	10,769	256.900	2,766,556.100	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	7,600	9.340	70,984.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,900	86.730	424,977.000	
NISOURCE INC	14,800	26.880	397,824.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,900	101.370	496,713.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,771	57.500	1,769,332.500	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	154,604	53.170	8,220,294.680	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	49,450	293.660	14,521,487.000	
ANSYS INC	3,300	396.860	1,309,638.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	49,967	57.110	2,853,615.370	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	25,700	123.270	3,168,039.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	82,900	61.560	5,103,324.000	
JPMORGAN CHASE & CO	111,270	156.760	17,442,685.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,500	193.360	1,643,560.000	
LKQ CORP	10,250	55.730	571,232.500	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,662	71.900	838,497.800	
CADENCE DESIGN SYS INC	10,400	179.150	1,863,160.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,320	294.630	1,272,801.600	
DOLLAR GENERAL CORP	8,850	222.500	1,969,125.000	
SERVICENOW INC	7,400	615.630	4,555,662.000	
CATERPILLAR INC	20,450	201.370	4,118,016.500	
BROWN & BROWN INC	9,000	65.870	592,830.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,800	51.530	453,464.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,900	362.950	689,605.000	
CMS ENERGY CORP	10,650	64.180	683,517.000	
MOSAIC CO/THE	13,900	36.460	506,794.000	
DELTA AIR LINES INC	5,750	36.560	210,220.000	
CORNING INC	30,400	36.690	1,115,376.000	
CISCO SYSTEMS INC	157,250	60.460	9,507,335.000	
MORGAN STANLEY	51,152	97.130	4,968,393.760	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	61.060	128,226.000	
MSCI INC	3,120	590.220	1,841,486.400	
FAIR ISAAC CORP	1,100	412.250	453,475.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	312.480	406,224.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,500	79.960	679,660.000	
BROADCOM INC	15,262	634.960	9,690,759.520	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,350	194.570	846,379.500	
ARAMARK	8,500	33.950	288,575.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,170	116.600	836,022.000	
CENTENE CORP	21,887	83.020	1,817,058.740	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,950	128.250	506,587.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,700	45.460	713,722.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,700	164.400	1,265,880.000	
GARTNER INC	3,150	320.070	1,008,220.500	
SPLUNK INC	6,010	111.340	669,153.400	
DOMINION ENERGY INC	30,241	76.630	2,317,367.830	
MONSTER BEVERAGE CORP	14,900	91.620	1,365,138.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,000	80.910	404,550.000	
DEERE & CO	11,000	347.030	3,817,330.000	
POOL CORP	1,480	540.640	800,147.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,034	128.070	1,413,124.380	
VMWARE INC-CLASS A	7,880	114.790	904,545.200	
CABLE ONE INC	200	1,677.950	335,590.000	
BURLINGTON STORES INC	2,520	277.240	698,644.800	

NASDAQ INC	4,450	201.070	894,761.500	
VAIL RESORTS INC	1,490	322.210	480,092.900	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	19,200	29.120	559,104.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,630	135.680	356,838.400	
CONSOLIDATED EDISON INC	13,300	83.820	1,114,806.000	
COGNEX CORP	6,500	75.910	493,415.000	
TELEFLEX INC	1,800	321.500	578,700.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,050	192.100	585,905.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,800	449.810	1,259,468.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	790	731.460	577,853.400	
CATALENT INC	6,400	125.370	802,368.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,200	256.930	1,336,036.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,200	302.920	666,424.000	
IDEX CORP	2,760	228.730	631,294.800	
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,000	82.480	2,474,400.000	
ROLLINS INC	8,087	32.770	265,010.990	
AMETEK INC	8,695	139.830	1,215,821.850	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,200	98.090	902,428.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,950	58.980	350,931.000	
HEICO CORP	1,600	135.870	217,392.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,400	357.430	857,832.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	473.120	662,368.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	87.760	881,988.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,500	501.670	752,505.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,460	547.610	9,013,660.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,050	112.240	342,332.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,120	636.330	1,349,019.600	
RPM INTERNATIONAL INC	4,900	96.800	474,320.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,070	1,683.840	1,801,708.800	
UGI CORP	7,650	44.890	343,408.500	
CUMMINS INC	5,350	211.030	1,129,010.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,150	61.360	1,788,644.000	
CDW CORP/DE	5,100	190.070	969,357.000	
SIGNATURE BANK	2,350	303.470	713,154.500	
COSTAR GROUP INC	14,850	78.700	1,168,695.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,200	654.010	1,438,822.000	



AMERCO	400	715.300	286,120.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,720	340.620	1,267,106.400	
MERCADOLIBRE INC	1,690	1,187.550	2,006,959.500	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,760	164.240	453,302.400	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,466	140.940	1,475,078.040	
IPG PHOTONICS CORP	1,420	165.770	235,393.400	
DEXCOM INC	3,620	555.340	2,010,330.800	
NORDSON CORP	1,990	248.430	494,375.700	
COPART INC	8,030	143.120	1,149,253.600	
DIAMONDBACK ENERGY INC	6,600	102.430	676,038.000	
SEAGEN INC	5,150	150.150	773,272.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,810	609.060	1,711,458.600	
TRANSDIGM GROUP INC	1,990	583.880	1,161,921.200	
BIO-TECHNE CORP	1,480	470.560	696,428.800	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,600	86.630	311,868.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,050	103.840	835,912.000	
KINDER MORGAN INC	76,381	15.600	1,191,543.600	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	253.790	2,487,142.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,400	410.420	574,588.000	
COTERRA ENERGY INC	29,000	19.660	570,140.000	
T-MOBILE US INC	23,377	119.810	2,800,798.370	
ZILLOW GROUP INC - C	6,350	62.460	396,621.000	
COCA-COLA CO/THE	152,850	57.730	8,824,030.500	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,350	53.550	393,592.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,450	129.930	838,048.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,150	33.220	370,403.000	
CSX CORP	84,300	35.720	3,011,196.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,640	307.920	1,120,828.800	
EXPEDIA GROUP INC	5,475	159.310	872,222.250	
AMAZON.COM INC	17,010	3,400.350	57,839,953.500	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23,390	122.120	2,856,386.800	
EXXON MOBIL CORP	158,105	60.030	9,491,043.150	
AES CORP	24,600	24.090	592,614.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,500	266.930	400,395.000	
EOG RESOURCES INC	21,900	84.000	1,839,600.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,000	115.350	692,100.000	

ABIOMED INC	1,710	315.550	539,590.500
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,830	125.180	729,799.400
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,370	151.420	1,721,645.400
FORD MOTOR CO	146,923	19.770	2,904,667.710
NOVAVAX INC	2,600	217.320	565,032.000
DISCOVERY INC - A	6,290	23.280	146,431.200
EXACT SCIENCES CORP	6,450	80.270	517,741.500
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,637	27.130	152,931.810
LIBERTY BROADBAND-A	850	153.930	130,840.500
ENTEGRIS INC	5,200	132.960	691,392.000
DISCOVERY INC-C	11,389	22.420	255,341.380
FORTINET INC	5,230	333.830	1,745,930.900
MARKEL CORP	510	1,220.250	622,327.500
NEXTERA ENERGY INC	73,280	90.940	6,664,083.200
MASIMO CORP	2,000	280.080	560,160.000
FREEMPORT-MCMORAN INC	55,008	38.000	2,090,304.000
INSULET CORP	2,600	262.700	683,020.000
US BANCORP	52,700	55.730	2,936,971.000
UNITED RENTALS INC	2,720	332.330	903,937.600
F5 NETWORKS INC	2,250	233.000	524,250.000
FASTENAL CO	21,550	62.050	1,337,177.500
FISERV INC	22,383	103.650	2,319,997.950
GENERAL ELECTRIC CO	41,056	91.450	3,754,571.200
GENERAL MOTORS CO	48,950	55.160	2,700,082.000
ZENDESK INC	4,370	102.320	447,138.400
GENERAL DYNAMICS CORP	8,900	202.200	1,799,580.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,550	381.800	4,791,590.000
ALPHABET INC-CL A	11,220	2,834.500	31,803,090.000
ALPHABET INC-CL C	10,737	2,856.060	30,665,516.220
OWENS CORNING	3,900	87.020	339,378.000
GENERAL MILLS INC	22,700	67.650	1,535,655.000
FIRSTENERGY CORP	20,418	40.080	818,353.440
GENUINE PARTS CO	5,450	133.250	726,212.500
IHS MARKIT LTD	14,234	131.220	1,867,785.480
FIFTH THIRD BANCORP	25,900	42.260	1,094,534.000
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,550	207.930	1,569,871.500
HALLIBURTON CO	33,500	22.110	740,685.000
HOME DEPOT INC	39,350	387.980	15,267,013.000
ASSURANT INC	2,250	150.580	338,805.000

HUNTINGTON BANCSHARES INC	55,500	14.880	825,840.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,510	184.110	278,006.100	
HERSHEY CO/THE	5,390	187.620	1,011,271.800	
HUMANA INC	4,820	453.330	2,185,050.600	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,400	218.710	2,274,584.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,920	185.210	540,813.200	
HENRY SCHEIN INC	5,100	73.750	376,125.000	
HP INC	47,300	36.570	1,729,761.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	48,900	15.080	737,412.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,428	48.310	310,536.680	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,000	59.420	415,940.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	48.450	142,927.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,900	43.220	643,978.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	25,203	35.510	894,958.530	
ENPHASE ENERGY INC	4,840	189.110	915,292.400	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	33,500	127.400	4,267,900.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,750	45.840	630,300.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	100.740	523,848.000	
ZOETIS INC	17,700	234.310	4,147,287.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,979	194.340	1,744,978.860	
CHENIERE ENERGY INC	9,100	100.410	913,731.000	
ALLEGION PLC	3,450	127.890	441,220.500	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	27.420	355,719.660	
WASTE CONNECTIONS INC	9,737	130.250	1,268,244.250	
JUNIPER NETWORKS INC	12,200	33.640	410,408.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,050	136.410	552,460.500	
JOHNSON & JOHNSON	98,100	168.230	16,503,363.000	
PLUG POWER INC	19,500	29.750	580,125.000	
ABBVIE INC	65,972	129.530	8,545,353.160	
HOLOGIC INC	9,550	77.710	742,130.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	12,600	139.370	1,756,062.000	
KROGER CO	26,400	44.790	1,182,456.000	
KLA CORP	5,760	391.550	2,255,328.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,330	344.140	3,210,826.200	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,930	214.260	627,781.800
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,000	69.850	698,500.000
LOWE'S COS INC	26,000	248.090	6,450,340.000
ELI LILLY & CO	30,285	267.420	8,098,814.700
LAM RESEARCH CORP	5,300	669.170	3,546,601.000
LOEWS CORP	8,300	56.780	471,274.000
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	65.760	437,238.240
MCDONALD'S CORP	27,850	261.700	7,288,345.000
3M CO	21,690	174.750	3,790,327.500
META PLATFORMS INC CLASS A	88,900	333.790	29,673,931.000
S&P GLOBAL INC	9,010	467.640	4,213,436.400
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,310	436.350	1,007,968.500
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,020	288.850	583,477.000
PHILLIPS 66	16,400	71.800	1,177,520.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	42.280	678,594.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,200	94.120	865,904.000
METLIFE INC	27,000	60.250	1,626,750.000
MARVELL TECHNOLOGY INC	30,950	84.030	2,600,728.500
ARISTA NETWORKS INC	8,660	135.030	1,169,359.800
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5,100	80.600	411,060.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,378	259.120	1,652,667.360
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	880	1,579.340	1,389,819.200
BAKER HUGHES CO	31,023	23.680	734,624.640
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,340	341.760	1,483,238.400
MERCK & CO. INC.	94,521	75.690	7,154,294.490
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	76.510	1,587,659.010
MASCO CORP	9,100	66.470	604,877.000
M & T BANK CORP	4,839	147.150	712,058.850
MARSH & MCLENNAN COS	18,970	168.300	3,192,651.000
BLACK KNIGHT INC	5,950	82.710	492,124.500
HEICO CORP-CLASS A	2,720	121.390	330,180.800
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,920	72.350	717,712.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	10,422	150.190	1,565,280.180
WORKDAY INC-CLASS A	7,150	273.880	1,958,242.000
WAYFAIR INC- CLASS A	2,710	201.780	546,823.800

BLOCK INC CLASS A	14,900	167.060	2,489,194.000	
TRANSUNION	7,200	110.760	797,472.000	
VISTRA CORP	15,650	21.230	332,249.500	
NOVOCURE LTD	3,450	84.030	289,903.500	
NETAPP INC	8,450	88.060	744,107.000	
NIKE INC -CL B	47,700	161.360	7,696,872.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,250	284.790	2,634,307.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,550	84.360	1,733,598.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,855	97.380	667,539.900	
ALLY FINANCIAL INC	13,650	46.240	631,176.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,710	377.460	2,155,296.600	
APTIV PLC	10,200	158.420	1,615,884.000	
NEWMONT CORP	29,961	59.240	1,774,889.640	
MCKESSON CORP	5,750	233.090	1,340,267.500	
XYLEM INC	6,670	115.810	772,452.700	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	58,200	93.450	5,438,790.000	
NUCOR CORP	10,950	118.000	1,292,100.000	
SUNRUN INC	6,550	34.230	224,206.500	
WESTERN UNION CO	15,246	17.380	264,975.480	
GODADDY INC - CLASS A	6,400	71.740	459,136.000	
NEWELL BRANDS INC	14,442	21.750	314,113.500	
EVERGY INC	8,650	66.890	578,598.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,124	28.040	984,876.960	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,050	187.520	196,896.000	
OKTA INC	4,710	217.910	1,026,356.100	
COUPA SOFTWARE INC	2,700	158.070	426,789.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	155.510	870,856.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,755	28.270	445,393.850	
LINDE PLC	19,246	333.830	6,424,892.180	
WIX.COM LTD	2,130	145.280	309,446.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,300	31.850	455,455.000	
KKR & CO INC	19,600	71.580	1,402,968.000	
PAYCHEX INC	12,200	123.890	1,511,458.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,600	676.070	1,757,782.000	
ALTRIA GROUP INC	69,000	48.250	3,329,250.000	
P G & E CORP	55,100	12.020	662,302.000	
PFIZER INC	208,913	59.480	12,426,145.240	
CIGNA CORP	12,820	219.620	2,815,528.400	
DELL TECHNOLOGIES -C	10,501	54.650	573,879.650	

XCEL ENERGY INC	20,200	67.000	1,353,400.000	
STERIS PLC	3,750	232.540	872,025.000	
SEA LTD-ADR	5,400	212.800	1,149,120.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	34.220	185,917.260	
FOX CORP - CLASS A	12,199	36.960	450,875.040	
STRYKER CORP	12,730	251.220	3,198,030.600	
LYFT INC-A	9,800	38.070	373,086.000	
DOW INC	27,968	54.100	1,513,068.800	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,850	94.940	365,519.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,140	199.740	1,625,883.600	
PARKER HANNIFIN CORP	4,860	302.610	1,470,684.600	
UBER TECHNOLOGIES INC	45,900	39.680	1,821,312.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,750	173.690	1,519,787.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	90,567	157.460	14,260,679.820	
EXELON CORP	36,672	53.520	1,962,685.440	
TELADOC HEALTH INC	5,400	97.770	527,958.000	
INGERSOLL-RAND INC	15,208	58.220	885,409.760	
NVR INC	120	5,636.780	676,413.600	
CONOCOPHILLIPS	50,102	68.610	3,437,498.220	
TWILIO INC - A	6,250	273.630	1,710,187.500	
DOCUSIGN INC	7,300	155.370	1,134,201.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,890	406.820	768,889.800	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,000	101.850	509,250.000	
PEPSICO INC	51,600	168.300	8,684,280.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,500	164.320	246,480.000	
DROPBOX INC-CLASS A	11,400	24.340	277,476.000	
MONGODB INC	2,220	497.850	1,105,227.000	
SNAP INC - A	39,750	45.290	1,800,277.500	
CORTEVA INC	27,568	46.080	1,270,333.440	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,300	105.380	1,506,934.000	
AMCOR PLC	56,400	11.790	664,956.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,150	205.100	1,466,465.000	
ROKU INC	4,400	236.460	1,040,424.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,850	183.110	1,254,303.500	
ACCENTURE PLC-CL A	23,600	396.240	9,351,264.000	

10X GENOMICS INC-CLASS A	2,950	143.450	423,177.500	
KORNIT DIGITAL LTD	1,900	130.520	247,988.000	
PENTAIR PLC	6,275	70.120	440,003.000	
QUALCOMM INC	42,050	176.800	7,434,440.000	
INVESCO LTD	14,100	22.610	318,801.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	232.820	547,127.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,000	71.640	716,400.000	
DATADOG INC - CLASS A	7,200	170.160	1,225,152.000	
PINTEREST INC- CLASS A	20,850	36.510	761,233.500	
INMODE LTD	2,100	67.770	142,317.000	
AVALARA INC	3,250	138.640	450,580.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,920	619.280	2,427,577.600	
REPUBLIC SERVICES INC	8,250	134.980	1,113,585.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,500	2,210.460	3,315,690.000	
ROSS STORES INC	13,450	108.070	1,453,541.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,630	130.030	472,008.900	
RESMED INC	5,480	252.980	1,386,330.400	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	171.200	809,776.000	
ROBERT HALF INTL INC	4,150	106.510	442,016.500	
MODERNA INC	12,870	294.800	3,794,076.000	
HUBSPOT INC	1,680	668.500	1,123,080.000	
PERKINELMER INC	4,130	187.590	774,746.700	
CARRIER GLOBAL CORP	30,887	52.260	1,614,154.620	
OTIS WORLDWIDE CORP	15,288	84.160	1,286,638.080	
BILL.COM HOLDINGS INC	2,900	244.740	709,746.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	6,700	70.340	471,278.000	
AVANTOR INC	19,850	39.900	792,015.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	6,100	52.000	317,200.000	
DYNATRACE INC	6,700	57.580	385,786.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	16,270	89.990	1,464,137.300	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,300	117.700	153,010.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	35,185	21.270	748,384.950	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	8,600	62.730	539,478.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	12,800	38.540	493,312.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,030	125.430	380,052.900	
MATCH GROUP INC	9,820	126.650	1,243,703.000	
CHEVRON CORP	72,118	113.600	8,192,604.800	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,500	42.450	445,725.000	

ZSCALER INC	3,100	304.870	945,097.000
EDISON INTERNATIONAL	14,350	66.700	957,145.000
ETSY INC	4,750	221.600	1,052,600.000
TESLA INC	31,370	932.570	29,254,720.900
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,900	332.330	2,625,407.000
NORTONLIFELOCK INC	21,400	25.720	550,408.000
DRAFTKINGS INC - CL A	12,200	28.670	349,774.000
UNITY SOFTWARE INC	2,100	138.410	290,661.000
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,102	183.700	1,120,937.400
SYNOPSYS INC	5,730	348.040	1,994,269.200
CARVANA CO	2,820	223.590	630,523.800
CHEWY INC - CLASS A	3,250	54.760	177,970.000
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,900	134.590	1,197,851.000
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,785	650.000	3,110,250.000
VIATRIS INC	45,321	13.030	590,532.630
DOORDASH INC - A	4,050	148.810	602,680.500
AIRBNB INC-CLASS A	8,900	157.910	1,405,399.000
CBRE GROUP INC - A	12,600	101.750	1,282,050.000
TWITTER INC	29,850	43.070	1,285,639.500
SOUTHERN CO/THE	39,650	66.840	2,650,206.000
SYSCO CORP	19,150	72.110	1,380,906.500
TRAVELERS COS INC/THE	9,353	158.190	1,479,551.070
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	39.080	78,160.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	60.320	259,376.000
STEEL DYNAMICS INC	7,650	62.340	476,901.000
SCHLUMBERGER LTD	52,452	28.970	1,519,534.440
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,850	57.190	334,561.500
AFFIRM HOLDINGS INC	3,400	98.770	335,818.000
AT&T INC	266,691	23.780	6,341,911.980
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,550	39.660	220,113.000
ON SEMICONDUCTOR CORP	16,200	61.990	1,004,238.000
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,000	87.910	703,280.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,390	340.440	3,196,731.600
SEMPRA ENERGY	11,900	126.870	1,509,753.000
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,500	49.320	320,580.000
CLARIVATE PLC	13,400	23.700	317,580.000
OAK STREET HEALTH INC	3,600	33.970	122,292.000



PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	59,500	19.060	1,134,070.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,950	104.510	830,854.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,500	243.350	365,025.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	34,400	186.300	6,408,720.000	
SALESFORCE.COM INC	36,516	252.930	9,235,991.880	
ASANA INC CLASS A	2,600	74.750	194,350.000	
WESTROCK CO	9,880	43.940	434,127.200	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	26,684	77.050	2,056,002.200	
TERADYNE INC	6,200	156.260	968,812.000	
UNION PACIFIC CORP	24,380	242.690	5,916,782.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	62.450	1,498,050.600	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	56,279	82.280	4,630,636.120	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,200	206.590	5,619,248.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,224	267.430	1,931,914.320	
AMEREN CORPORATION	9,650	86.410	833,856.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,116	487.120	17,105,705.920	
VERISIGN INC	3,820	242.110	924,860.200	
LUCID GROUP INC	15,400	40.010	616,154.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	6,600	97.700	644,820.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	7,200	19.100	137,520.000	
VALERO ENERGY CORP	15,292	68.690	1,050,407.480	
SOFI TECHNOLOGIES INC	20,000	14.650	293,000.000	
UPSTART HOLDINGS INC	800	139.180	111,344.000	
ULTA BEAUTY INC	1,890	380.940	719,976.600	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,888	50.350	497,860.800	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	127.800	361,674.000	
ANTHEM INC	9,100	445.100	4,050,410.000	
WALT DISNEY CO/THE	67,762	148.760	10,080,275.120	
WELLS FARGO & CO	153,122	47.950	7,342,199.900	
WASTE MANAGEMENT INC	15,750	161.310	2,540,632.500	
WILLIAMS COS INC	45,600	25.790	1,176,024.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,250	226.650	963,262.500	
WHIRLPOOL CORP	2,320	230.360	534,435.200	
WALMART INC	57,500	138.750	7,978,125.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,850	120.850	948,672.500	

WYNN RESORTS LTD	4,000	82.270	329,080.000	
WABTEC CORP	6,711	88.960	597,010.560	
TJX COMPANIES INC	45,000	74.020	3,330,900.000	
WATERS CORP	2,310	348.350	804,688.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,010	588.520	1,182,925.200	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,600	48.850	1,348,260.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	232.880	1,132,495.440	
WESTERN DIGITAL CORP	11,600	56.850	659,460.000	
WEC ENERGY GROUP INC	11,830	96.290	1,139,110.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,050	64.090	1,220,914.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	62,950	211.880	13,337,846.000	
PPL CORP	28,900	29.560	854,284.000	
PULTEGROUP INC	9,850	52.980	521,853.000	
PPG INDUSTRIES INC	8,930	164.590	1,469,788.700	
NORTHERN TRUST CORP	7,300	117.230	855,779.000	
NVIDIA CORP	93,380	278.010	25,960,573.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,913	197.240	3,138,680.120	
TYSON FOODS INC-CL A	10,850	85.430	926,915.500	
NETFLIX INC	16,490	586.730	9,675,177.700	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,660	651.070	9,544,686.200	
NRG ENERGY INC	9,250	40.490	374,532.500	
GLOBE LIFE INC	3,655	89.680	327,780.400	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,600	199.340	1,315,644.000	
TEXTRON INC	8,300	74.080	614,864.000	
NEWS CORP - CLASS A	14,137	21.280	300,835.360	
OMNICOM GROUP	7,950	73.030	580,588.500	
ORACLE CORP	62,133	96.620	6,003,290.460	
MASTERCARD INC - A	32,800	349.310	11,457,368.000	
ONEOK INC	16,800	57.850	971,880.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,752	12.590	437,527.680	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,950	475.520	1,878,304.000	
YUM! BRANDS INC	11,100	131.930	1,464,423.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,400	175.740	773,256.000	

MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,950	44.740	310,943.000	
BANK OF AMERICA CORP	282,401	43.880	12,391,755.880	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,720	417.370	717,876.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,000	86.480	605,360.000	
AMERICAN EXPRESS CO	25,250	160.010	4,040,252.500	
ANALOG DEVICES INC	20,091	170.110	3,417,680.010	
ADVANCED MICRO DEVICES	45,200	137.750	6,226,300.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,072	54.110	1,735,415.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,250	151.700	948,125.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,450	72.410	611,864.500	
AVERY DENNISON CORP	3,130	206.890	647,565.700	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,750	84.820	1,675,195.000	
EMERSON ELECTRIC CO	22,450	90.690	2,035,990.500	
AON PLC-CLASS A	8,400	292.380	2,455,992.000	
AMGEN INC	21,200	222.500	4,717,000.000	
EATON CORP PLC	14,936	165.070	2,465,485.520	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,250	242.250	1,514,062.500	
APPLIED MATERIALS INC	33,700	146.150	4,925,255.000	
CME GROUP INC	13,470	224.780	3,027,786.600	
ECOLAB INC	9,650	225.450	2,175,592.500	
EQUIFAX INC	4,590	276.640	1,269,777.600	
GILEAD SCIENCES INC	46,900	72.210	3,386,649.000	
KEURIG DR PEPPER INC	26,700	35.680	952,656.000	
HORMEL FOODS CORP	11,200	48.170	539,504.000	
STATE STREET CORP	13,763	91.830	1,263,856.290	
SCHWAB (CHARLES) CORP	54,040	82.950	4,482,618.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,700	83.630	1,563,881.000	
CAMPBELL SOUP CO	7,500	43.120	323,400.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	106.930	532,511.400	
CARDINAL HEALTH INC	11,000	49.650	546,150.000	
FEDEX CORP	9,500	250.320	2,378,040.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	144.080	2,413,916.320	
FMC CORP	4,850	103.980	504,303.000	
CERNER CORP	11,200	89.770	1,005,424.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,363	144.430	1,352,298.090	
CITRIX SYSTEMS INC	4,600	83.520	384,192.000	
INTEL CORP	151,500	50.620	7,668,930.000	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14,800	36.710	543,308.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,150	67.700	890,255.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,800	238.180	2,810,524.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.380	246,268.000	
ILLUMINA INC	5,530	384.920	2,128,607.600	
SEALED AIR CORP	5,400	64.630	349,002.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	13,370	337.400	4,511,038.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	114.240	496,944.000	
SNAP-ON INC	2,020	209.350	422,887.000	
CARMAX INC	6,100	137.540	838,994.000	
DUKE ENERGY CORP	28,828	103.040	2,970,437.120	
TARGET CORP	18,250	223.310	4,075,407.500	
DOVER CORP	5,400	170.290	919,566.000	
WW GRAINGER INC	1,700	492.890	837,913.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,920	135.530	666,807.600	
CINTAS CORP	3,520	438.510	1,543,555.200	
CONAGRA BRANDS INC	18,000	34.580	622,440.000	
CLOROX COMPANY	4,630	174.160	806,360.800	
ENTERGY CORP	7,420	109.520	812,638.400	
MICROSOFT CORP	266,600	323.800	86,325,080.000	
INCYTE CORP	6,930	72.890	505,127.700	
CVS HEALTH CORP	49,269	100.360	4,944,636.840	
MEDTRONIC PLC	50,198	100.630	5,051,424.740	
MICRON TECHNOLOGY INC	42,100	83.000	3,494,300.000	
BLACKROCK INC	5,690	913.570	5,198,213.300	
CENTERPOINT ENERGY INC	22,200	26.980	598,956.000	
HASBRO INC	5,000	98.850	494,250.000	
KELLOGG CO	9,700	64.450	625,165.000	
KEYCORP	35,400	22.510	796,854.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	52,361	64.960	3,401,370.560	
COOPER COS INC/THE	1,770	393.470	696,441.900	
CHUBB LTD	16,419	189.770	3,115,833.630	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	125.220	338,094.000	
ALLSTATE CORP	11,200	114.140	1,278,368.000	
EBAY INC	24,900	64.030	1,594,347.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	41,650	186.200	7,755,230.000	

	EASTMAN CHEMICAL CO	5,050	118.680	599,334.000	
	XILINX INC	9,300	200.140	1,861,302.000	
	DISH NETWORK CORP-A	8,900	33.250	295,925.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,720	345.960	3,016,771.200	
	TRIMBLE INC	9,500	85.430	811,585.000	
	LENNAR CORP-A	10,300	105.840	1,090,152.000	
	LEAR CORP	2,150	174.400	374,960.000	
	PROGRESSIVE CORP	21,940	100.970	2,215,281.800	
	PACCAR INC	12,987	83.500	1,084,414.500	
	BIOGEN INC	5,620	237.430	1,334,356.600	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,200	616.880	1,974,016.000	
	STARBUCKS CORP	44,050	108.630	4,785,151.500	
	PTC INC	4,220	120.750	509,565.000	
	EVERSOURCE ENERGY	12,910	89.400	1,154,154.000	
	INTUIT INC	10,180	620.270	6,314,348.600	
	BORGWARNER INC	8,750	43.630	381,762.500	
	BEST BUY CO INC	8,450	100.030	845,253.500	
	BALL CORP	12,284	92.790	1,139,832.360	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	53,397	40.860	2,181,801.420	
	ELECTRONIC ARTS INC	10,570	127.520	1,347,886.400	
	VULCAN MATERIALS CO	5,050	204.740	1,033,937.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,750	214.540	2,091,765.000	
	VF CORP	12,550	70.980	890,799.000	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	22,725	29.520	670,842.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	170.640	375,408.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	11,500	54.920	631,580.000	
	CARNIVAL CORP	31,100	18.280	568,508.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	170,690	48.750	8,321,137.500	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,300	55.330	459,239.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,800	5.200	232,960.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 1,523,803,517.950 (173,134,555,710)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	749,000	3.337	2,499,787.500	
	UNILEVER PLC	96,660	39.820	3,849,001.200	
	BARCLAYS PLC	631,300	1.808	1,141,642.920	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	311,500	1.143	356,044.500	

PRUDENTIAL PLC	97,500	12.750	1,243,125.000	
NATWEST GROUP PLC	210,291	2.194	461,378.450	
EVRAZ PLC	17,400	6.000	104,400.000	
JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	19.625	138,631.000	
BAE SYSTEMS PLC	120,000	5.326	639,120.000	
AVIVA PLC	146,366	4.029	589,708.610	
AVEVA GROUP PLC	4,400	32.570	143,308.000	
GLAXOSMITHKLINE PLC	187,300	16.134	3,021,898.200	
INFORMA PLC	56,000	5.020	281,120.000	
MELROSE INDUSTRIES PLC	159,540	1.468	234,284.490	
AUTO TRADER GROUP PLC	35,000	7.186	251,510.000	
DCC PLC	3,700	60.780	224,886.000	
OCADO GROUP PLC	18,300	17.220	315,126.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,750	153.800	422,950.000	
HALMA PLC	14,200	30.680	435,656.000	
ENTAIN PLC	21,200	16.010	339,412.000	
JD SPORTS FASHION PLC	86,000	1.983	170,538.000	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	23,500	6.414	150,729.000	
M&G PLC	97,200	1.941	188,665.200	
RELX PLC	72,196	23.400	1,689,386.400	
DIAGEO PLC	86,900	39.770	3,456,013.000	
RIO TINTO PLC	41,900	48.760	2,043,044.000	
STANDARD CHARTERED PLC	97,000	4.319	418,943.000	
TESCO PLC	288,184	2.844	819,595.290	
SMITH & NEPHEW PLC	31,950	12.400	396,180.000	
GLENCORE PLC	371,725	3.683	1,369,249.030	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	13.490	178,742.500	
SMITHS GROUP PLC	14,383	15.485	222,720.750	
PEARSON PLC	28,363	6.040	171,312.520	
SAINSBURY (J) PLC	65,325	2.712	177,161.400	
NEXT PLC	4,850	77.720	376,942.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	136,200	1.673	227,930.700	
WHITBREAD PLC	7,361	27.690	203,826.090	
BUNZL PLC	12,605	28.670	361,385.350	
VODAFONE GROUP PLC	1,031,183	1.142	1,178,229.690	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,211	99.220	517,035.420	
KINGFISHER PLC	78,711	3.374	265,570.910	
WPP PLC	44,400	10.910	484,404.000	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	24,827	11.020	273,593.540	
SEVERN TRENT PLC	9,083	29.290	266,041.070	
RENTOKIL INITIAL PLC	70,300	5.350	376,105.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,700	62.300	1,663,410.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	20,250	16.150	327,037.500	
SCHRODERS PLC	4,650	34.390	159,913.500	
SSE PLC	38,800	16.090	624,292.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	36,700	7.206	264,460.200	
ASTRAZENECA PLC	57,700	85.130	4,912,001.000	
FERGUSON PLC	8,337	128.050	1,067,552.850	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	222,200	2.873	638,380.600	
3I GROUP PLC	36,200	14.240	515,488.000	
ASHTED GROUP PLC	16,700	60.320	1,007,344.000	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	8.134	326,287.270	
NATIONAL GRID PLC	134,834	10.738	1,447,847.490	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,642,465	0.461	1,219,761.840	
IMPERIAL BRANDS PLC	35,300	15.880	560,564.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	47.250	199,962.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	81,260	27.625	2,244,807.500	
BHP GROUP PLC	78,727	21.795	1,715,854.960	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,850	19.525	250,896.250	
HSBC HOLDINGS PLC	760,650	4.454	3,388,315.420	
ANGLO AMERICAN PLC	48,183	29.430	1,418,025.690	
MONDI PLC	17,600	18.165	319,704.000	
COMPASS GROUP PLC	66,539	15.565	1,035,679.530	
PERSIMMON PLC	11,900	27.470	326,893.000	
BT GROUP PLC	332,600	1.674	556,772.400	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,150	25.200	180,180.000	
BURBERRY GROUP PLC	15,139	17.450	264,175.550	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	6,836	44.750	305,911.000	
INTERTEK GROUP PLC	5,850	55.460	324,441.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,349	68.080	840,719.920	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	152,800	15.930	2,434,104.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	137,418	15.958	2,192,916.440	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	22.200	146,520.000	

	ADMIRAL GROUP PLC	7,050	31.090	219,184.500	
	ANTOFAGASTA PLC	14,100	13.695	193,099.500	
	ABRDN PLC	77,862	2.369	184,455.070	
	EXPERIAN PLC	34,454	35.130	1,210,369.020	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 67,363,660.730 (10,131,494,573)	
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	19.870	880,241.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,650	291.500	480,975.000	
	ICL GROUP LTD	28,100	29.870	839,347.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	540.000	513,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	44,100	30.800	1,358,280.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,200	31.000	1,742,200.000	
	NICE LTD	2,400	904.000	2,169,600.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,400	113.800	614,520.000		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 8,598,163.000 (311,769,390)	
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	3.380	327,860.000	
	BHP GROUP LTD	105,400	41.400	4,363,560.000	
	SOUTH32 LTD	167,500	3.900	653,250.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,850	21.900	763,215.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	60,600	18.980	1,150,188.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	117,650	28.830	3,391,849.500	
	WESTPAC BANKING CORP	131,048	21.030	2,755,939.440	
	SANTOS LTD	111,701	6.420	717,120.420	
	AUSNET SERVICES	65,000	2.530	164,450.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	102,250	27.630	2,825,167.500	
	RIO TINTO LTD	13,400	98.000	1,313,200.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	59,000	5.100	300,900.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	3.410	204,600.000	
	XERO LTD	4,750	134.270	637,782.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	31.500	248,850.000	
COLES GROUP LTD	46,845	17.480	818,850.600		
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	58.520	316,008.000		



IDP EDUCATION LTD	7,900	34.490	272,471.000	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	39,800	9.450	376,110.000	
EVOLUTION MINING LTD	65,600	3.940	258,464.000	
AFTERPAY LTD	7,900	82.670	653,093.000	
REECE LTD	10,500	24.650	258,825.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	47,300	6.920	327,316.000	
SEEK LTD	11,700	32.660	382,122.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	25,600	12.120	310,272.000	
NEWCREST MINING LTD	28,500	23.650	674,025.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	63,450	99.120	6,289,164.000	
AMPOL LTD	7,950	28.270	224,746.500	
ORICA LTD	14,900	13.690	203,981.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	51,950	11.320	588,074.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	45,300	37.660	1,705,998.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	78,263	4.880	381,923.440	
CROWN RESORTS LTD	13,400	11.100	148,740.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	4.780	145,790.000	
TELSTRA CORP LTD	150,100	4.090	613,909.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	15,650	54.440	851,986.000	
MACQUARIE GROUP LTD	12,634	205.370	2,594,644.580	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	21,130	42.580	899,715.400	
CSL LTD	16,350	272.100	4,448,835.000	
WESFARMERS LTD	40,300	58.710	2,366,013.000	
COCHLEAR LTD	2,320	207.620	481,678.400	
BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	21.050	374,690.000	
SUNCORP GROUP LTD	46,157	10.830	499,880.310	
ASX LTD	7,050	91.690	646,414.500	
COMPUTERSHARE LTD	19,600	19.640	384,944.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	86,136	4.290	369,523.440	
SONIC HEALTHCARE LTD	15,950	43.150	688,242.500	
BRAMBLES LTD	50,400	10.710	539,784.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,600	66.990	442,134.000	
REA GROUP LTD	1,800	157.720	283,896.000	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,400	29.360	129,184.000	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	116.140	255,508.000	

オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル	
				51,024,888.030	
				(4,129,444,189)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	30,200	47.850	1,445,070.000	
	IMPERIAL OIL LTD	9,100	42.410	385,931.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	2,230.690	1,561,483.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	10,587	74.160	785,131.920	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,600	53.100	881,460.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,450	162.880	1,050,576.000	
	BCE INC	4,930	65.690	323,851.700	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,100	172.200	1,222,620.000	
	SUNCOR ENERGY INC	54,230	29.900	1,621,477.000	
	METRO INC/CN	9,100	67.640	615,524.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	12,400	96.800	1,200,320.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	44,800	87.290	3,910,592.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	16,650	145.000	2,414,250.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	67,200	94.120	6,324,864.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	9,800	37.390	366,422.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	52,450	130.980	6,869,901.000	
	TOURMALINE OIL CORP	11,500	39.470	453,905.000	
	TC ENERGY CORP	36,250	58.710	2,128,237.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	19,729	38.040	750,491.160	
	BARRICK GOLD CORP	65,500	23.720	1,553,660.000	
	CAE INC	11,700	31.040	363,168.000	
	THOMSON REUTERS CORP	6,412	148.090	949,553.080	
	EMPIRE CO LTD 'A'	5,900	39.860	235,174.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	112.430	393,505.000	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	9,000	16.670	150,030.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,450	67.420	367,439.000	
	HYDRO ONE LTD	12,200	32.270	393,694.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	6,260	103.540	648,160.400	
	NORTHLAND POWER INC	7,900	37.640	297,356.000	
	WSP GLOBAL INC	4,300	178.350	766,905.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,100	111.070	344,317.000	
	PARKLAND CORP	5,100	33.790	172,329.000	
	QUEBECOR INC -CL B	6,000	28.090	168,540.000	

EMERA INC	9,500	62.810	596,695.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,100	136.480	423,088.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	36.510	175,248.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,700	58.970	748,919.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	9.560	215,100.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,700	65.010	565,587.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	24,800	17.950	445,160.000	
AIR CANADA	6,500	20.120	130,780.000	
KINROSS GOLD CORP	46,500	7.160	332,940.000	
BANK OF MONTREAL	23,800	134.110	3,191,818.000	
POWER CORP OF CANADA	20,100	42.790	860,079.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,200	1,705.370	7,162,554.000	
NUTRIEN LTD	21,119	91.260	1,927,319.940	
CANOPY GROWTH CORP	8,400	12.380	103,992.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,600	51.350	492,960.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,700	46.900	220,430.000	
CAMECO CORP	14,800	27.250	403,300.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	244.090	366,135.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	45.640	296,660.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	3,900	52.060	203,034.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,100	70.490	148,029.000	
TELUS CORP	10,800	29.550	319,140.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,000	34.750	590,750.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	178.300	392,260.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	43,700	49.900	2,180,630.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	583.530	583,530.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,500	99.680	1,046,640.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,737	147.820	404,583.340	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	31.450	245,310.000	
BLACKBERRY LTD	19,400	11.780	228,532.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,600	69.140	1,493,424.000	
ENBRIDGE INC	74,700	47.650	3,559,455.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	52,025	73.830	3,841,005.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,500	23.430	1,675,245.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	32.000	361,600.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,600	93.400	2,297,640.000	

	IA FINANCIAL CORP INC	4,100	71.110	291,551.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	51.810	388,575.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	26,150	164.120	4,291,738.000	
	CGI INC - CLASS A	7,900	109.500	865,050.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	95.220	276,138.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,700	37.450	625,415.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	46.420	143,902.000	
	TMX GROUP LTD	2,100	124.770	262,017.000	
	OPEN TEXT CORP	9,900	59.530	589,347.000	
	SAPUTO INC	8,700	28.340	246,558.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	21,700	27.130	588,721.000	
	FORTIS INC	17,400	60.510	1,052,874.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,100	80.720	330,952.000	
	LUNDIN MINING CORP	24,600	10.670	262,482.000	
	CENOVUS ENERGY INC	48,300	14.520	701,316.000	
	DOLLARAMA INC	10,700	62.070	664,149.000	
	ALTAGAS LTD	10,300	26.920	277,276.000	
	KEYERA CORP	8,200	28.040	229,928.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 91,433,499.790 (8,062,606,012)	
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	46,400	26.950	1,250,480.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,100	32.440	2,306,484.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	48,475	4.870	236,073.250	
	KEPPEL CORP LTD	56,300	5.130	288,819.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	7.020	120,042.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	6.780	109,158.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	132,300	11.370	1,504,251.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.770	183,260.000	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.450	182,655.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	328,150	2.370	777,715.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	56,500	3.720	210,180.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	31,500	9.220	290,430.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,400	4.080	303,552.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル	

				8,108,187.750	
				(674,276,894)	
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	16.145	2,108,537.000	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	403.400	476,012.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	1,009.000	282,520.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,700	44.540	253,878.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	25,650	378.900	9,718,785.000	
	SIKA AG-REG	5,200	369.500	1,921,400.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	119,200.000	476,800.000	
	ABB LTD-REG	62,700	34.140	2,140,578.000	
	SWISS RE AG	11,050	89.660	990,743.000	
	NESTLE SA-REG	102,700	127.340	13,077,818.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	800	1,466.000	1,172,800.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,500	241.400	362,100.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	96,920	8.692	842,428.640	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,000	58.740	469,920.000	
	SGS SA-REG	210	2,968.000	623,280.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	238.800	164,772.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,750	159.700	279,475.000	
	TEMENOS AG - REG	2,500	127.950	319,875.000	
	VAT GROUP AG	1,050	431.600	453,180.000	
	ALCON INC	18,300	78.060	1,428,498.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,090	270.600	294,954.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,522	391.800	2,163,519.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,700	143.900	244,630.000	
	CLARIANT AG-REG	7,700	18.830	144,991.000	
	NOVARTIS AG-REG	80,050	79.800	6,387,990.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	120	2,176.000	261,120.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	250	630.000	157,500.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	19,100	131.300	2,507,830.000	
	SWISSCOM AG-REG	900	518.000	466,200.000	
	GEBERIT AG-REG	1,300	717.000	932,100.000	
	GIVAUDAN-REG	330	4,770.000	1,574,100.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	380	1,821.000	691,980.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,992	339.500	676,284.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,200	76.600	474,920.000	

	LONZA GROUP AG-REG	2,690	748.000	2,012,120.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	51.800	98,420.000	
	HOLCIM LTD	19,090	44.990	858,859.100	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,160	554.800	643,568.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,020	277.700	560,954.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,700	88.750	239,625.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	11,970.000	406,980.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 59,362,044.340 (7,302,718,694)	
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	
	SAGAX CLASS B	6,500	304.000	1,976,000.000	
	INVESTOR CLASS A	20,000	224.400	4,488,000.000	
	ICA GRUPPEN AB	3,870	534.000	2,066,580.000	
	ERICSSON LM-B SHS	112,830	96.960	10,939,996.800	
	VOLVO AB-B SHS	55,650	198.200	11,029,830.000	
	SKF AB-B SHARES	14,400	208.300	2,999,520.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	212.300	1,825,780.000	
	SWEDISH MATCH AB	61,300	69.000	4,229,700.000	
	TELE2 AB-B SHS	18,800	122.800	2,308,640.000	
	GETINGE AB-B SHS	9,200	374.300	3,443,560.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	63,600	123.100	7,829,160.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	57,150	93.560	5,346,954.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	35,500	177.000	6,283,500.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	168.200	4,743,240.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	22,900	156.050	3,573,545.000	
	SKANSKA AB-B SHS	12,850	222.200	2,855,270.000	
	SANDVIK AB	44,000	236.100	10,388,400.000	
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	216.700	15,494,050.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	26,150	592.200	15,486,030.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	198.700	1,589,600.000	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	120.750	1,442,962.500	
	TELIA CO AB	100,200	35.070	3,514,014.000	
	ALFA LAVAL AB	11,900	341.800	4,067,420.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,900	501.000	7,464,900.000	
	ASSA ABLOY AB-B	38,750	266.000	10,307,500.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	275.800	1,446,019.400	

	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,000	647.200	2,588,800.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	480.800	1,442,400.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	336.300	1,916,910.000	
	LIFCO AB-B SHS	9,500	243.500	2,313,250.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	54,300	124.300	6,749,490.000	
	LUNDIN ENERGY AB	7,550	364.000	2,748,200.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,900	290.000	6,931,000.000	
	EMBRACER GROUP AB	20,000	86.000	1,720,000.000	
	BOLIDEN AB	10,400	343.700	3,574,480.000	
	EPIROC AB-A	25,950	218.900	5,680,455.000	
	EPIROC AB-B	14,800	185.150	2,740,220.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,850	139.250	2,207,112.500	
	NORDEA BANK ABP	127,800	105.260	13,452,228.000	
	EQT AB	11,600	501.800	5,820,880.000	
	EVOLUTION AB	6,750	1,171.000	7,904,250.000	
	SINCH AB	19,400	102.350	1,985,590.000	
	KINNEVIK AB - B	9,300	302.000	2,808,600.000	
	HEXAGON AB-B SHS	76,400	134.050	10,241,420.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	267.800	1,660,360.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 231,625,817.200 (2,879,108,908)	
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	65,200	764.900	49,871,480.000	
	DANSKE BANK A/S	26,000	108.300	2,815,800.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	120	20,240.000	2,428,800.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,650	194.200	7,505,830.000	
	GN STORE NORD A/S	4,850	400.200	1,940,970.000	
	CARLSBERG AS-B	3,900	1,089.000	4,247,100.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,850	522.800	4,103,980.000	
	COLOPLAST-B	4,700	1,097.500	5,158,250.000	
	DSV PANALPINA A/S	8,030	1,429.000	11,474,870.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	2,775.000	832,500.000	
	DEMANT A/S	4,275	312.000	1,333,800.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	21,890.000	5,034,700.000	
	TRYG A/S	14,100	160.050	2,256,705.000	
	PANDORA A/S	4,000	768.600	3,074,400.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,050	508.400	2,059,020.000	

	GENMAB A/S	2,520	2,470.000	6,224,400.000	
	ORSTED A/S	7,400	830.000	6,142,000.000	
	AMBU A/S-B	6,300	162.500	1,023,750.000	
デンマーク・クロネ 小計				デンマーク・クロネ 117,528,355.000 (2,020,312,423)	
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	4.845	230,137.500	
	MERCURY NZ LTD	26,000	6.100	158,600.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	72,789	4.490	326,822.610	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	48,300	7.470	360,801.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,200	31.270	725,464.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	16,500	12.490	206,085.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,007,910.110 (153,665,361)	
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	193.900	7,125,825.000	
	NORSK HYDRO ASA	50,700	65.860	3,339,102.000	
	ORKLA ASA	29,050	85.720	2,490,166.000	
	TELENOR ASA	27,800	137.400	3,819,720.000	
	EQUINOR ASA	38,223	236.100	9,024,450.300	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	340.400	953,120.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	448.700	2,988,342.000	
	MOWI ASA	16,600	206.000	3,419,600.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	212.000	1,558,200.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,650	296.200	1,081,130.000	
	AKER BP ASA	4,900	295.200	1,446,480.000	
	ADEVINTA ASA	10,600	116.650	1,236,490.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 38,482,625.300 (483,341,774)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	27,891	24.805	691,836.250	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	15,675	31.400	492,195.000	
	BAYER AG-REG	36,020	46.525	1,675,830.500	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,000	28.010	196,070.000	



DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	73,900	10.930	807,727.000	
COMMERZBANK AG	32,935	6.368	209,730.080	
VOLKSWAGEN AG	1,110	265.000	294,150.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	6,800	176.020	1,196,936.000	
SIEMENS AG-REG	28,050	147.900	4,148,595.000	
E.ON SE	82,300	11.776	969,164.800	
UNIPER SE	6,650	40.910	272,051.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,150	86.920	1,056,078.000	
GEA GROUP AG	5,050	46.150	233,057.500	
CONTINENTAL AG	3,960	91.310	361,587.600	
BASF SE	33,670	60.190	2,026,597.300	
ALLIANZ SE-REG	15,090	204.700	3,088,923.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,400	70.640	452,096.000	
RWE AG	23,700	34.940	828,078.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	5.965	130,931.750	
BRENNTAG SE	5,700	75.920	432,744.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,800	34.545	511,266.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	35.200	116,864.000	
SAP SE	38,242	123.520	4,723,651.840	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,040	258.000	1,300,320.000	
ZALANDO SE	8,150	69.800	568,870.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,350	58.960	315,436.000	
KION GROUP AG	2,400	94.480	226,752.000	
COVESTRO AG	6,700	51.960	348,132.000	
RATIONAL AG	190	869.000	165,110.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	566.000	684,860.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,650	84.020	474,713.000	
DELIVERY HERO SE	5,800	91.600	531,280.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,400	184.350	258,090.000	
BECHTLE AG	2,850	62.000	176,700.000	
NEMETSCHEK SE	2,000	107.850	215,700.000	
SCOUT24 AG	3,600	60.780	218,808.000	
AROUNDTOWN SA	32,500	5.318	172,835.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,100	63.960	645,996.000	
KNORR-BREMSE AG	2,500	87.340	218,350.000	
HELLOFRESH SE	6,050	68.600	415,030.000	
SIEMENS ENERGY AG	14,325	22.430	321,309.750	
BEIERSDORF AG	3,610	89.700	323,817.000	

FUCHS PETROLUB PREF	2,350	39.140	91,979.000	
MERCK KGAA	4,750	219.800	1,044,050.000	
ADIDAS AG	7,010	252.700	1,771,427.000	
PUMA SE	3,860	103.050	397,773.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,750	67.750	254,062.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	122,200	16.050	1,961,310.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,220	54.340	392,334.800	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	31,350	68.750	2,155,312.500	
QIAGEN N.V.	8,398	48.710	409,066.580	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	47,900	38.905	1,863,549.500	
HANNOVER RUECK SE	2,200	165.600	364,320.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	36,300	53.700	1,949,310.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,010	142.550	999,275.500	
LANXESS AG	2,800	52.780	147,784.000	
MTU AERO ENGINES AG	2,000	169.400	338,800.000	
SYMRISE AG	4,750	128.900	612,275.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.460	83,148.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,950	70.900	138,255.000	
VONOVIA SE	27,100	48.900	1,325,190.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,550	123.150	314,032.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	33,610	31.355	1,053,841.550	
NN GROUP NV	9,900	46.120	456,588.000	
ARCELORMITTAL	25,700	28.690	737,333.000	
HEINEKEN NV	9,500	97.440	925,680.000	
AEGON NV	64,244	4.138	265,841.670	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,333	30.010	1,150,373.330	
AKZO NOBEL N.V.	6,768	94.200	637,545.600	
KONINKLIJKE DSM NV	6,400	193.000	1,235,200.000	
WOLTERS KLUWER	9,800	100.950	989,310.000	
ING GROEP NV	143,100	11.924	1,706,324.400	
KONINKLIJKE KPN NV	121,150	2.691	326,014.650	
ASML HOLDING NV	15,110	662.000	10,002,820.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,150	12.428	188,284.200	
IMCD NV	2,100	188.250	395,325.000	
ADYEN NV	720	2,175.000	1,566,000.000	

JUST EAT TAKEAWAY	6,450	47.850	308,632.500	
PROSUS NV	34,230	69.420	2,376,246.600	
JDE PEET'S NV	3,700	26.210	96,977.000	
INPOST SA	7,000	9.705	67,935.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,700	361.500	614,550.000	
RANDSTAD NV	4,300	57.020	245,186.000	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	80.000	340,000.000	
TOTALENERGIES SE	91,850	43.660	4,010,171.000	
MICHELIN (CGDE)	6,250	138.400	865,000.000	
AIR LIQUIDE SA	17,377	152.800	2,655,205.600	
KERING	2,700	689.800	1,862,460.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19,850	165.680	3,288,748.000	
BOUYGUES SA	8,200	30.720	251,904.000	
BNP PARIBAS	41,250	56.170	2,317,012.500	
THALES SA	3,850	72.540	279,279.000	
DANONE	24,000	54.620	1,310,880.000	
CARREFOUR SA	23,100	15.590	360,129.000	
SUEZ	12,625	19.805	250,038.120	
VIVENDI	27,891	11.285	314,749.930	
L'OREAL	9,200	413.050	3,800,060.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	18,500	58.560	1,083,360.000	
LEGRAND SA	9,817	100.450	986,117.650	
PERNOD RICARD SA	7,707	209.500	1,614,616.500	
EURAZEO SE	1,254	73.350	91,980.900	
SOCIETE GENERALE SA	29,800	28.670	854,366.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	10,160	699.000	7,101,840.000	
ACCOR SA	6,150	26.420	162,483.000	
CAPGEMINI SE	5,900	204.800	1,208,320.000	
VALEO SA	8,400	26.000	218,400.000	
PUBLICIS GROUPE	8,000	56.860	454,880.000	
BUREAU VERITAS SA	10,600	28.130	298,178.000	
EIFFAGE	3,040	85.280	259,251.200	
SODEXO SA	3,200	74.280	237,696.000	
IPSEN	1,400	85.860	120,204.000	
ORPEA	1,800	86.640	155,952.000	
AMUNDI SA	2,250	70.250	158,062.500	
TELEPERFORMANCE	2,170	373.600	810,712.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	42.230	126,690.000	

EURONEXT NV	3,300	88.250	291,225.000	
FAURECIA	4,307	39.150	168,619.050	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,750	106.480	505,780.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	456.000	456,000.000	
SEB SA	997	137.600	137,187.200	
ESSILORLUXOTTICA	10,550	180.360	1,902,798.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	91.650	91,650.000	
WORLDLINE SA	8,514	49.120	418,207.680	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,500	37.300	130,550.000	
AXA SA	71,000	25.380	1,801,980.000	
EDENRED	8,850	39.600	350,460.000	
RENAULT SA	7,050	29.120	205,296.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,160	1,525.000	1,769,000.000	
STMICROELECTRONICS NV	25,200	41.370	1,042,524.000	
REMY COINTREAU	750	209.600	157,200.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	24,350	51.730	1,259,625.500	
WENDEL	930	100.600	93,558.000	
ORANGE	71,400	9.305	664,377.000	
ALSTOM	11,400	29.090	331,626.000	
CNP ASSURANCES	5,850	21.660	126,711.000	
SANOFI	41,725	86.890	3,625,485.250	
VINCI SA	19,700	86.620	1,706,414.000	
AIRBUS SE	21,650	104.140	2,254,631.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,000	31.540	756,960.000	
CREDIT AGRICOLE SA	45,300	12.006	543,871.800	
BIOMERIEUX	1,520	122.100	185,592.000	
ENGIE	67,023	12.958	868,484.030	
EDF	20,250	9.926	201,001.500	
SAFRAN SA	12,600	101.240	1,275,624.000	
ARKEMA	2,220	120.200	266,844.000	
ADP	1,110	108.050	119,935.500	
GETLINK SE	16,200	13.575	219,915.000	
BOLLORE	32,400	4.402	142,624.800	
UCB SA	4,530	97.720	442,671.600	
KBC GROUP NV	9,250	72.940	674,695.000	
COLRUYT SA	2,000	38.180	76,360.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	95.500	382,000.000	
SOLVAY SA	2,600	98.920	257,192.000	
UMICORE	7,000	35.500	248,500.000	

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	28,050	53.160	1,491,138.000	
AGEAS	6,290	44.000	276,760.000	
PROXIMUS	4,950	17.715	87,689.250	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	117.000	122,850.000	
SOFINA	600	429.800	257,880.000	
ARGENX SE	1,710	276.700	473,157.000	
PRYSMIAN SPA	9,400	31.570	296,758.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	40,643	18.495	751,692.280	
MEDIOBANCA SPA	22,365	10.035	224,432.770	
TENARIS SA	17,500	9.028	157,990.000	
UNICREDIT SPA	78,156	13.122	1,025,563.030	
TELECOM ITALIA SPA	343,982	0.439	151,283.280	
INTESA SANPAOLO	606,537	2.205	1,337,717.350	
ATLANTIA SPA	18,257	17.360	316,941.520	
POSTE ITALIANE SPA	19,200	11.225	215,520.000	
MONCLER SPA	7,400	63.220	467,828.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,850	55.520	213,752.000	
ENI SPA	92,600	12.052	1,116,015.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	12.650	246,675.000	
DIASORIN SPA	850	158.850	135,022.500	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,200	10.445	116,984.000	
NEXI SPA	17,250	13.955	240,723.750	
AMPLIFON SPA	4,300	44.080	189,544.000	
ENEL SPA	298,134	6.746	2,011,211.960	
SNAM SPA	74,000	5.166	382,284.000	
TERNA SPA	51,800	7.016	363,428.800	
EXOR NV	4,030	77.100	310,713.000	
CNH INDUSTRIAL NV	37,600	15.885	597,276.000	
FINECOBANK SPA	21,900	15.180	332,442.000	
STELLANTIS NV	74,700	16.414	1,226,125.800	
FERRARI NV	4,645	227.300	1,055,808.500	
TELEFONICA SA	186,727	3.855	719,925.940	
ENDESA SA	10,350	19.665	203,532.750	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	244,500	4.997	1,221,888.750	
IBERDROLA SA	211,934	9.748	2,065,932.630	
REPSOL SA	53,400	9.943	530,956.200	
GRIFOLS SA	9,800	16.500	161,700.000	

BANCO SANTANDER SA	634,950	2.775	1,761,986.250	
AMADEUS IT GROUP SA	16,050	55.660	893,343.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.850	276,555.000	
CAIXABANK SA	160,500	2.283	366,421.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	21.750	193,053.000	
AENA SME SA	2,600	132.850	345,410.000	
CELLNEX TELECOM SA	18,805	48.800	917,684.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	40,000	27.810	1,112,400.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,500	20.750	176,375.000	
ENAGAS SA	7,950	19.880	158,046.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	18.750	294,375.000	
FERROVIAL SA	17,670	25.690	453,942.300	
UPM-KYMMENE OYJ	19,150	32.150	615,672.500	
NOKIA OYJ	197,800	5.397	1,067,526.600	
WARTSILA OYJ ABP	17,000	11.595	197,115.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	15.540	332,556.000	
ELISA OYJ	5,100	53.660	273,666.000	
SAMPO OYJ-A SHS	18,400	43.560	801,504.000	
FORTUM OYJ	15,900	26.840	426,756.000	
KESKO OYJ-B SHS	9,800	29.560	289,688.000	
KONE OYJ-B	12,550	61.880	776,594.000	
NESTE OYJ	15,600	43.400	677,040.000	
ORION OYJ-CLASS B	3,600	35.680	128,448.000	
VERBUND AG	2,430	97.400	236,682.000	
OMV AG	5,300	49.450	262,085.000	
ERSTE GROUP BANK AG	12,800	39.230	502,144.000	
VOESTALPINE AG	4,250	31.700	134,725.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	5,250	25.500	133,875.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,600	46.840	402,824.000	
KINGSPAN GROUP PLC	5,700	98.160	559,512.000	
JERONIMO MARTINS	10,500	20.160	211,680.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	102,700	4.740	486,798.000	
GALP ENERGIA SGPS SA	16,750	8.416	140,968.000	
EDP RENOVAVEIS SA	11,000	21.600	237,600.000	
KERRY GROUP PLC-A	5,900	114.000	672,600.000	
CRH PLC	28,800	44.760	1,289,088.000	

	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,030	131.500	792,945.000	
ユーロ 小計				ユーロ 178,156,282.470 (22,768,372,900)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,500	48.400	2,541,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	39.100	3,245,300.000	
	MTR CORP	58,500	40.800	2,386,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,000	93.600	4,773,600.000	
	SINO LAND CO	126,000	9.410	1,185,660.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	104,669	49.850	5,217,749.650	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	43.450	803,825.000	
	CLP HOLDINGS LTD	64,500	77.000	4,966,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	55,507	32.550	1,806,752.850	
	HONG KONG & CHINA GAS	438,475	11.900	5,217,852.500	
	HANG SENG BANK LTD	30,000	143.800	4,314,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	58,500	30.100	1,760,850.000	
	WH GROUP LTD	361,000	4.880	1,761,680.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,800	453.000	21,200,400.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	15.540	1,212,120.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	69,000	18.900	1,304,100.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	19.160	862,200.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	47.250	4,307,735.250	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	23,500	47.250	1,110,375.000	
	AIA GROUP LTD	471,400	79.650	37,547,010.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	30.050	1,622,700.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,000	39.850	2,510,550.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	21.350	1,449,665.000	
	ESR CAYMAN LTD	75,000	27.350	2,051,250.000	
	SANDS CHINA LTD	92,800	16.560	1,536,768.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	13.740	1,126,680.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	53,000	156.400	8,289,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	141,500	24.900	3,523,350.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル	

			129,635,673.250	
			(1,887,495,402)	
合計			233,939,162,230	
			[233,939,162,230]	

## (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	5,237	1,280,603.610	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,357	1,862,570.610	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,470	624,674.000	
		VORNADO REALTY TRUST	5,897	240,420.690	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,120	1,548,625.600	
		EQUITY RESIDENTIAL	13,350	1,170,127.500	
		EQUINIX INC	3,388	2,785,816.880	
		AMERICAN TOWER CORP	16,950	4,726,677.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,743	420,132.530	
		INVITATION HOMES INC	21,650	928,785.000	
		VICI PROPERTIES INC	23,000	635,260.000	
		VENTAS INC	14,800	732,600.000	
		WEYERHAEUSER CO	28,214	1,118,402.960	
		AGNC INVESTMENT CORP	19,600	293,804.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	16,200	3,261,708.000	
		IRON MOUNTAIN INC	10,810	554,012.500	
		SUN COMMUNITIES INC	4,350	861,648.000	
		PROLOGIS INC	27,552	4,440,831.360	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,450	1,173,766.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,800	652,118.000	
		DUKE REALTY CORP	14,250	884,782.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,400	820,224.000	
		WELLTOWER INC	15,850	1,318,720.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,400	712,368.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	935,595.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,500	545,350.000			
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	54,000	428,220.000			
REALTY INCOME CORP	20,645	1,399,318.100			
PUBLIC STORAGE	5,920	2,141,500.800			
REGENCY CENTERS CORP	5,700	407,835.000			
UDR INC	11,150	646,254.000			
WP CAREY INC	6,900	552,552.000			



	DIGITAL REALTY TRUST INC	10,650	1,826,901.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,050	1,086,507.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	22,500	501,075.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 43,519,787.640 (4,944,718,271)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,262	197,280.140	
	SEGRO PLC	44,700	618,871.500	
	BRITISH LAND CO PLC	32,850	170,491.500	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 986,643.140 (148,391,128)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	38,550	430,218.000	
	LENDLEASE GROUP	23,500	247,455.000	
	TRANSURBAN GROUP	110,000	1,488,300.000	
	SYDNEY AIRPORT	45,800	392,506.000	
	APA GROUP	41,400	408,204.000	
	SCENTRE GROUP	181,922	558,500.540	
	GPT GROUP	68,160	360,566.400	
	MIRVAC GROUP	136,100	397,412.000	
	STOCKLAND	83,800	372,072.000	
	GOODMAN GROUP	59,500	1,562,470.000	
	VICINITY CENTRES	137,273	235,423.190	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 6,453,127.130 (522,251,578)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,900	169,795.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	130,558.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 300,353.000 (26,485,127)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	124,500	363,540.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	190,870	377,922.600	

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	114,300	212,598.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77,500	155,775.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,109,835.600 (92,293,928)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	266,248.000	ユーロ
	GECINA SA	1,600	192,880.000	
	KLEPIERRE	7,150	140,354.500	
	COVIVIO	1,750	122,255.000	
ユーロ 小計			ユーロ 721,737.500 (92,238,052)	
香港・ドル	LINK REIT	81,500	5,440,125.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	700,120.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138,000	1,435,200.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 7,575,445.000 (110,298,480)	
投資証券 合計			5,936,676,564 [5,936,676,564]	
合計			5,936,676,564 [5,936,676,564]	

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 607銘柄	97.2%	2.8%	74.4%
	投資証券 35銘柄			
イギリス・ポンド	株式 81銘柄	98.6%	1.4%	4.3%
	投資証券 3銘柄			
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	88.8%	11.2%	1.9%
	投資証券 11銘柄			

カナダ・ドル	株式	87銘柄	99.7%	0.3%	3.4%
	投資証券	2銘柄			
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	88.0%	12.0%	0.3%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	41銘柄	100%	-%	3.0%
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	100%	-%	1.2%
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	6銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	228銘柄	99.6%	0.4%	9.5%
	投資証券	4銘柄			
香港・ドル	株式	28銘柄	94.5%	5.5%	0.8%
	投資証券	3銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### 「ダイワ」- R E I T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12月18日現在	2021年12月20日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,159,458,670	9,771,002,648
投資証券	2 359,920,911,700	434,362,900,300
派生商品評価勘定	127,513,090	-
未収入金	-	670,746,903
未収配当金	1,944,947,366	1,815,317,726
流動資産合計	369,152,830,826	446,619,967,577
資産合計	369,152,830,826	446,619,967,577
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	-	20,216,000
前受金	217,186,600	260,400,000
未払金	117,859,215	-
未払解約金	29,844,564	786,411,000
流動負債合計	364,890,379	1,067,027,000
負債合計	364,890,379	1,067,027,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	134,624,414,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		234,163,526,313
元本等合計		368,787,940,447
純資産合計		368,787,940,447
負債純資産合計		369,152,830,826
		446,619,967,577

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首	2019年12月19日	2020年12月19日
期首元本額	112,579,310,877円	134,624,414,134円
期中追加設定元本額	49,045,204,059円	26,273,264,912円
期中一部解約元本額	27,000,100,802円	27,695,390,084円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	5,775,421,582円	4,801,166,661円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	118,214,001,589円	116,999,358,707円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	358,472,846円	334,201,598円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,383,988円	9,585,118円
iFree J-REITイ ンデックス	168,835,511円	579,105,948円
iFree 8資産バランス	1,132,230,418円	1,364,256,461円
DC・ダイワJ-REIT オープン	5,343,826,156円	5,294,129,212円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,840,218円	6,014,642円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,047,039円	4,982,317円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	95,850,900円	97,243,674円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,717,269,132円	1,875,255,140円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	282,971,153円	369,231,583円
ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	448,996,578円	515,120,244円
ダイワ・インデックスセレク ト J-REIT	1,077,267,024円	952,637,657円
計	134,624,414,134円	133,202,288,962円

2.	期末日における受益権の総数	134,624,414,134口	133,202,288,962口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 4,747,650,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,586,350,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	29,510,330	19,941,072,010
合計	29,510,330	19,941,072,010

（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16日から2020年12月18日まで、及び2021年9月16日から2021年12月20日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2020年12月18日 現在				2021年12月20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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	8,742,302,900	-	8,870,392,500	128,089,600	11,208,400,000	-	11,188,800,000	19,600,000
合計	8,742,302,900	-	8,870,392,500	128,089,600	11,208,400,000	-	11,188,800,000	19,600,000

## （注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## （1口当たり情報）

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,7394円 (27,394円)	3,3449円 (33,449円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	7,882	1,094,809,800	
	サンケイリアルエステート	12,398	1,419,571,000	
	SOSILA物流リート投	18,209	3,044,544,800	
	東海道リート投資法	2,998	319,287,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	13,516	8,663,756,000	
	森ヒルズリート	46,030	7,051,796,000	
	産業ファンド	55,571	12,020,007,300	
	アドバンス・レジデンス	39,138	14,207,094,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	26,735	5,809,515,500	
	A P I 投資法人	20,862	8,511,696,000	
	G L P 投資法人	126,777	24,632,771,100	
	コンフォリア・レジデンシャル	17,625	5,807,437,500	
	日本プロロジスリート	64,040	25,007,620,000	
	星野リゾート・リート	6,560	4,185,280,000	
	ONEリート投資法人	6,793	2,002,576,400	
	イオンリート投資	46,034	7,080,029,200	
	ヒューリックリート投資法	36,517	6,138,507,700	
	日本リート投資法人	12,079	5,109,417,000	
	積水ハウス・リート投資	118,818	9,992,593,800	
	トーセイ・リート投資法人	8,179	1,058,362,600	
ケネディクス商業リート	15,629	4,287,034,700		
ヘルスケア&メディカル投資	8,349	1,308,288,300		



サムティ・レジデンシャル	8,867	1,098,621,300	
野村不動産マスターF	126,582	20,291,094,600	
いちごホテルリート投資	6,485	500,642,000	
ラサールロジポート投資	47,919	9,406,499,700	
スターアジア不動産投	40,452	2,499,933,600	
マリモ地方創生リート	3,667	498,345,300	
三井不ロジパーク	14,550	8,991,900,000	
大江戸温泉リート	6,318	454,896,000	
投資法人みらい	44,624	2,162,032,800	
森トラスト・ホテルリート投	9,184	1,120,448,000	
三菱地所物流REIT	9,948	5,033,688,000	
CREロジスティクスファンド	15,160	3,174,504,000	
ザイマックス・リート	5,682	638,656,800	
タカラレーベン不動産投	15,436	1,750,442,400	
伊藤忠アドバンスロジ	15,263	2,591,657,400	
日本ビルファンド	44,362	30,077,436,000	
ジャパンリアルエステイト	39,144	25,287,024,000	
日本都市ファンド投資法人	197,501	19,197,097,200	
オリックス不動産投資	77,993	14,155,729,500	
日本プライムリアルティ	25,725	10,277,137,500	
NTT都市開発リート投資法人	37,521	5,586,876,900	
東急リアル・エステート	26,244	5,075,589,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	27,181	3,199,203,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	88,119	12,028,243,500	
森トラスト総合リート	27,976	4,006,163,200	
インヴィンシブル投資法人	172,287	5,995,587,600	
フロンティア不動産投資	13,722	6,799,251,000	
平和不動産リート	25,358	3,867,095,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	25,576	8,785,356,000	
福岡リート投資法人	20,244	3,313,942,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,109	8,391,537,000	
いちごオフィスリート投資法人	32,074	2,556,297,800	
大和証券オフィス投資法人	8,276	5,735,268,000	
阪急阪神リート投資法人	17,681	2,770,612,700	
スターツプロシード投資法人	6,096	1,410,004,800	
大和ハウスリート投資法人	58,774	19,689,290,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	119,919	6,319,731,300	
大和証券リビング投資法人	52,892	6,034,977,200	
ジャパンエクセレント投資法人	36,322	4,838,090,400	
投資証券 合計		434,362,900,300	

合計		434,362,900,300	
----	--	-----------------	--

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	32,249,255	77,178,682
コール・ローン	287,304,645	561,581,827
投資信託受益証券	335,607,908	634,794,940
投資証券	28,605,415,077	48,297,799,583
派生商品評価勘定	20,119,610	1,705,031
未収入金	810,267	319,970,945
未収配当金	63,943,846	118,771,009
差入委託証拠金	274,955,056	415,715,725
流動資産合計	29,620,405,664	50,427,517,742
資産合計	29,620,405,664	50,427,517,742
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	946,014	4,435,561
未払金	216,385	271,117,852
未払解約金	7,145,747	21,376,000

流動負債合計		8,308,146	296,929,413
負債合計		8,308,146	296,929,413
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,140,962,393	15,690,434,259
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		16,471,135,125	34,440,154,070
元本等合計		29,612,097,518	50,130,588,329
純資産合計		29,612,097,518	50,130,588,329
負債純資産合計		29,620,405,664	50,427,517,742

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首	2019年12月19日	2020年12月19日
期首元本額	10,727,508,018円	13,140,962,393円
期中追加設定元本額	4,963,535,148円	5,773,494,898円
期中一部解約元本額	2,550,080,773円	3,224,023,032円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	6,083,924,762円	6,295,948,752円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	1,090,872,679円	1,143,714,741円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	364,662,168円	336,507,070円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	269,730,117円	287,027,419円
D-I's グローバルREIT インデックス	2,053,952円	1,920,281円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,717,692円	8,727,395円
iFree 外国REITイ ンデックス	154,564,575円	650,467,941円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,406,288,160円	1,462,383,857円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	63,466,632円	251,617,852円
26,171,817円		116,348,191円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,711,342,114円	3,355,252,225円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,008,777円	6,384,178円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,760,732円	5,332,616円

ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	228,872,981円	168,184,947円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	-円	181,663,633円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	251,701,437円	243,525,692円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	54,131,802円	61,679,527円
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	216,762,068円	1,109,755,007円
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	204,929,928円	3,992,935円
計	13,140,962,393円	15,690,434,259円
2. 期末日における受益権の総数	13,140,962,393口	15,690,434,259口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20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)における不動産投信指数先物取引を利用してあります。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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	4,541,375	10,735,011
投資証券	602,440,063	678,764,407
合計	606,981,438	689,499,418

(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12月1日から2020年12月18日まで、及び2021年12月1日から2021年12月20日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種 類	2020年12月18日 現在				2021年12月20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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	633,013,206	-	651,108,773	18,095,567	1,155,924,678	-	1,152,061,055	3,863,623
合計	633,013,206	-	651,108,773	18,095,567	1,155,924,678	-	1,152,061,055	3,863,623

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2020年12月18日 現在				2021年12月20日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	47,975,647	-	48,038,172	62,525
アメリカ・ドル	-	-	-	-	36,319,680	-	36,356,960	37,280
ユーロ	-	-	-	-	11,655,967	-	11,681,212	25,245
買 建	282,479,671	-	283,557,700	1,078,029	564,008,057	-	565,203,675	1,195,618
アメリカ・ドル	113,423,030	-	112,477,100	945,930	430,232,799	-	431,794,280	1,561,481
イギリス・ポ ンド	-	-	-	-	2,102,094	-	2,105,573	3,479
オーストラ リア・ドル	14,099,649	-	14,146,200	46,551	17,776,847	-	17,796,287	19,440



カナダ・ドル	-	-	-	-	2,078,046	-	2,081,017	2,971
ユーロ	154,956,992	-	156,934,400	1,977,408	109,054,568	-	108,660,175	394,393
香港・ドル	-	-	-	-	2,763,703	-	2,766,343	2,640
合計	282,479,671	-	283,557,700	1,078,029	611,983,704	-	613,241,847	1,133,093

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	2.2534円	3.1950円
(1万口当たり純資産額)	(22,534円)	(31,950円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	50,000.000	5,587,000.000	
		小計		アメリカ・ドル	

				5,587,000.000	
				(634,794,940)	
投資信託受益証券 合計				634,794,940	
				[634,794,940]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	34,396	697,550.880	
		URBAN EDGE PROPERTIES	28,682	508,818.680	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	28,800	482,688.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,141	8,837,558.730	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	84,989	12,810,391.970	
		BOSTON PROPERTIES INC	36,764	4,198,448.800	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	39,288	295,052.880	
		VORNADO REALTY TRUST	41,121	1,676,503.170	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	22,278	496,576.620	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	21,100	1,377,408.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	5,926	465,013.220	
		EQUITY RESIDENTIAL	88,262	7,736,164.300	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	54,800	832,960.000	
		EPR PROPERTIES	19,584	876,971.520	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,100	109,624.000	
		CITY OFFICE REIT INC	10,900	200,560.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	25,933	384,327.060	
		EQUINIX INC	23,287	19,147,968.620	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19,829	558,781.220	
		CHATHAM LODGING TRUST	12,765	167,987.400	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	8,800	111,760.000	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	14,200	1,146,934.000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	31,400	583,412.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,000	272,580.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,100	58,557.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	184,672	2,901,197.120	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	73,373	3,053,784.260	
		CORESITE REALTY CORP	11,431	1,941,326.730	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39,400	947,176.000	
		RLJ LODGING TRUST	43,621	559,221.220	
		FARMLAND PARTNERS INC	6,700	79,395.000	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	56,100	1,015,410.000	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15,700	226,080.000	
		CYRUSONE INC	32,823	2,941,597.260	

KIMCO REALTY CORP	159,428	3,638,146.960	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	15,600	261,612.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	57,295	1,920,528.400	
WHITESTONE REIT	11,200	106,400.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	58,274	2,688,179.620	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	32,300	579,462.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	61,080	1,062,181.200	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	132,803	1,067,736.120	
INVITATION HOMES INC	154,343	6,621,314.700	
JBG SMITH PROPERTIES	29,932	852,762.680	
ALEXANDER & BALDWIN INC	18,700	440,572.000	
CLIPPER REALTY INC	3,490	31,061.000	
GLADSTONE LAND CORP	8,051	248,051.310	
AMERICOLD REALTY TRUST	68,995	2,229,918.400	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	16,900	394,953.000	
VICI PROPERTIES INC	162,665	4,492,807.300	
RETAIL VALUE INC	4,490	27,523.700	
BRT APARTMENTS CORP	2,900	53,215.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,189	1,493,220.030	
SAFEHOLD INC	3,657	262,974.870	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	31,943	256,182.860	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	31,443	849,275.430	
COREPOINT LODGING INC	10,700	165,529.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,950	264,830.500	
STORE CAPITAL CORP	63,470	2,132,592.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,900	41,713.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	41,000	984,000.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	27,868	248,861.240	
LIFE STORAGE INC	21,213	3,085,855.110	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,774	491,043.100	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	27,519	668,986.890	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	13,723	197,473.970	
PARAMOUNT GROUP INC	42,993	357,271.830	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	36,500	322,660.000	
NETSTREIT CORP	9,900	215,028.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	40,601	2,136,424.620	
CTO REALTY GROWTH INC	1,560	86,533.200	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	39,179	2,971,335.360	
STAG INDUSTRIAL INC	45,266	2,047,381.180	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,600	49,452.000	
INDUS REALTY TRUST INC	1,100	83,050.000	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,200	58,752.000	
ORION OFFICE REIT INC	14,223	269,952.540	
VENTAS INC	103,013	5,099,143.500	
CARETRUST REIT INC	25,404	563,714.760	
GEO GROUP INC/THE	31,600	241,424.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	76,810	1,825,005.600	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	12,654	305,214.480	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	59,143	783,644.750	
UMH PROPERTIES INC	11,544	284,444.160	
IRON MOUNTAIN INC	74,886	3,837,907.500	
TERRENO REALTY CORP	19,350	1,542,582.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	31,893	1,469,310.510	
SUN COMMUNITIES INC	29,994	5,941,211.520	
ACADIA REALTY TRUST	22,811	467,169.280	
ALEXANDER'S INC	500	126,345.000	
PROLOGIS INC	191,213	30,819,711.340	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	36,471	7,854,759.270	
BRANDYWINE REALTY TRUST	44,742	599,542.800	
SAUL CENTERS INC	3,200	160,256.000	
VERIS RESIDENTIAL INC	20,100	374,664.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	26,331	4,518,662.910	
COUSINS PROPERTIES INC	38,455	1,488,593.050	
SITE CENTERS CORP	46,278	693,707.220	
DUKE REALTY CORP	98,500	6,115,865.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	10,578	2,271,837.060	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,834	5,753,187.840	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	33,807	2,145,054.150	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	18,107	2,345,218.640	
GETTY REALTY CORP	9,803	304,187.090	
WELLTOWER INC	112,576	9,366,323.200	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139,421	4,868,581.320	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26,900	1,171,226.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	41,700	355,701.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	38,159	1,192,468.750	
EQUITY COMMONWEALTH	31,475	809,537.000	

KILROY REALTY CORP	27,109	1,792,447.080	
LTC PROPERTIES INC	10,308	353,152.080	
LEXINGTON REALTY TRUST	72,695	1,096,240.600	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	29,778	6,555,328.920	
MACERICH CO/THE	54,979	915,950.140	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	44,215	3,709,638.500	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,900	679,371.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	45,420	2,077,965.000	
REALTY INCOME CORP	146,325	9,917,908.500	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	29,410	809,069.100	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17,000	17,510.000	
PUBLIC STORAGE	39,456	14,272,813.440	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5,264	938,044.800	
REGENCY CENTERS CORP	40,026	2,863,860.300	
RPT REALTY	21,100	263,961.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	27,216	503,223.840	
SL GREEN REALTY CORP	17,357	1,238,769.090	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57,500	147,200.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	7,600	152,076.000	
UDR INC	75,167	4,356,679.320	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,100	182,218.000	
WP CAREY INC	48,243	3,863,299.440	
WASHINGTON REIT	21,600	546,048.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7,000	70,910.000	
AGREE REALTY CORP	17,800	1,196,516.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	61,806	1,731,804.120	
CUBESMART	56,358	3,144,212.820	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	56,326	608,884.060	
DIGITAL REALTY TRUST INC	73,396	12,590,349.840	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,100	71,889.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	34,629	7,450,429.350	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	67,725.000	
CENTERSPACE	3,660	392,535.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	57,169	1,172,536.190	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	24,900	521,655.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,200	144,564.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	35,990	2,004,283.100	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	9,621	233,694.090	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	54,342	473,318.820	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	154,222	3,434,523.940	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,305	151,323.900	
	DOUGLAS EMMETT INC	45,386	1,498,191.860	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	364,562	244,256.540	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	193,400	154,720.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	3,082.500	
	PRIME US REIT	147,000	122,010.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 324,588,979.760 (36,879,799,880)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	776,480	535,382.960	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159,570	134,357.940	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	79,700.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	220,710	164,208.240	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	146,110	146,110.000	
	REGIONAL REIT LTD	111,310	100,624.240	
	NEWRIVER REIT PLC	69,330	59,831.790	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	224,810	369,587.640	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155,490	148,181.970	
	CUSTODIAN REIT PLC	109,420	114,015.640	
	PRS REIT PLC/THE	119,640	128,613.000	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	90,900	107,625.600	
	LXI REIT PLC	180,188	261,272.600	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98,200	93,290.000	
	AEW UK REIT PLC	49,610	55,960.080	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	201,120	204,337.920	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	259,813	316,971.860	
	HOME REIT PLC	148,087	181,406.570	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	198,087	1,488,029.540	
	SEGRO PLC	317,029	4,389,266.500	
	HAMMERSON PLC	1,121,919	360,809.150	
	UNITE GROUP PLC/THE	105,390	1,119,241.800	
	BRITISH LAND CO PLC	247,760	1,285,874.400	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	67,061	480,827.370	
	DERWENT LONDON PLC	29,630	987,864.200	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	346,370	515,052.190	
	WORKSPACE GROUP PLC	34,319	276,954.330	

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	56,264	771,379.440	
	SHAFTESBURY PLC	75,770	451,968.050	
	BIG YELLOW GROUP PLC	45,640	758,993.200	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	242,947	674,906.760	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	150,968	78,805.290	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	492,448	1,178,920.510	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 18,020,370.780 (2,710,263,765)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	48,840	1,024,174.800	イスラエル・シュケル
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 1,024,174.800 (37,136,578)	
オーストラリ ア・ドル				オーストラリア・ドル
	DEXUS/AU	290,130	3,237,850.800	
	HOME CONSORTIUM LTD	48,000	384,480.000	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93,380	364,182.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	371,284	321,160.660	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	144,870	585,274.800	
	AVENTUS GROUP	110,701	415,128.750	
	RURAL FUNDS GROUP	108,595	336,644.500	
	WAYPOINT REIT	202,491	564,949.890	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	163,212	842,173.920	
	CENTURIA OFFICE REIT	118,830	287,568.600	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	166,050	554,607.000	
	IRONGATE GROUP	149,630	250,630.250	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	147,056	224,995.680	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	291,520	868,729.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	79,167	344,376.450	
	NATIONAL STORAGE REIT	288,195	726,251.400	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	54,670	191,345.000	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	138,107.200	
	SCENTRE GROUP	1,400,086	4,298,264.020	
	ARENA REIT	93,890	430,016.200	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	47,120	172,930.400	
	BWP TRUST	129,961	539,338.150	

	GPT GROUP	516,720	2,733,448.800	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	139,510	606,868.500	
	MIRVAC GROUP	1,063,521	3,105,481.320	
	STOCKLAND	643,931	2,859,053.640	
	ABACUS PROPERTY GROUP	107,930	407,975.400	
	GOODMAN GROUP	458,260	12,033,907.600	
	VICINITY CENTRES	1,043,766	1,790,058.690	
	CHARTER HALL GROUP	125,642	2,715,123.620	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	94,740	579,808.800	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 42,910,731.640 (3,472,765,512)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	4,200	38,514.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	9,400	37,412.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	11,400	49,248.000	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT UNITS	4,300	53,449.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,100	193,230.000	
	SLATE GROCERY REIT	7,000	98,000.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14,700	333,102.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	25,347.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,300	114,374.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	28,000	379,680.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	22,200	499,500.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	81,088.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	55,719.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,800	904,200.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	30,300	508,434.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,500	292,775.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	29,500	538,965.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	43,200	635,904.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	72,912.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,100	236,880.000	
	PLAZA RETAIL REIT	11,100	50,727.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19,100	604,133.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	22,800	1,334,940.000	



	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	24,590	280,326.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	38,166	607,984.380	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	42,000	945,420.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,200	171,504.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,900	317,420.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12,300	220,416.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	16,800	737,352.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 10,418,955.380 (918,743,486)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	355,983	875,718.180	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	326,076	96,192.420	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	583,900	618,934.000	
	AIMS APAC REIT	119,000	167,790.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	783,990	1,175,985.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134,000	111,890.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	239,900	211,112.000	
	EC WORLD REIT	57,000	45,600.000	
	IREIT GLOBAL	136,824	86,883.240	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	905,877	2,645,160.840	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	1,346,522	2,666,113.560	
	SUNTEC REIT	586,200	873,438.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	808,400	1,503,624.000	
	KEPPEL REIT	529,000	592,480.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	505,456	510,510.560	
	ESR-REIT	709,902	344,302.470	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	191,600	216,508.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	281,176	632,646.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	383,800	247,551.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	304,142	361,928.980	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	104,900	520,304.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	525,769	1,403,803.230	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	354,500	315,505.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	593,684	1,193,304.840	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248,100	145,138.500	
	SPH REIT	275,600	268,710.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	651,063	279,957.090	

シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 18,111,090.910 (1,506,118,320)
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	224,470	ニュージーランド・ドル 363,641.400
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	423,800	487,370.000
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	102,920	325,227.200
	GOODMAN PROPERTY TRUST	299,220	771,987.600
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	328,820	526,112.000
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 2,474,338.200 (189,361,103)
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	9,887	ユーロ 178,934.920
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43,860	854,831.400
	HAMBORNER REIT AG	17,280	171,936.000
	WERELDHAVE NV	8,970	107,370.900
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,525	1,651,027.000
	NSI NV	4,131	143,345.700
	VASTNED RETAIL NV	4,700	111,390.000
	ICADE	8,028	498,137.400
	CARMILA	11,800	164,492.000
	ALTAREA	1,010	156,348.000
	GECINA SA	13,313	1,604,882.150
	KLEPIERRE	48,377	949,640.510
	COVIVIO	11,652	814,008.720
	MERCIALYS	12,130	100,497.050
	AEDIFICA	8,896	1,018,592.000
	COFINIMMO	7,222	1,006,024.600
	BEFIMMO	5,860	190,157.000
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	5,480	154,262.000
	RETAIL ESTATES	2,787	195,368.700
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	34,408	1,396,964.800
	CARE PROPERTY INVEST	6,100	158,600.000
XIOR STUDENT HOUSING NV	4,580	220,985.000	
MONTEA NV	2,500	329,500.000	
COIMA RES SPA	5,190	38,613.600	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,240	50,576.800	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,530	73,085.900	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	66,519	534,147.570	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	82,170	785,709.540	
	CROMWELL REIT EUR	80,920	208,773.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102,050	165,525.100	
	HIBERNIA REIT PLC	159,240	201,916.320	
ユーロ 小計			ユーロ 14,235,644.280 (1,819,315,339)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11,440	91,863,200.000	韓国・ウォン
	LOTTE REIT CO LTD	34,375	191,125,000.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	25,060	120,037,400.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	32,368,000.000	
	JR REIT XXVII	31,290	168,027,300.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8,500	53,975,000.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	40,160	254,212,800.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 911,608,700.000 (87,332,113)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	163,540	17,679.980	香港・ドル
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	604,000	1,969,040.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250,000	1,040,000.000	
	FORTUNE REIT	378,000	2,948,400.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	912,000.000	
	LINK REIT	563,900	37,640,325.000	
	CHAMPION REIT	515,000	1,967,300.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 46,494,744.980 (676,963,487)	
投資証券 合計			48,297,799,583 [48,297,799,583]	
合計			48,932,594,523 [48,932,594,523]	

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

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

## 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券 1銘柄 156銘柄	1.7%	98.3%	76.6%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.5%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	7.1%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 31銘柄	-%	100%	3.7%
韓国・ウォン	投資証券 7銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	100%	1.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	184,834	4,499,641
国債証券	6,632,340	323,942,760
未収利息	288	122,984
前払費用	2,983	14,011
流動資産合計	6,820,445	328,579,396
資産合計	6,820,445	328,579,396

負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,513,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		307,250
元本等合計		6,820,445
純資産合計		6,820,445
負債純資産合計		6,820,445
		314,356,530
		14,222,866
		328,579,396
		328,579,396
		328,579,396

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首	2019年12月19日	2020年12月19日
期首元本額	4,013,246円	6,513,195円
期中追加設定元本額	2,548,635円	347,115,400円
期中一部解約元本額	48,686円	39,272,065円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	- 円	26,486,360円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,513,195円	108,542,159円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	- 円	135,752,811円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	- 円	43,575,200円
計	6,513,195円	314,356,530円
2. 期末日における受益権の総数	6,513,195口	314,356,530口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月20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12月18日現在	2021年12月20日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	198	829,940
合計	198	829,940

(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19日から2020年12月18日まで、及び2020年12月19日から2021年12月20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12月18日現在	2021年12月20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12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.0472円	1.0452円
(1万口当たり純資産額)	(10,472円)	(10,452円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 2 7 2年国債	14,000,000	14,028,140	
	4 3 0 2年国債	47,000,000	47,109,510	
	1 3 5 5年国債	40,000,000	40,106,800	

136	5年国債	40,000,000	40,131,600	
137	5年国債	35,000,000	35,134,750	
138	5年国債	5,000,000	5,022,500	
333	10年国債	35,000,000	35,566,650	
334	10年国債	52,000,000	52,937,040	
335	10年国債	53,000,000	53,905,770	
国債証券 合計			323,942,760	
合計			323,942,760	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	552,409,394	432,520,132
コール・ローン	1,737,358,108	1,168,153,193
国債証券	210,467,554,675	231,782,934,708
派生商品評価勘定	13,259,498	318,574
未収入金	7,448,324,125	16,245
未収利息	1,213,274,427	1,239,129,219
前払費用	51,013,597	26,729,836
流動資産合計	221,483,193,824	234,649,801,907
資産合計	221,483,193,824	234,649,801,907
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,251,715	2,247,272
未払金	165,911	390,208
未払解約金	8,451,045,951	56,147,554



流動負債合計		8,467,463,577	58,785,034
負債合計		8,467,463,577	58,785,034
純資産の部			
元本等			
元本	1	70,392,881,865	74,672,925,593
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		142,622,848,382	159,918,091,280
元本等合計		213,015,730,247	234,591,016,873
純資産合計		213,015,730,247	234,591,016,873
負債純資産合計		221,483,193,824	234,649,801,907

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1. 1 期首	2019年12月19日	2020年12月19日
期首元本額	66,497,252,620円	70,392,881,865円
期中追加設定元本額	13,724,989,200円	9,932,425,637円
期中一部解約元本額	9,829,359,955円	5,652,381,909円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	602,129,178円	498,028,337円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	11,992,600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)	102,918,497円	72,334,081円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	29,649,083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)	339,616,893円	308,654,670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)	97,097,761円	217,667,139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)	466,813,735円	509,869,721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)	1,839,870,511円	2,330,554,085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)	667,466,889円	846,032,534円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	941,122円	765,768円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,036,726円	7,328,602円
i F r e e 外国債券イン デックス	834,000,559円	1,758,964,643円
i F r e e 8資産バランス	1,020,314,288円	1,461,523,347円
i F r e e 年金バランス	58,231,076円	238,716,164円
DCダイワ外国債券インデッ クス	48,655,933,396円	49,656,604,656円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	824,651,833円	976,846,606円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	464,722,969円	610,161,427円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	286,603,572円	396,812,649円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	467,184,716円	582,032,544円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	343,396,307円	444,325,582円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	113,161,645円	162,174,994円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	20,009,459円	29,622,344円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,077,197円	10,683,059円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	173,829,603円	630,063,162円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,103,785円	3,395,429円
ダイワつみたてインデックス バランス50	989,956円	1,440,219円
ダイワつみたてインデックス バランス70	1,037,838円	1,897,080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	177,567,819円	164,717,681円
ダイワ世界バランスファンド60VA	136,813,088円	136,633,533円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,235,222,037円	3,856,062,322円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	248,882,370円	229,414,922円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,589,887円	143,499,097円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	32,790,195円	43,853,527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)	2,007,724,966円	2,364,084,706円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,869,754,617円	5,829,571,725円
ダイワライフスタイル25	33,292,265円	33,009,183円
ダイワライフスタイル50	60,140,209円	65,126,638円
ダイワライフスタイル75	16,323,218円	17,354,980円
計	70,392,881,865円	74,672,925,593円
2. 期末日における受益権の総数	70,392,881,865口	74,672,925,593口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月20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	<p>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。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	496,440,174	817,393,215
合計	496,440,174	817,393,215

(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12月1日から2020年12月18日まで、及び2021年12月1日から2021年12月20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12月18日 現在				2021年12月20日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	7,654,037,293	-	7,661,067,250	7,029,957	-	-	-	-
アメリカ・ドル	3,547,868,520	-	3,541,475,000	6,393,520	-	-	-	-
イギリス・ポ ンド	549,431,458	-	550,939,350	1,507,892	-	-	-	-
イスラエル・ シユケル	28,578,690	-	28,656,000	77,310	-	-	-	-
オーストラ リア・ドル	219,063,244	-	219,765,600	702,356	-	-	-	-
カナダ・ドル	138,340,290	-	138,190,250	150,040	-	-	-	-
シンガポ ール・ドル	8,172,895	-	8,172,150	745	-	-	-	-
スウェー デン・ク ローナ	7,421,940	-	7,482,000	60,060	-	-	-	-
デンマ ーク・ クロー ネ	9,469,795	-	9,503,000	33,205	-	-	-	-
ノルウェ ー・ク ロー ネ	16,961,448	-	17,118,690	157,242	-	-	-	-
ポーラ ンド・ ズロチ	49,476,408	-	49,704,000	227,592	-	-	-	-
マレー シア・ リンギ ット	38,695,900	-	38,764,120	68,220	-	-	-	-
メキシ コ・ペ ソ	64,894,841	-	64,682,970	211,871	-	-	-	-

ユーロ	2,975,661,864	-	2,986,614,120	10,952,256	-	-	-	-
買 建	963,081,620	-	967,119,360	4,037,740	1,081,771,778	-	1,079,843,080	1,928,698
アメリカ・ドル	402,881,582	-	400,416,000	2,465,582	580,843,321	-	580,629,135	214,186
イギリス・ポンド	11,983,764	-	12,039,140	55,376	76,845,564	-	76,386,486	459,078
オーストラリア・ドル	8,062,994	-	8,094,770	31,776	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	31,361,148	-	31,419,964	58,816
ユーロ	540,153,280	-	546,569,450	6,416,170	392,721,745	-	391,407,495	1,314,250
合計	8,617,118,913	-	8,628,186,610	2,992,217	1,081,771,778	-	1,079,843,080	1,928,698

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2020年12月18日現在	2021年12月20日現在
1口当たり純資産額	3.0261円	3.1416円
(1万口当たり純資産額)	(30,261円)	(31,416円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,433,085.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,769,330.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,714,130.320	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,222,392.310	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,457,559.590	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,112,114.880	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	715,946.880	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,025,931.600	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	906,853.540	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	930,278.520	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	993,573.840	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,228,208.650	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,644,553.680	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,252,831.580	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	767,753.480			
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	738,069.900			
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,337,475.000			



4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,559,849.080	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,518,937.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,711,666.000	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,472,075.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,386,350.920	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,459,212.500	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,058,539.080	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,868,460.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,947,254.400	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,005,868.420	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,765,375.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,980,303.450	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,623,018.210	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,576,091.080	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,882,894.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,207,002.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,707,319.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,226,892.100	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,790,808.290	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,364,446.320	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,247,381.280	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,409,897.260	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,376,720.900	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,150,616.380	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,324,142.840	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,925,569.970	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,863,127.300	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,000,477.480	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,444,298.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,935,907.370	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	2,234,863.600	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,096,376.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	804,283.140	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,387,906.350	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,083,603.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,961,032.980	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,600,208.910	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,536,431.720	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,003,053.320	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,672,381.490	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,881,725.040	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,103,057.900	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	3,171,668.730	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,541,675.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,040,650.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,479,704.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,990,223.600	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,812,248.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,432,136.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,539,343.550	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,504,527.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,546,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,805,790.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,561,288.700	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,579,575.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,831,354.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,560,872.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,845,000.000	3,505,125.350	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,370,518.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,690,549.500	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,785,472.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,470,780.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,086,460.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,454,018.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,471,232.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,220,311.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,100,650.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,950,000.000	3,495,750.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,054,200.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,586,125.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,810,200.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,964,825.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,634,365.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,312,096.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,910,992.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,578,330.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,901,624.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,386,229.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,723,188.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,850,606.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,723,704.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,975,313.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,054,280.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,345,802.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,128,160.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,576,250.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,017,249.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,772,123.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,581,925.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,580,550.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,177,630.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	3,984,865.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,368,928.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,259,470.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,661,500.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,731,184.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,818,520.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,678,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,121,500.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,680,850.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,166,680.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,142,409.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,023,397.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,207,420.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,086,000.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,711,610.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,598,125.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,186,212.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,151,400.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,651,350.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,887,079.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,640,800.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,418,701.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,616,000.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,709,316.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,187,898.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,621,100.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,946,776.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,127,950.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,581,725.000	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,889,880.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,631,890.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,580,850.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,803,870.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,021,544.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,827,776.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,042,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,551,950.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,051,420.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,016,990.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,063,270.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,041,002.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,046,300.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,042,340.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,050,610.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,039,000.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,568,750.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,561,025.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,049,200.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,721,709.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,276,617.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	5,063,250.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,249,728.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,600,340.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	298,920.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,224,336.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,205,376.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,476,900.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,192,608.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,553,744.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,353,294.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,482,360.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,643,246.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,310,552.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,858,840.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,442,950.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,364,620.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,921,010.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,480,860.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,294,875.000	



0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,362,450.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	993,780.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,302,488.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,460,675.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,406,200.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,770,500.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,994,892.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,305,740.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,355,065.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,984,140.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,302,400.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,803,720.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,395,805.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,163,082.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,643,713.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,401,042.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,873,120.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,824,680.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	6,467,956.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,704,342.000	

0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	2,995,050.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,954,956.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,816,000.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,968,710.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,808,950.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	970,780.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,696,209.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,953,280.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,779,570.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,958,528.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,480,115.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,939,250.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	1,994,600.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,847,650.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,956,250.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,708,789.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,921,700.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,993,340.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,978,280.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,989,080.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	7,000,000.000	6,982,220.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,934,360.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,973,030.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	8,892,966.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,034,822.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,423,005.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,384,972.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,982,840.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,100,000.000	6,876,774.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	4,036,892.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	994,880.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,986,560.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,947,260.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,972,340.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,491,735.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,980,250.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,934,750.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,437,245.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,963,760.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	9,300,000.000	9,184,401.000	

2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	7,180,830.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,000,000.000	2,940,330.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,483,300.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,851,380.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,899,400.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,977,380.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,936,500.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,904,250.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,401,525.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	7,000,000.000	6,964,720.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,451,595.000	
0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,490,910.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,986,480.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	2,000,000.000	1,991,400.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	3,000,000.000	2,992,500.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	2,000,000.000	2,027,180.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	3,000,000.000	3,071,250.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,982,160.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,017,100.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	4,000,000.000	3,989,840.000	

	1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	4,014,040.000	
	0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,986,700.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 974,145,559.240 (110,682,418,441)	
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	970,660.320	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,742,551.460	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,528,976.550	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,158,288.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,750,000.000	1,945,055.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,283,441.700	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,463,608.200	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,018,690.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,603,995.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	940,000.000	1,302,464.000	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,823,598.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	1,432,277.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,017,280.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	814,008.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,909,481.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,240,575.000	

0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,295,193.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,235,531.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	672,592.500	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,475,475.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,556,240.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,012,308.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,243,905.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,289,353.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,300,000.000	1,237,951.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	484,520.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	100,000.000	98,817.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	321,174.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	99,037.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	611,640.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	100,000.000	98,902.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	301,503.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	346,980.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,297,301.980	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	3,017,526.400	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,680,773.760	

4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,399,246.580	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,167,264.700	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,761,660.160	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,339,780.420	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,495,192.160	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,022,833.280	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	2,163,632.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,419,642.810	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,219,581.080	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,241,688.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,378,594.440	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,466,617.240	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,702,125.120	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,124,649.940	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,631,231.840	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	2,852,249.400	
2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,158,109.680	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	2,605,774.280	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 92,781,547.600 (13,954,344,759)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル

	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	2,302,200.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,898,442.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,050,925.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,166,240.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,418,979.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,937,196.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,011,640.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,140,952.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,982,952.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,542,300.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,406,408.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,609,968.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,646,841.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	2,003,700.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	200,560.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	905,283.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 30,224,586.000 (1,095,943,488)	
オーストラリア・ドル	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	468,000.000	499,692.960	



4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,331,943.380	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,067,506.700	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,754,000.000	1,967,830.140	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,921,270.880	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,631,676.320	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,964,157.680	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,383,036.060	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,458,036.920	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	929,174.400	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,796,580.720	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,235,203.680	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,426,103.120	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,949,976.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,073,679.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	3,086,283.200	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,517,421.300	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,820,375.600	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,255,943.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,350,416.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,200,000.000	3,046,720.000	

	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,243,522.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,537,232.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,366,375.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,152,720.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,113,420.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 46,126,296.060 (3,733,001,140)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,312,424.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	3,500,000.000	3,425,205.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	3,000,000.000	3,154,920.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	3,800,000.000	3,840,128.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,500,360.000	
	3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,315,700.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,753,275.000	
	4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	3,100,000.000	3,442,922.000	
	2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20230520	10,000,000.000	10,017,000.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,508,470.000	
オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 56,270,404.000 (1,001,163,027)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	785,634.850	

5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,300,282.910	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,619,192.030	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,485,555.280	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,271,882.040	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,311,025.030	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,265,379.640	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,455,088.250	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,651,783.280	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,201,962.560	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	983,631.900	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,227,922.400	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	681,642.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,351,256.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,324,609.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,994,445.700	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,311,073.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,233,192.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,417,388.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,451,242.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	703,360.000	

	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,826,188.800	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,866,540.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,022,510.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,180,020.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,492,140.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,091,893.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	297,306.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,400,000.000	2,437,104.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	99,022.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	991,430.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	700,000.000	707,721.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	992,270.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	200,230.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	500,000.000	497,695.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	303,339.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 51,032,956.670 (4,500,086,119)	
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	854,449.600	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	973,765.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	891,922.500	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	456,812.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	691,666.800	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	663,708.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	684,062.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	547,056.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	789,824.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	467,325.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	789,735.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	455,625.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	589,600.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	502,054.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	376,950.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	692,960.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	732,225.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	300,000.000	301,584.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	198,190.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	199,576.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,859,090.400 (986,201,958)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	スウェーデン・クローナ 7,105,764.400	

	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,289,825.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,281,663.950	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,543,164.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,284,421.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	4,017,651.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,806,852.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,990,880.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 52,320,221.750 (650,340,357)	
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	24,932,740.140	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,044,831.380	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,544,909.980	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,305,902.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,170,290.900	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,700,000.000	2,792,178.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	505,980.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	1,016,680.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 59,313,512.400 (1,019,599,278)	
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	8,311,390.360	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,251,388.050	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,460,279.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,354,712.600	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,517,951.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,613,540.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,925,344.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,757,712.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,426,850.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 42,619,168.510 (535,296,757)	
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	4,236,016.830	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,047,257.600	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,839,836.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,843,309.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,679,070.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,332,000.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,854,300.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,572,380.000	
	Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	962,750.000	

	0.25% Poland Government Bond 20261025	1,300,000.000	1,132,300.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	965,398.450	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,678,681.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,546,705.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,605,186.190	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 40,295,190.320 (1,112,086,810)	
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	2,397,845.310	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,252,838.340	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,590,820.360	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,356,147.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	753,054.270	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,015,844.830	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,449,760.650	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,917,873.400	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	800,000.000	874,880.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,091,701.310	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,793,852.010	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,267,421.400	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,330,630.980	



4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	983,372.700	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,601,026.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,595,833.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,228,556.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,114,112.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,234,908.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,732,436.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,289,556.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	655,794.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	671,021.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	1,953,758.100	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,302,996.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	405,980.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,292,031.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,668,502.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,650,000.000	1,607,826.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,668,456.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 41,098,834.660 (1,104,153,072)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	35,361,361.200	
8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	19,569,621.000	
8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	24,273,858.000	

	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,238,356.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	3,000,000.000	2,775,600.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	937,050.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	30,537,254.070	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	25,704,074.970	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	28,305,014.400	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	10,860,089.940	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	31,624,783.920	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	18,078,945.160	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	23,515,000.000	24,177,417.550	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	19,496,374.920	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	8,169,212.400	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 297,109,013.530 (1,622,066,659)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	395,846.360	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	294,816.510	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	849,319.750	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	708,414.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	465,922.800	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	844,640.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	763,384.600	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	529,480.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	531,310.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	203,838.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	310,384.400	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	405,732.000	

Finland Government Bond 20300915	500,000.000	508,705.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	382,004.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	614,742.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	204,920.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,468,409.770	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,194,719.780	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	1,009,290.240	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	340,207.200	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	910,071.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,346,112.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	939,000.600	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,285,128.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,035,997.200	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	813,760.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	995,856.400	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,009,040.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	767,515.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	381,120.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	350,798.000	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,212,768.000	

Austria Government Bond 20250420	480,000.000	488,995.200	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	605,544.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,783,372.340	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,962,381.060	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,329,197.140	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	1,993,186.440	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,531,301.800	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	959,225.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	955,152.800	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,177,132.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,085,122.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	851,266.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	704,706.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,606,339.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	744,211.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,634,850.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	886,900.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,250,731.800	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	654,852.000	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,230,324.000	

Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,604,656.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	680,000.000	616,488.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,116,204.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,640,276.850	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,000,899.240	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,291,981.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,046,135.320	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,374,673.440	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,831,855.050	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,941,429.800	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,402,397.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,398,353.800	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,574,000.000	4,456,031.580	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,555,951.920	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,446,660.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,875,034.980	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,672,601.970	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,646,558.410	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,466,589.540	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,681,414.960	

1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,231,367.700	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,280,663.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,329,686.960	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,483,913.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,493,761.600	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,388,832.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,444,693.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	3,768,945.100	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,028,535.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,269,973.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,325,928.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,117,870.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,250,000.000	2,288,070.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,820,000.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,956,259.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,069,920.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,872,090.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,254,612.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	934,749.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	900,000.000	924,516.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,556,085.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,131,009.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	2,600,000.000	2,695,940.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	727,727.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	100,690.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,008,720.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,010,840.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	101,269.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	700,000.000	706,888.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	200,000.000	202,894.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,786,727.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,926,885.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,954,060.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,736,533.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,457,120.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,360,674.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	102,829.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,262,194.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,338,766.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,231,060.600	

6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,803,967.750	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,759,566.130	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	5,264,624.610	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,292,131.210	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,516,851.520	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,844,218.200	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,455,924.480	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,664,000.000	6,498,653.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,610,988.360	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,289,373.160	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	6,774,458.290	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,172,761.800	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,187,269.020	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,448,784.380	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,258,841.320	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,242,223.940	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,621,029.400	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,411,497.870	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,920,000.000	6,814,867.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	3,955,672.980	



1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	4,770,920.220	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,886,444.830	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	4,194,382.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,220,364.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,667,070.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,861,009.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,420,304.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,715,128.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,489,609.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,317,884.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,450,490.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,627,408.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	4,598,602.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,830,000.000	3,901,774.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,269,762.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,419,368.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,831,383.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,064,350.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	2,239,864.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	4,042,280.000	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	844,652.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,435.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,000,000.000	1,005,380.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	3,700,000.000	3,708,251.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	1,600,000.000	1,634,032.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	700,000.000	709,212.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	596,799.400	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,561,944.870	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,527,123.800	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	829,577.070	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	3,056,491.620	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,912,114.040	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,440,067.600	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	3,269,423.520	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,619,450.100	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,846,270.260	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	2,036,799.240	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,359,126.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,420,272.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,460,079.000	

0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,258,020.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	993,384.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,438,290.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	821,840.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,050,000.000	1,023,015.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,330,186.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	904,158.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	600,000.000	616,398.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,064,359.740	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,493,371.800	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,248,957.920	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,954,911.520	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,002,458.090	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,620,452.420	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,215,703.700	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,039,027.480	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,957,051.600	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,383,394.050	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,543,690.740	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,643,828.880	

1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,124,539.920	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,579,930.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,148,270.640	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,731,750.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,668,655.700	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,365,533.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,548,634.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,962,305.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,674,080.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,615,991.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,307,795.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,932,813.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,366,885.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,956,419.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,312,750.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,701,078.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,607,566.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	2,433,964.500	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,244,964.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,308,460.000	

2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,289,315.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,585,337.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,002,372.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	744,662.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,318,447.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,424,260.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,798,356.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,550,085.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,033,900.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,452,490.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,035,520.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	2,257,521.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,316,380.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,277,198.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,729,801.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,300,000.000	1,367,977.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,315,318.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,106,699.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	1,189,656.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	669,039.000	

0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,880,829.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,700,000.000	2,634,876.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	690,403.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,094,731.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,507,800.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	459,627.400	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	801,888.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,906,916.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	1,003,700.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	500,000.000	502,695.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,100,000.000	1,090,936.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	100,000.000	99,685.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	100,000.000	99,281.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	4,432,761.500	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,199,739.390	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,719,340.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,354,367.620	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,769,500.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,200,372.560	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,440,826.830	

5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,463,805.860	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,568,343.840	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,456,469.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,094,174.900	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,024,723.880	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,920,924.300	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,424,677.160	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,435,142.380	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,849,494.220	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,356,344.260	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	3,128,367.200	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,738,284.640	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,223,332.110	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,110,018.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,397,607.900	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,442,920.950	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,629,583.900	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,016,315.910	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,231,312.990	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	659,661.600	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	662,674.040	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,168,172.380	

2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	1,240,455.090	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,143,206.390	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	663,135.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	861,192.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	848,175.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	850,035.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,040,696.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	850,437.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	355,768.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	823,960.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	819,064.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	797,816.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	406,116.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,140,702.750	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,221,129.560	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,079,671.250	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	742,281.800	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,026,118.380	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,003,008.510	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,001,104.950	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	994,788.840	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	778,835.890	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	470,966.190	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	459,228.360	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	612,421.040	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	563,131.080	



6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,800,262.960	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,186,738.950	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,365,443.000	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,409,380.640	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,004,058.940	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,775,470.720	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,510,736.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,834,850.700	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,075,788.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,125,235.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,240,445.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,624,808.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,805,674.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,436,864.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	3,181,706.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,766,560.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,148,738.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,346,575.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,914,492.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,400,555.200	

SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,480,762.400	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,536,125.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	1,358,994.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,527,104.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,166,597.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,373,086.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	506,405.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,165,680.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	303,507.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	620,165.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	501,975.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	911,448.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,400,000.000	1,421,112.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	612,462.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	300,000.000	302,775.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,414,100.780	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,420,602.780	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,716,680.240	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,874,589.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,365,720.970	

	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,302,705.910	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,531,981.100	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,090,047.520	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,080,587.470	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,402,438.700	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,437,443.600	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,173,855.600	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,295,921.420	
	ユーロ 小計		ユーロ 702,552,682.650 (89,786,232,843)	
国債証券 合計			231,782,934,708 [231,782,934,708]	
合計			231,782,934,708 [231,782,934,708]	

- (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 259銘柄	100%	47.9%
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	100%	6.0%
イスラエル・シケル	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 10銘柄	100%	0.4%
カナダ・ドル	国債証券 36銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.4%
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・リングgit	国債証券	30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	348銘柄	100%	38.7%

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12月30日

資産総額	476,254,224円
負債総額	53,683円
純資産総額（ - ）	476,200,541円
発行済数量	269,092,560口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.7697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12月30日

資産総額	196,536,015,077円
負債総額	6,125,970,200円
純資産総額（ - ）	190,410,044,877円
発行済数量	140,075,113,463口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3593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12月30日

資産総額	265,321,372,485円
負債総額	826,644,714円
純資産総額（ - ）	264,494,727,771円
発行済数量	61,832,278,867口
1単位当たり純資産額（ / ）	4.2776円

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	457,958,450,802円
負債総額	854,894,354円
純資産総額( - )	457,103,556,448円
発行済数量	133,313,227,553口
1単位当たり純資産額( / )	3.4288円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	52,762,995,062円
負債総額	904,747円
純資産総額( - )	52,762,090,315円
発行済数量	15,710,011,732口
1単位当たり純資産額( / )	3.3585円

(参考) ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	329,957,263円
負債総額	0円
純資産総額( - )	329,957,263円
発行済数量	315,838,829口
1単位当たり純資産額( / )	1.0447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12月30日

資産総額	237,766,390,004円
負債総額	1,116,636,911円
純資産総額( - )	236,649,753,093円

発行済数量	74,973,058,114口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.1565円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金



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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2021年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年12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	62	185,083
追加型株式投資信託	776	21,801,298
株式投資信託 合計	838	21,986,381
単位型公社債投資信託	77	213,611
追加型公社債投資信託	14	1,476,507
公社債投資信託 合計	91	1,690,119
総合計	929	23,676,500

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

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



当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

(追加情報)

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

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

(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。

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

効力発生日

2021年6月23日

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## （3）金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## （ ）為替変動リスクの管理

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

## （ ）価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

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

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

### 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

### 2. その他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

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

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

当事業年度(2021年3月31日)

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



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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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	(株)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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	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	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	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(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	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いません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 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		
ソフトウェア		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

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	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
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いません。

(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。

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	第一生命保険株式会社	60,000百万円	(注9)	
	株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	(注3)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

## 2【関係業務の概要】

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

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

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。



## 第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2021年3月11日	有価証券報告書、有価証券届出書
2021年9月10日	半期報告書、有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の監査報告書**

2022年2月4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DCダイワ・ターゲットイヤー2050の2020年12月19日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2050の2021年12月20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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。