【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2023年2月27日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ｉＦｒｅｅ 年金バランス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ｉＦｒｅｅ 年金バランス

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2023年2月28日から2023年8月29日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、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		北米	ファミリーファンド	あり（　　）
公債	年4回			
社債		欧州		
その他債券	年6回（隔月）	アジア		
クレジット属性（　　）				
		オセアニア		
不動産投信	年12回（毎月）	中南米		
その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分変更型（株式、債券））				
	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし
資産複合（　　）		中近東（中東）		
	その他（　）			
資産配分固定型		エマージング		
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

ファンドの目的・特色

国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ 当ファンドは以下の資産クラスに投資します。

国内株式　先進国株式　国内債券　先進国債券

- 資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオに近づけることを目標とします。

※各資産クラスについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご参照下さい。
※GPIFの基本ポートフォリオの変更に伴い、上記の資産クラスを変更することがあります。

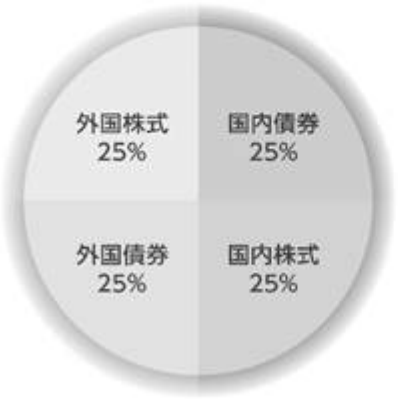
資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、GPIFの基本ポートフォリオに近づけることを目標とするファンドです。

※当ファンドの運用は、GPIFの投資成果に連動することをめざすものではありません。

年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）とは

将来の年金の支払いに備え、国民から集めた国民年金および厚生年金の保険料の積立金を運用している機関です。
GPIFは「長期的な観点から安全かつ効率的な運用」を行なうため、各資産を組み合わせた資産構成割合を「基本ポートフォリオ」として定めています。

■GPIFの基本ポートフォリオ（2022年12月末）



※左記は、GPIFの基本ポートフォリオで定める資産構成割合イメージであり、当ファンドの実際の組入比率を示すものではありません。

※GPIFの基本ポートフォリオの変更に伴い、投資する資産クラスを変更することがあります。
※資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、GPIFの基本ポートフォリオに近づけることを目標としますが、必ずしも一致するとは限りません。

ファンドへの投資にかかる主な費用は

購入時	保有期間中	売却時
購入時手数料	運用管理費用（信託報酬）	換金時手数料 信託財産留保額
購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供等に対するものです。	ファンドの運用・管理等に対するものです。	換金する際に必要な費用等です。
当ファンドは 無料	低水準	無料

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

－Aさんの場合－

運用管理費用っていくらくらい？

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。
当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.1749%(税込)です。
1年間ファンドの値段(基準価額)が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	≒	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.1749%		175円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

ファンドの仕組みなど

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。

※マザーファンドについて、くわしくは、「マザーファンドの概要」をご参照下さい。

- 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。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
- 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」の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

毎年6月5日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。
（注）第1計算期間は、2019年6月5日（休業日の場合翌営業日）までとします。

［分配方針］

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

［マザーファンドの概要］

●下記は届出日現在の組入マザーファンドの一覧であり、今後変更となる場合があります。

当ファンドは投資成果を特定の指数に連動させることをめざすマザーファンド（インデックスマザーファンド）を組入れることを基本としますが、市場環境等によっては、委託会社の判断に基づき、インデックスマザーファンド以外のマザーファンドを組入れます。

資産クラス	マザーファンド	主な運用方針	特定の指数
国内株式	トピックス・インデックス・マザーファンド	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数に連動することをめざします。	東証株価指数（TOPIX）
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	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。	MSCIコクサイ指数（円ベース）
国内債券	ネオ・ジャパン債券マザーファンド	わが国の債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。	―
先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド	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。	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

■指数について

●東証株価指数（TOPIX）

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。
東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

●MSCIコクサイ指数

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。
本ファンドは、ＭＳＣＩ Inc.（「ＭＳＣＩ」）によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、ＭＳＣＩは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。
〔 https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html 〕

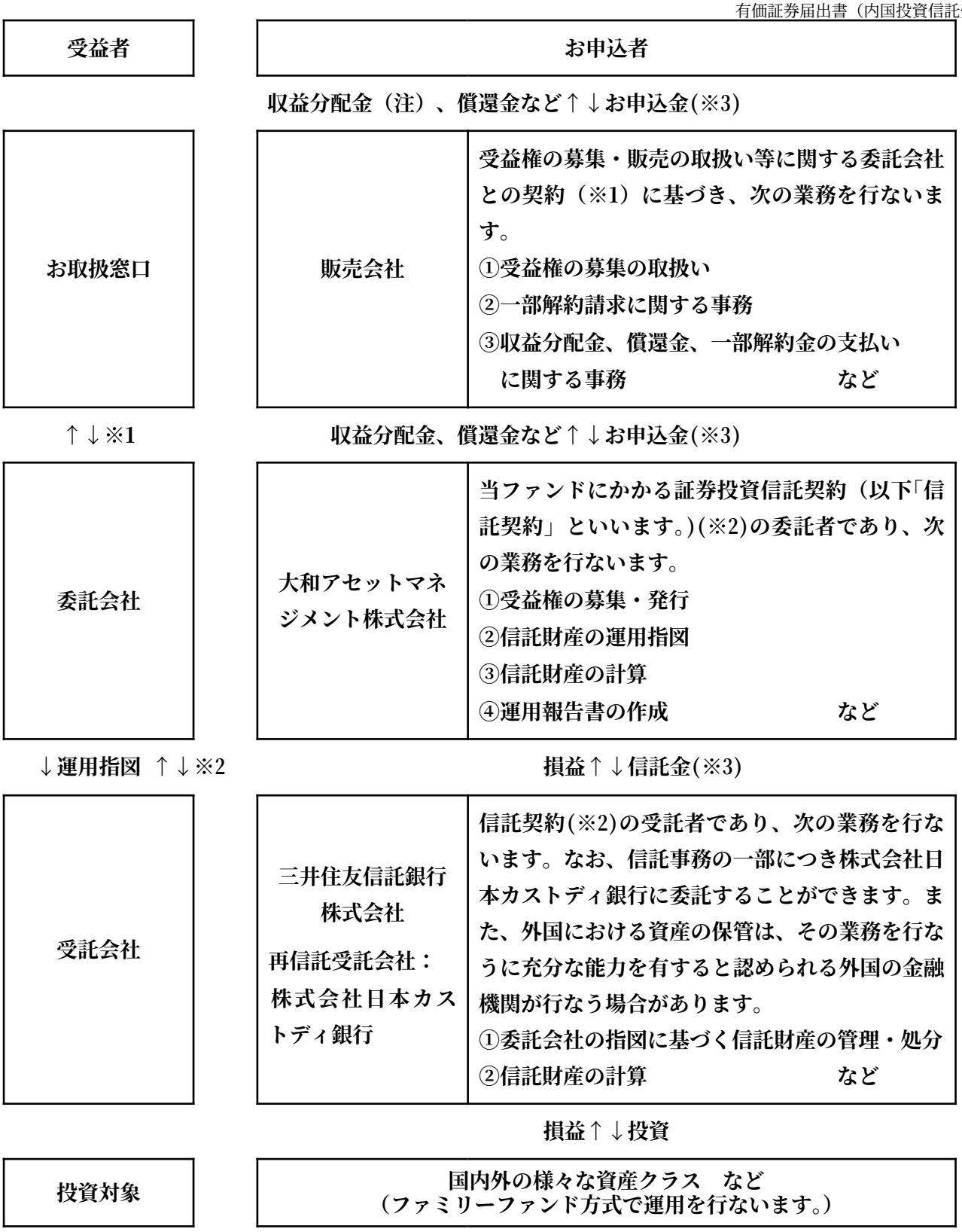
●FTSE世界国債インデックス

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】

2018年8月31日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

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

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

＜委託会社の概況（2022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	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

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. ネオ・ジャパン債券マザーファンドの受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、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。

※　インデックス運用を行なうマザーファンドの受益証券への投資を基本としますが、市場環境等によっては、委託会社の判断に基づき、インデックス運用を行なわないマザーファンドの受益証券に投資を行ないます。

ロ．資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオに近づけることを目標とします。

ハ．各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

ニ．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。

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】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑦、⑧および⑨に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げるマザーファンドの受益証券、ならびに次の5．から25.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3．ネオ・ジャパン債券マザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

14．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

25. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前23.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前5.の証券または証書ならびに前16.および前21.の証券または証書のうち前5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前6.から前10.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前16.および前21.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券（新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

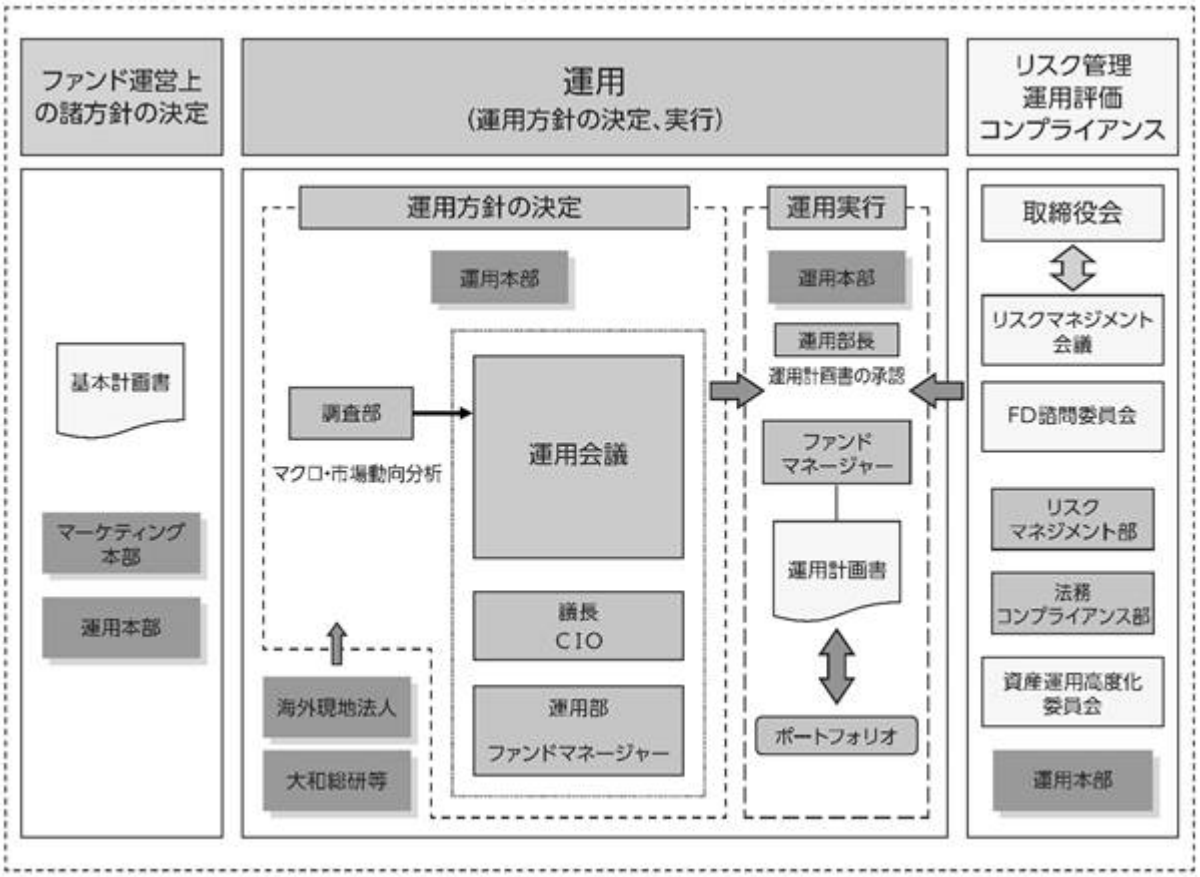
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5．の権利の性質を有するもの

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は35～45名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．FD諮問委員会

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

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2022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】

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

②　原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

②　新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③　投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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

④　投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥　信用取引（信託約款）

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

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

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

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

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

⑦　先物取引等（信託約款）

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

1．先物取引の売建およびコール・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（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1．から4．までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1．から

4．までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額の範囲内とします。

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

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

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑫　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。

⑬　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。

⑭　外国為替予約取引（信託約款）

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

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

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

⑮　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。

⑯　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　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。

②　投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

①　株式

株式への投資には、制限を設けません。

②　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、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

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

③　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合計額が、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合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

2．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

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。

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ネオ・ジャパン債券マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の債券を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ. 主として、わが国の債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

ロ. 組入れる債券（国債を除きます。）の格付けは、取得時においてＢＢＢ格相当以上（Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｓ＆Ｐ、フィッチのいずれかでＢＢＢ－以上またはムーディーズでＢａａ３以上。これらの格付会社の格付けがない債券のうち委託会社が同等の信用力があると判断するものを含みます。）とします。

※ 債券への投資に代えて、ＣＤＳ取引を利用することがあります。

ハ. 債券の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ニ．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、債券の組入総額および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。また、債券先物取引等の売建玉の時価総額が債券の組入総額を超えることがあります。

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

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤、⑥および⑦に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
13. 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。）
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
16. 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。）
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.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.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

⑦　クレジット・デリバティブ取引

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、クレジット・デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第21項第5号イおよび同条第22項第6号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．クレジット・デリバティブ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．クレジット・デリバティブ取引の評価は、当該取引における当事者間で取り決めた者の信用状態、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ニ．委託会社は、クレジット・デリバティブ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

4. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式

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

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

②　投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　同一銘柄の株式

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

④　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入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。

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

② ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

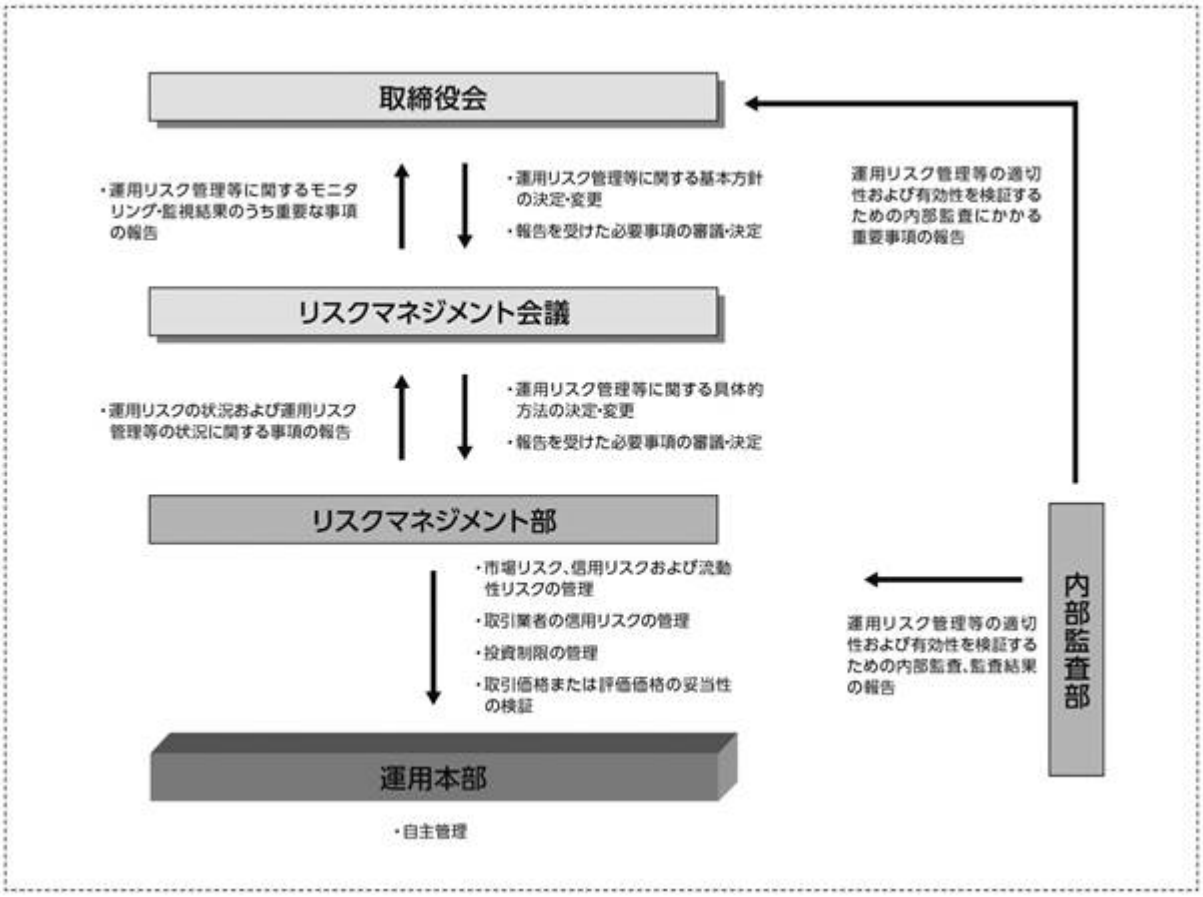
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

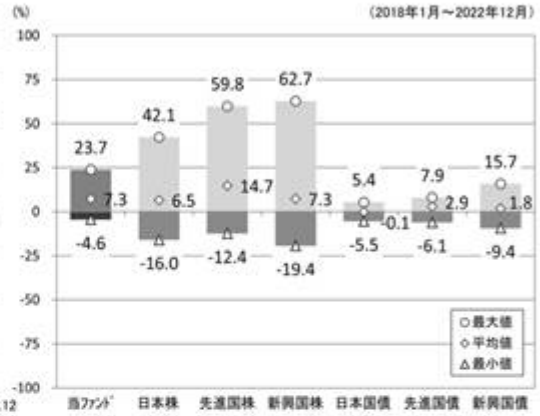
- **委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。**
- **取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。**

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

※指数について
●東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●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.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。〔https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html〕●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

①　換金手数料

ありません。

②　信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

①　信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.1749％（税抜0.159%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.0695%（税抜）	年率0.0695%（税抜）	年率0.02%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」の適用対象です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2022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】(2022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		4,267,578,070	98.99
	内 日本	4,267,578,070	98.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		43,523,618	1.01
純資産総額		4,311,101,688	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】(2022年12月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	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	264,583,577	4.1929 1,109,395,192	4.0510 1,071,828,070	24.86
2	ネオ・ジャパン債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,018,816,991	1.0966 1,117,251,568	1.0499 1,069,655,958	24.81
3	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	803,256,734	1.3367 1,073,786,178	1.3261 1,065,198,754	24.71
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	352,843,745	3.1544 1,113,036,235	3.0067 1,060,895,288	24.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.99%
合計	98.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年6月5日)	163,092,981	163,092,981	0.9716	0.9716
第2計算期間末 (2020年6月5日)	390,644,141	390,644,141	1.0331	1.0331
第3計算期間末 (2021年6月7日)	1,914,505,318	1,914,505,318	1.2005	1.2005
2021年12月末日	3,111,533,992	－	1.2602	－
2022年1月末日	3,113,070,493	－	1.2159	－
2月末日	3,223,266,568	－	1.2053	－
3月末日	3,466,648,566	－	1.2588	－
4月末日	3,478,484,361	－	1.2376	－
5月末日	3,589,691,588	－	1.2369	－
第4計算期間末 (2022年6月6日)	3,627,887,516	3,627,887,516	1.2451	1.2451
6月末日	3,697,712,121	－	1.2271	－
7月末日	3,908,441,120	－	1.2543	－
8月末日	4,030,057,895	－	1.2558	－
9月末日	4,037,613,371	－	1.2171	－
10月末日	4,322,136,328	－	1.2695	－
11月末日	4,383,038,665	－	1.2569	－
12月末日	4,311,101,688	－	1.2027	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
2022年6月7日～ 2022年12月6日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△2.8
第2計算期間	6.3
第3計算期間	16.2
第4計算期間	3.7
2022年6月7日～ 2022年12月6日	0.4

(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	195,580,117	28,723,960
第2計算期間	319,478,121	109,199,791
第3計算期間	1,338,371,375	121,808,269
第4計算期間	1,597,162,297	278,234,119
2022年6月7日～ 2022年12月6日	716,112,153	134,381,942

(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（2022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		192,859,392,760	97.31
	内 日本	192,859,392,760	97.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,336,638,517	2.69
純資産総額		198,196,031,277	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	5,258,370,000	2.65
内 日本	5,258,370,000	2.65

(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（2022年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3,886,700	2,044.19 7,945,187,504	1,812.50 7,044,643,750	3.55
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	500,700	10,346.54 5,180,512,871	10,035.00 5,024,524,500	2.54
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,435,700	733.00 3,251,393,806	889.00 3,943,337,300	1.99
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	70,800	51,254.39 3,628,811,492	51,420.00 3,640,536,000	1.84
5	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	909,700	3,916.42 3,562,770,419	3,762.00 3,422,291,400	1.73
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	509,400	4,352.82 2,217,330,630	5,296.00 2,697,782,400	1.36
7	第一三共	日本	株式	医薬品	618,400	4,226.50 2,613,670,615	4,250.00 2,628,200,000	1.33
8	武田薬品	日本	株式	医薬品	628,100	3,841.33 2,412,743,827	4,111.00 2,582,119,100	1.30
9	任 天 堂	日本	株式	その他製品	446,900	6,170.60 2,757,642,207	5,532.00 2,472,250,800	1.25
10	日 立	日本	株式	電気機器	358,900	6,726.92 2,414,292,813	6,691.00 2,401,399,900	1.21
11	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	410,500	5,517.82 2,265,065,990	5,644.00 2,316,862,000	1.17

12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	538,800	4,397.87 2,369,575,350	4,177.00 2,250,567,600	1.14
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	548,600	4,362.91 2,393,495,037	3,982.00 2,184,525,200	1.10
14	三井物産	日本	株式	卸売業	548,000	3,325.82 1,822,553,353	3,853.00 2,111,444,000	1.07
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	468,300	4,367.04 2,045,086,631	4,283.00 2,005,728,900	1.01
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	702,000	2,634.82 1,849,643,657	2,827.50 1,984,905,000	1.00
17	信越化学	日本	株式	化学	121,300	15,884.38 1,926,776,470	16,225.00 1,968,092,500	0.99
18	HOYA	日本	株式	精密機器	152,900	14,472.95 2,212,915,556	12,705.00 1,942,594,500	0.98
19	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	49,900	41,087.09 2,050,246,090	38,880.00 1,940,112,000	0.98
20	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	461,600	3,807.27 1,757,438,596	4,146.00 1,913,793,600	0.97
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,008,200	1,664.04 1,677,693,872	1,856.00 1,871,219,200	0.94
22	本田技研	日本	株式	輸送用機器	575,400	3,536.33 2,034,808,024	3,032.00 1,744,612,800	0.88
23	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,400	24,044.59 2,053,408,300	20,200.00 1,725,080,000	0.87
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,140,300	1,501.74 1,712,440,730	1,488.00 1,696,766,400	0.86
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	77,000	20,293.82 1,562,624,174	19,160.00 1,475,320,000	0.74
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	258,100	5,976.72 1,542,593,012	5,660.00 1,460,846,000	0.74
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	214,700	7,387.73 1,586,146,848	6,588.00 1,414,443,600	0.71
28	ファナック	日本	株式	電気機器	69,400	21,745.81 1,509,159,452	19,835.00 1,376,549,000	0.69
29	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	680,200	1,979.74 1,346,620,890	2,006.50 1,364,821,300	0.69
30	SMC	日本	株式	機械	23,100	63,076.11 1,457,058,258	55,580.00 1,283,898,000	0.65

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.31%
合計	97.31%

(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	0.10%
鉱業	0.30%
建設業	1.92%
食料品	3.44%
繊維製品	0.45%
パルプ・紙	0.18%
化学	5.98%
医薬品	5.64%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.70%
ガラス・土石製品	0.68%
鉄鋼	0.75%
非鉄金属	0.72%
金属製品	0.54%
機械	4.89%
電気機器	16.09%
輸送用機器	7.11%
精密機器	2.52%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.24%
陸運業	3.03%
海運業	0.62%
空運業	0.51%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.70%
卸売業	5.89%
小売業	4.64%
銀行業	6.30%
証券、商品先物取引業	0.73%
保険業	2.48%
その他金融業	1.11%

不動産業	1.90%
サービス業	5.24%
合計	97.31%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	ＴＯＰＩＸ先物　０５０３月	買建	278	5,360,340,500	5,258,370,000	2.65%

(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（2022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		260,388,313,712	91.31
	内 香港	2,453,969,153	0.86
	内 シンガポール	1,182,601,623	0.41
	内 イスラエル	628,095,849	0.22
	内 ノルウェー	677,726,543	0.24
	内 スウェーデン	2,889,981,227	1.01
	内 デンマーク	2,547,429,906	0.89
	内 イギリス	12,136,018,031	4.26
	内 アイルランド	554,065,729	0.19
	内 オランダ	3,424,990,248	1.20
	内 ベルギー	788,564,694	0.28
	内 フランス	9,349,898,275	3.28

	内 ドイツ	6,477,281,652	2.27
	内 スイス	7,985,712,870	2.80
	内 ポルトガル	181,185,179	0.06
	内 スペイン	1,951,244,193	0.68
	内 イタリア	1,869,548,195	0.66
	内 フィンランド	811,004,451	0.28
	内 オーストリア	151,347,424	0.05
	内 カナダ	9,544,568,958	3.35
	内 アメリカ	189,110,132,665	66.32
	内 オーストラリア	5,503,700,434	1.93
	内 ニュージーランド	169,246,413	0.06
投資証券		6,397,667,240	2.24
	内 香港	130,356,521	0.05
	内 シンガポール	131,265,975	0.05
	内 イギリス	114,126,586	0.04
	内 ベルギー	25,886,118	0.01
	内 フランス	101,749,064	0.04
	内 カナダ	26,170,695	0.01
	内 アメリカ	5,350,404,922	1.88
	内 オーストラリア	517,707,359	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,376,932,395	6.44
純資産総額		285,162,913,347	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）		18,342,514,703	6.43
	内 イギリス	1,068,284,800	0.37
	内 ドイツ	3,362,082,403	1.18
	内 カナダ	946,059,863	0.33
	内 アメリカ	12,202,304,094	4.28
	内 オーストラリア	763,783,543	0.27
為替予約取引（買建）		12,429,100,800	4.36
	内 日本	12,429,100,800	4.36

(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（2022年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	692,000	18,762.18 12,983,471,506	17,199.24 11,901,878,924	4.17
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	305,000	31,961.98 9,748,432,348	31,982.02 9,754,518,235	3.42
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	394,800	12,286.29 4,850,648,919	11,170.68 4,410,186,833	1.55
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	258,100	12,659.44 3,267,415,304	11,737.31 3,029,401,002	1.06
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	40,266	70,163.26 2,825,196,668	70,315.07 2,831,306,850	0.99
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	238,540	12,682.27 3,025,236,424	11,803.66 2,815,646,249	0.99
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	113,200	23,376.69 2,646,256,159	23,562.21 2,667,242,398	0.94
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	179,305	14,671.71 2,630,711,906	14,490.84 2,598,280,066	0.91
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	56,150	41,841.50 2,349,405,927	41,012.26 2,302,838,511	0.81
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	126,270	18,129.60 2,289,241,565	17,678.29 2,232,238,183	0.78
11	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	102,667	19,321.38 1,983,671,412	20,248.69 2,078,872,564	0.73
12	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,180	20,810.14 2,230,440,205	19,378.18 2,076,953,440	0.73
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	70,450	27,776.63 1,956,868,777	27,609.56 1,945,093,643	0.68
14	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	80,018	24,033.29 1,923,097,761	23,663.06 1,893,471,055	0.66

15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	44,150	41,966.50 1,852,823,485	42,518.40 1,877,187,669	0.66
16	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	114,850	24,087.43 2,766,455,487	16,165.51 1,856,609,283	0.65
17	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	113,134	15,993.37 1,809,409,117	15,561.29 1,760,511,254	0.62
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	37,100	45,590.27 1,691,402,029	46,207.46 1,714,297,026	0.60
19	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	34,785	48,334.24 1,681,308,569	48,703.55 1,694,153,126	0.59
20	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	241,613	6,570.64 1,587,570,034	6,811.49 1,645,744,775	0.58
21	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	76,072	21,008.66 1,598,180,465	21,571.71 1,641,003,275	0.58
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	109,121	14,450.10 1,576,812,347	14,705.81 1,604,713,129	0.56
23	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	98,200	14,565.01 1,430,291,291	15,958.50 1,567,124,896	0.55
24	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	176,950	8,296.53 1,468,092,744	8,486.16 1,501,626,897	0.53
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	59,400	24,244.02 1,440,099,148	24,148.74 1,434,435,512	0.50
26	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	311,301	4,914.01 1,529,757,771	4,397.67 1,369,001,559	0.48
27	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	74,105	16,740.16 1,240,531,005	17,895.91 1,326,177,003	0.47
28	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	17,412	69,346.49 1,207,463,532	74,021.38 1,288,860,390	0.45
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	16,900	71,737.35 1,212,361,930	73,915.22 1,249,167,336	0.44
30	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	16,921	79,202.26 1,340,181,847	73,097.54 1,236,883,627	0.43

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率

株式	91.31%
投資証券	2.24%
合計	93.56%

(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	5.54%
素材	4.17%
資本財・サービス	9.26%
一般消費財・サービス	8.87%
生活必需品	7.44%
ヘルスケア	13.92%
金融	13.49%
情報技術	19.35%
コミュニケーション・サービス	5.81%
公益事業	3.12%
不動産	0.33%
合計	91.31%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 23	買建	475	12,559,272,070	12,202,304,094	4.28%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 23	買建	89	1,061,898,360	1,068,284,800	0.37%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 23	買建	49	787,637,870	763,783,543	0.27%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 23	買建	41	967,919,140	946,059,863	0.33%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 23	買建	58	910,080,395	898,303,130	0.32%
		EURO STOXX 50 MAR 23	買建	452	2,507,905,464	2,463,779,273	0.86%

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年1月	買建	62,300,000	8,453,304,600	8,252,500,970	2.89%
		豪ドル買/円売 2023年1月	買建	5,200,000	478,773,020	465,200,320	0.16%
		英ポンド買/円売 2023年1月	買建	4,700,000	773,597,780	750,872,000	0.26%
		スイス・フラン買/円売 2023年1月	買建	5,000,000	726,369,700	718,409,500	0.25%
		ユーロ買/円売 2023年1月	買建	11,300,000	1,614,960,540	1,597,167,990	0.56%
		カナダ・ドル買/円売 2023年1月	買建	6,600,000	668,138,920	644,950,020	0.23%

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

(注2) 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。

ネオ・ジャパン債券マザーファンド

(1) 投資状況（2022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		40,242,015,871	35.99
	内 日本	40,242,015,871	35.99
地方債証券		125,091,575	0.11
	内 日本	125,091,575	0.11
特殊債券		1,732,245,856	1.55
	内 日本	1,732,245,856	1.55
社債券		66,453,446,200	59.43
	内 日本	66,453,446,200	59.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,265,043,724	2.92
純資産総額		111,817,843,226	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(%)

債券先物取引(買建)		22,400,840,000	20.03
	内 日本	22,400,840,000	20.03

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

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

(注3) 債券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（2022年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	3 野村HD劣後FR	日本	社債券	5,000,000,000	99.89 4,994,830,000	98.34 4,917,295,000	1.300000 永久債	4.40
2	4 ソフトバンクG劣後FR	日本	社債券	5,000,000,000	99.14 4,957,265,000	97.27 4,863,960,000	3.000000 2056/02/04	4.35
3	1 東北電力劣後FR	日本	社債券	3,500,000,000	99.86 3,495,415,000	97.02 3,395,731,500	1.545000 2057/09/14	3.04
4	1 日本航空劣後FR	日本	社債券	3,500,000,000	98.74 3,456,005,000	94.10 3,293,731,000	1.600000 2058/10/11	2.95
5	75 30年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	100.51 3,015,367,000	94.08 2,822,610,000	1.300000 2052/06/20	2.52
6	5 ヒユーリツク劣後FR	日本	社債券	2,800,000,000	100.00 2,800,000,000	98.23 2,750,442,800	1.435000 2057/10/19	2.46
7	7 イオン 劣後FR	日本	社債券	2,600,000,000	100.51 2,613,322,400	92.87 2,414,690,200	1.740000 2050/12/02	2.16
8	1 日本生命2劣ローン	日本	社債券	2,400,000,000	99.10 2,378,457,600	97.12 2,330,911,200	1.030000 2048/09/18	2.08
9	55 日産フイナンシヤル	日本	社債券	2,000,000,000	97.41 1,948,244,000	95.95 1,919,150,000	0.370000 2026/12/18	1.72
10	3 関西電力劣後FR	日本	社債券	2,100,000,000	98.74 2,073,697,500	91.33 1,917,961,500	1.259000 2082/03/20	1.72
11	168 20年国債	日本	国債証券	1,800,000,000	93.81 1,688,598,000	89.38 1,608,984,000	0.400000 2039/03/20	1.44
12	152 20年国債	日本	国債証券	1,535,000,000	107.94 1,656,909,700	104.73 1,607,743,650	1.200000 2035/03/20	1.44
13	3A明治安田劣後FR	日本	社債券	1,600,000,000	99.74 1,595,856,000	98.76 1,580,209,600	1.110000 2047/11/06	1.41

14	1 JERA 劣後FR	日本	社債券	1,500,000,000	100.00 1,500,000,000	99.34 1,490,245,500	2.144000 2057/12/25	1.33
15	3 オリツクス 劣後FR	日本	社債券	1,500,000,000	99.38 1,490,737,500	98.44 1,476,727,500	0.830000 2081/03/16	1.32
16	4 楽天 劣後FR	日本	社債券	1,500,000,000	99.90 1,498,563,000	94.29 1,414,368,000	1.810000 2055/11/04	1.26
17	26 物価連動国債	日本	国債証券	1,300,000,000	108.88 1,415,468,397	108.16 1,406,158,395	0.005000 2031/03/10	1.26
18	16 楽天グループ	日本	社債券	1,500,000,000	98.55 1,478,325,000	93.64 1,404,646,500	0.600000 2026/12/02	1.26
19	148 20年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	111.93 1,432,779,200	108.82 1,392,908,800	1.500000 2034/03/20	1.25
20	150 20年国債	日本	国債証券	1,268,000,000	110.39 1,399,859,320	107.40 1,361,844,680	1.400000 2034/09/20	1.22
21	67 30年国債	日本	国債証券	1,700,000,000	86.42 1,469,208,000	79.03 1,343,646,000	0.600000 2050/06/20	1.20
22	173 20年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	92.37 1,293,307,000	87.50 1,225,070,000	0.400000 2040/06/20	1.10
23	1 NTN 劣後FR	日本	社債券	1,200,000,000	102.31 1,227,829,200	100.29 1,203,536,400	2.500000 2051/03/18	1.08
24	160 20年国債	日本	国債証券	1,231,000,000	100.26 1,234,299,080	96.68 1,190,241,590	0.700000 2037/03/20	1.06
25	1エイチエスビーシーH劣FR	日本	社債券	1,200,000,000	99.58 1,195,000,000	98.18 1,178,182,800	2.500000 2032/09/15	1.05
26	144 20年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	111.51 1,115,154,000	109.28 1,092,850,000	1.500000 2033/03/20	0.98
27	27 物価連動国債	日本	国債証券	1,000,000,000	108.80 1,088,091,825	107.76 1,077,648,120	0.005000 2032/03/10	0.96
28	4 DMG森精機劣FR	日本	社債券	1,100,000,000	98.03 1,078,424,600	96.00 1,056,035,200	0.900000 永久債	0.94
29	5A富国生命劣後FR	日本	社債券	1,100,000,000	97.86 1,076,479,800	95.16 1,046,793,000	1.070000 2080/12/16	0.94
30	1 商船三井劣後FR	日本	社債券	1,000,000,000	101.55 1,015,599,000	99.87 998,799,000	1.600000 2056/04/27	0.89

(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	35.99%
地方債証券	0.11%

特殊債券	1.55%
社債券	59.43%
合計	97.08%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
債券先物取引	日本	長国　先　０５０３月	買建	154	22,507,084,700	22,400,840,000	20.03%

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

(注2) 債券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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2022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		226,844,085,132	98.09
	内 ユーロ	76,583,422,541	33.12
	内 中国	8,181,927,271	3.54
	内 シンガポール	1,030,468,768	0.45
	内 マレーシア	1,202,409,584	0.52
	内 イスラエル	787,415,181	0.34
	内 ノルウェー	470,060,941	0.20
	内 スウェーデン	461,598,754	0.20
	内 デンマーク	728,632,050	0.32
	内 イギリス	10,374,447,640	4.49

	内 ポーランド	971,952,306	0.42
	内 カナダ	4,477,614,464	1.94
	内 アメリカ	115,767,772,234	50.06
	内 メキシコ	1,879,692,562	0.81
	内 オーストラリア	3,474,207,421	1.50
	内 ニュージーランド	452,463,415	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,414,135,553	1.91
純資産総額		231,258,220,685	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）		2,048,596,288	0.89
	内 日本	2,048,596,288	0.89

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

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

(注3) 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（2022年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	12,000,000	81.94 1,304,966,699	81.75 1,301,787,000	1.375000 2031/11/15	0.56
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	85.43 1,179,043,746	85.14 1,175,082,916	1.875000 2032/02/15	0.51
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	82.21 1,167,348,364	81.87 1,162,549,136	1.125000 2031/02/15	0.50
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	92.98 1,147,524,842	92.53 1,141,934,324	2.875000 2032/05/15	0.49
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	81.65 1,116,082,373	81.44 1,113,253,076	1.250000 2031/08/15	0.48
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	80.69 1,049,458,215	80.28 1,044,100,320	0.875000 2030/11/15	0.45
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	84.81 979,146,058	84.50 975,647,954	1.625000 2031/05/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	91.87 942,335,957	92.18 945,464,154	1.625000 2026/05/15	0.41

9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.85 924,179,197	93.27 928,299,532	0.375000 2024/09/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	91.84 914,067,457	91.40 909,718,215	2.750000 2032/08/15	0.39
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,086,000	100.09 861,830,186	99.42 856,009,918	2.250000 2024/05/25	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.46 839,834,414	94.46 839,887,759	2.875000 2028/08/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	79.30 841,848,800	78.98 838,536,608	0.625000 2030/08/15	0.36
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	102.76 857,631,362	100.05 835,023,903	2.750000 2027/10/25	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	89.29 829,470,544	89.61 832,452,313	1.125000 2026/10/31	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.65 816,420,826	94.70 816,843,475	2.875000 2028/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.84 813,137,562	92.77 812,506,972	2.625000 2029/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.24 794,125,500	94.27 794,403,573	2.750000 2028/02/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.27 792,148,934	93.43 793,541,753	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	85.09 790,447,455	85.28 792,212,365	0.750000 2028/01/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	96.29 787,377,180	96.60 789,936,573	2.375000 2024/08/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.33 779,184,542	90.71 782,453,607	0.250000 2025/06/30	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.21 778,175,359	90.46 780,331,734	1.500000 2027/01/31	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	95.78 752,630,169	96.14 755,419,464	2.250000 2024/11/15	0.33
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	93.37 743,419,902	93.23 742,297,260	2.750000 2029/05/31	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	94.50 732,344,760	94.79 734,607,666	2.250000 2025/11/15	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	94.82 728,312,421	95.12 730,624,304	2.125000 2025/05/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.92 723,450,206	95.23 725,805,083	2.000000 2025/02/15	0.31

29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	92.58 724,875,740	92.70 725,799,597	2.250000 2027/08/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.17 717,704,002	94.45 719,822,629	2.000000 2025/08/15	0.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.09%
合計	98.09%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	オフショア人民元買/円売 2023年1月	買建	42,872,000	819,180,418	814,937,769	0.35%
		米ドル買/円売 2023年1月	買建	3,688,000	497,156,435	488,599,147	0.21%
		英ポンド買/円売 2023年1月	買建	120,000	19,350,840	19,173,600	0.01%
		シンガポール・ドル買/円売 2023年1月	買建	545,000	55,212,696	53,741,033	0.02%
		ユーロ買/円売 2023年1月	買建	3,513,000	501,826,865	496,572,733	0.21%
		カナダ・ドル買/円売 2023年1月	買建	865,000	88,626,862	84,539,823	0.04%
		メキシコ・ペソ買/円売 2023年1月	買建	9,528,000	67,791,720	64,639,857	0.03%
		マレーシア・リンギット買/円売 2023年1月	買建	879,000	26,431,530	26,392,326	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●iFree 年金バランス

2022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	12,027円
純資産総額	43億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-4.3%
3カ月間	-1.2%
6カ月間	-2.0%
1年間	-4.6%
3年間	14.5%
5年間	-
設定来	20.3%

※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 19年6月	第2期 20年6月	第3期 21年6月	第4期 22年6月
分配金	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券・先物	149	28.6%
国内株式・先物	2,148	24.7%
外国債券	931	24.6%
外国株式・先物	1,214	24.3%
外国リート	58	0.5%
外国投資証券	5	0.0%
コール・ローン、その他		4.5%
合計	4,505	-

通貨別構成	比率
日本円	50.5%
米ドル	30.5%
ユーロ	10.7%
英ポンド	2.3%
カナダ・ドル	1.4%
豪ドル	1.0%
オフショア人民元	1.0%
スイス・フラン	0.8%
デンマーク・クローネ	0.3%
その他	1.5%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.9
最終利回り(%)	2.8
修正デュレーション	7.8
残存年数	---

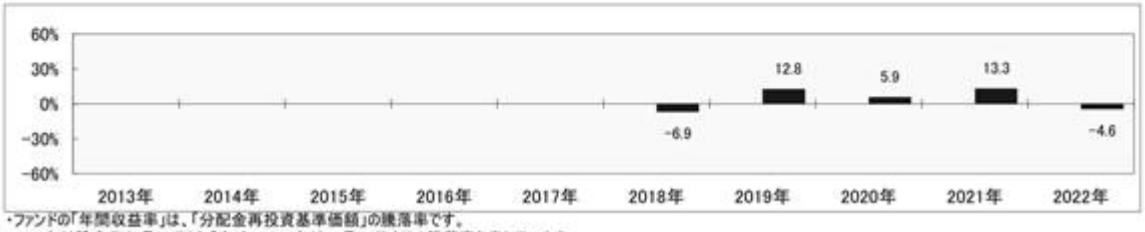
債券格付別構成	比率
AAA	58.6%
AA	7.4%
A	23.1%
BBB	10.8%
BB	-
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
S&P500 EMINI MAR 23	アメリカ	1.1%
APPLE INC	アメリカ	1.0%
トヨタ自動車	日本	0.9%
MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%
TOPIX先物 0503月	日本	0.7%
ソニーグループ	日本	0.6%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
キーエンス	日本	0.5%
日本電信電話	日本	0.4%
AMAZON.COM INC	アメリカ	0.4%
合計		6.9%

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

年間収益率の推移

当ファンド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。
・2018年は設定日（8月31日）から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けを行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

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。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。
（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
・わが国および外国の公社債：原則として、次の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)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。ただし、第1計算期間は、2018年8月31日から2019年6月5日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオ（これに準ずるものを含みます。）の参照が不能となる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を

定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

4. 前3. 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4. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

5. 前3. 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。

6. 前3. から前5. までの規定は、前2. の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、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3. から前5. 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。

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

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の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。

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

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2021年6月8日から2022年6月6日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1　【財務諸表】

【財務諸表】

ｉＦｒｅｅ 年金バランス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年6月7日現在	第4期 2022年6月6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,765,061	40,208,185
親投資信託受益証券	1,895,182,484	3,591,433,811
流動資産合計	1,916,947,545	3,631,641,996
資産合計	1,916,947,545	3,631,641,996
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,195,134	775,191
未払受託者報酬	149,737	357,844
未払委託者報酬	1,040,989	2,487,327
その他未払費用	56,367	134,118
流動負債合計	2,442,227	3,754,480
負債合計	2,442,227	3,754,480
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,594,697,593	※1 2,913,625,771
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	319,807,725	714,261,745
（分配準備積立金）	157,686,635	230,559,683
元本等合計	1,914,505,318	3,627,887,516
純資産合計	1,914,505,318	3,627,887,516
負債純資産合計	1,916,947,545	3,631,641,996

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7日	第4期 自　2021年6月8日 至　2022年6月6日
営業収益		
受取利息	13	4
有価証券売買等損益	153,591,617	100,183,327
その他収益	－	201
営業収益合計	153,591,630	100,183,532
営業費用		
支払利息	2,344	6,832
受託者報酬	202,902	622,822
委託者報酬	1,410,752	4,329,173
その他費用	75,973	233,419
営業費用合計	1,691,971	5,192,246
営業利益	151,899,659	94,991,286
経常利益	151,899,659	94,991,286
当期純利益	151,899,659	94,991,286
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	6,301,181	4,886,345
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,509,654	319,807,725
剰余金増加額又は欠損金減少額	169,926,101	362,842,266
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	169,926,101	362,842,266
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,226,508	58,493,187
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,226,508	58,493,187
分配金	※1　－	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	319,807,725	714,261,745

(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4期 自　2021年6月8日 至　2022年6月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2021年6月5日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2021年6月7日としており、2022年6月5日が休日のため、当計算期間末日を2022年6月6日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第3期 2021年6月7日現在	第4期 2022年6月6日現在
1．※1　期首元本額	378,134,487円	1,594,697,593円
期中追加設定元本額	1,338,371,375円	1,597,162,297円
期中一部解約元本額	121,808,269円	278,234,119円
2．計算期間末日における受益権の総数	1,594,697,593口	2,913,625,771口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2020年6月6日 至　2021年6月7日	第4期 自　2021年6月8日 至　2022年6月6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（145,599,717円）、投資信託約款に規定される収益調整金（162,123,296円）及び分配準備積立金（12,086,918円）より分配対象額は319,809,931円（1万口当たり2,005.46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（90,109,145円）、投資信託約款に規定される収益調整金（483,708,243円）及び分配準備積立金（140,450,538円）より分配対象額は714,267,926円（1万口当たり2,451.47円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2021年6月8日 至　2022年6月6日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第4期 2022年6月6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3期 2021年6月7日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第4期 2022年6月6日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	151,172,945	97,537,467
合計	151,172,945	97,537,467

（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3期 2021年6月7日現在	第4期 2022年6月6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4期 自　2021年6月8日 至　2022年6月6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3期 2021年6月7日現在	第4期 2022年6月6日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2005円 (12,005円)	1.2451円 (12,451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	ネオ・ジャパン債券マザーファンド	797,393,945	877,372,557	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	671,875,066	900,178,213	
	外国株式インデックスマザーファンド	220,052,668	926,597,774	
	外国債券インデックスマザーファンド	281,749,418	887,285,267	
親投資信託受益証券　合計			3,591,433,811	
合計			3,591,433,811	

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、「ネオ・ジャパン債券マザーファンド」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

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在

		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,072,495,627	12,071,596,590
株式	※2※3	174,866,104,090	189,725,861,600
派生商品評価勘定		67,344,050	180,860,450
未収入金		3,340,339	27,283,600
未収配当金		1,263,935,353	1,761,580,435
未収利息		777,911	653,844
その他未収収益	※4	21,689,416	25,894,232
差入委託証拠金		－	8,040,000
流動資産合計		186,295,686,786	203,801,770,751
資産合計		186,295,686,786	203,801,770,751
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,109,200	76,650
前受金		46,511,300	160,635,000
未払金		1,028,592,562	4,015,678,807
未払解約金		119,973,790	110,151,390
受入担保金		6,186,378,660	6,287,724,460
流動負債合計		7,387,565,512	10,574,266,307
負債合計		7,387,565,512	10,574,266,307
純資産の部			
元本等			
元本	※1	135,290,116,425	144,218,034,186
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		43,618,004,849	49,009,470,258
元本等合計		178,908,121,274	193,227,504,444
純資産合計		178,908,121,274	193,227,504,444
負債純資産合計		186,295,686,786	203,801,770,751

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年6月8日 至　2022年6月6日

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1．※1　期首	2020年6月6日	2021年6月8日
期首元本額	142,967,103,545円	135,290,116,425円
期中追加設定元本額	22,103,199,354円	23,029,834,047円
期中一部解約元本額	29,780,186,474円	14,101,916,286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	3,020,415,388円	2,962,705,495円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	6,160,322,539円	5,195,544,975円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	927,435円	920,931円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	25,923,401円	23,273,435円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	521,906,795円	330,149,007円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,728,376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)	761,667,628円	647,820,107円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	170,445,291円	348,599,985円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	31,727,729円	32,296,608円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	78,025,372円	196,172,434円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	3,563,503,924円	5,733,854,030円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,947,213,251円	3,906,692,734円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	362,201,377円	671,875,066円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	65,387,758,940円	68,666,878,875円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,833,165,324円	3,242,640,964円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,784,745,264円	4,563,690,746円
ダイワ・ライフ・バランス７０	3,586,455,783円	4,451,168,891円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,709,475,498円	6,479,526,428円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	47,633,461円	59,020,682円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	42,973,738円	64,357,313円
ダイワつみたてインデックス日本株式	1,072,133,635円	2,017,752,901円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,345,121円	11,962,436円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	8,324,391円	9,836,532円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	13,219,729円	23,835,616円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	－円	99,068,349円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	117,698,161円	85,936,602円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	132,702,147円	97,123,951円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	6,606,433,275円	5,642,424,025円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	580,569,028円	521,432,579円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	84,571,925円	73,437,877円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	151,803,123円	132,473,472円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	166,023,105円	212,641,219円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	10,046,182,581円	11,252,126,060円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,415,940,844円	1,885,192,194円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,505,181,766円	3,214,023,891円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,218,516,655円	1,206,087,227円
ダイワライフスタイル２５	159,348,831円	144,026,251円
ダイワライフスタイル５０	609,687,340円	574,809,555円
ダイワライフスタイル７５	500,939,808円	443,384,955円

ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	10,826,278,446円	8,971,474,612円
計	135,290,116,425円	144,218,034,186円
2. 期末日における受益権の総数	135,290,116,425口	144,218,034,186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 5,904,615,900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 6,030,320,920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 967,420,000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 864,040,000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20,492,575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24,970,375円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年6月8日 至 2022年6月6日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年6月6日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2021年6月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2022年6月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	26,841,374,069	△10,908,287,189
合計	26,841,374,069	△10,908,287,189

（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2021年6月7日まで、及び2021年9月22日から2022年6月6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	2021年6月7日 現在				2022年6月6日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引 株価指数 先物取引 買　建	4,623,033,700	－	4,684,400,000	61,366,300	3,380,330,000	－	3,561,215,000	180,885,000
合計	4,623,033,700	－	4,684,400,000	61,366,300	3,380,330,000	－	3,561,215,000	180,885,000

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1口当たり純資産額	1.3224円	1.3398円
（1万口当たり純資産額）	(13,224円)	(13,398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	3,400	3,370.00	11,458,000	
日本水産	96,400	535.00	51,574,000	
マルハニチロ	14,200	2,284.00	32,432,800	
雪国まいたけ	7,400	896.00	6,630,400	
カネコ種苗	2,900	1,807.00	5,240,300	
サカタのタネ	11,300	4,675.00	52,827,500	貸付株式数　4,400株

ホクト	7,900	1,915.00	15,128,500	貸付株式数	2,200株
ホクリヨウ	1,500	636.00	954,000	貸付株式数	100株
ショーボンドＨＤ	12,700	5,830.00	74,041,000		
ミライト・ホールディングス	32,700	1,638.00	53,562,600		
タマホーム	6,200	2,365.00	14,663,000	貸付株式数	2,300株
サンヨーホームズ	800	731.00	584,800	貸付株式数	400株
日本アクア	4,100	622.00	2,550,200		
ファーストコーポレーション	2,100	737.00	1,547,700	貸付株式数	100株
ベステラ	2,000	1,224.00	2,448,000	貸付株式数	800株
キャンディル	1,000	545.00	545,000	貸付株式数	600株
住石ホールディングス	17,500	199.00	3,482,500		
日鉄鉱業	2,100	5,930.00	12,453,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	4,200	2,858.00	12,003,600	貸付株式数	1,600株
ＩＮＰＥＸ	363,900	1,621.00	589,881,900	貸付株式数	146,700株
石油資源開発	11,900	3,195.00	38,020,500		
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,200	1,612.00	6,770,400		
ダイセキ環境ソリューション	1,900	964.00	1,831,600		
第一カッター興業	2,300	1,336.00	3,072,800		
明豊ファシリティワークス	3,200	666.00	2,131,200	貸付株式数	1,100株
安藤・間	47,600	815.00	38,794,000		
東急建設	27,900	610.00	17,019,000		
コムシスホールディングス	32,700	2,485.00	81,259,500		
ビーアールホールディングス	12,800	325.00	4,160,000	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクショングループ	6,100	2,066.00	12,602,600		
東建コーポレーション	2,800	8,660.00	24,248,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,000	1,001.00	1,001,000	貸付株式数	300株
ヤマウラ	4,100	938.00	3,845,800	貸付株式数	1,700株
オリエンタル白石	33,600	239.00	8,030,400		
大成建設	63,500	4,105.00	260,667,500		
大　林　組	223,000	957.00	213,411,000		
清水建設	207,100	720.00	149,112,000		
飛島建設	5,900	1,009.00	5,953,100		
長谷工コーポレーシヨン	65,200	1,550.00	101,060,000		
松井建設	8,100	664.00	5,378,400	貸付株式数	400株
錢　高　組	900	3,490.00	3,141,000	貸付株式数	300株

鹿島建設	163,300	1,442.00	235,478,600		
不動テトラ	5,000	1,622.00	8,110,000		
大末建設	2,400	1,602.00	3,844,800		
鉄建建設	4,600	1,796.00	8,261,600		
西松建設	14,200	4,310.00	61,202,000	貸付株式数	5,100株
三井住友建設	52,500	452.00	23,730,000	貸付株式数	400株
大豊建設	3,400	4,460.00	15,164,000		
佐田建設	4,700	463.00	2,176,100	貸付株式数	600株
ナカノフドー建設	5,100	314.00	1,601,400	貸付株式数	1,500株
奥　村　組	12,200	2,874.00	35,062,800		
東鉄工業	9,800	2,264.00	22,187,200		
イチケン	1,600	1,839.00	2,942,400		
富士ピー・エス	2,700	492.00	1,328,400	貸付株式数	1,100株
淺沼組	2,600	5,350.00	13,910,000	貸付株式数	100株
戸田建設	92,200	687.00	63,341,400		
熊　谷　組	11,600	2,711.00	31,447,600		
北野建設	1,400	2,158.00	3,021,200	貸付株式数	400株
植　木　組	1,800	1,462.00	2,631,600	貸付株式数	700株
矢作建設	9,400	774.00	7,275,600		
ピーエス三菱	7,500	610.00	4,575,000		
日本ハウスＨＬＤＧＳ	15,700	406.00	6,374,200	貸付株式数	6,000株
大東建託	24,000	11,400.00	273,600,000		
新日本建設	9,700	750.00	7,275,000		
東亜道路	1,200	5,560.00	6,672,000		
日本道路	2,000	6,490.00	12,980,000		
東亜建設	5,400	2,391.00	12,911,400		
日本国土開発	19,400	511.00	9,913,400		
若築建設	3,600	2,050.00	7,380,000		
東洋建設	24,200	836.00	20,231,200		
五洋建設	88,600	641.00	56,792,600	貸付株式数	700株
世紀東急	11,100	816.00	9,057,600		
福　田　組	2,500	4,430.00	11,075,000	貸付株式数	800株
日本ドライケミカル	2,100	1,574.00	3,305,400	貸付株式数	200株
住友林業	54,200	2,017.00	109,321,400		
日本基礎技術	5,800	598.00	3,468,400		
巴コーポレーション	8,700	418.00	3,636,600		
大和ハウス	195,500	3,164.00	618,562,000		
ライト工業	13,300	1,716.00	22,822,800		
積水ハウス	232,700	2,289.50	532,766,650		
日特建設	4,600	796.00	3,661,600		

北陸電気工事	4,200	777.00	3,263,400	
ユアテック	13,200	695.00	9,174,000	
日本リーテック	4,500	1,081.00	4,864,500	
四電工	2,200	1,707.00	3,755,400	
中電工	9,800	2,088.00	20,462,400	
関　電　工	38,000	822.00	31,236,000	
きんでん	49,200	1,502.00	73,898,400	
東京エネシス	7,100	964.00	6,844,400	
トーエネック	2,300	3,365.00	7,739,500	
住友電設	5,700	2,424.00	13,816,800	
日本電設工業	10,900	1,580.00	17,222,000	
エクシオグループ	33,600	2,092.00	70,291,200	
新日本空調	5,400	1,889.00	10,200,600	貸付株式数　1,300株
日本工営	4,500	3,310.00	14,895,000	
九電工	15,900	2,665.00	42,373,500	
三機工業	15,200	1,487.00	22,602,400	
日揮ホールディングス	68,100	1,860.00	126,666,000	
中外炉工業	2,100	1,784.00	3,746,400	
ヤマト	5,700	756.00	4,309,200	
太平電業	4,500	2,716.00	12,222,000	
高砂熱学	19,000	1,599.00	30,381,000	
三晃金属	800	2,790.00	2,232,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	24,300	1,846.00	44,857,800	
朝日工業社	3,000	1,578.00	4,734,000	
明星工業	12,400	745.00	9,238,000	
大　氣　社	10,300	3,145.00	32,393,500	
ダイダン	4,700	2,030.00	9,541,000	
日比谷総合設備	6,600	1,898.00	12,526,800	
ニップン	19,400	1,572.00	30,496,800	
日清製粉Ｇ本社	75,100	1,505.00	113,025,500	
日東富士製粉	1,200	4,355.00	5,226,000	
昭和産業	6,400	2,417.00	15,468,800	
鳥越製粉	6,100	642.00	3,916,200	
中部飼料	8,100	1,018.00	8,245,800	貸付株式数　3,100株
フィード・ワン	9,400	666.00	6,260,400	
東洋精糖	1,500	970.00	1,455,000	貸付株式数　100株
日本甜菜糖	4,000	1,659.00	6,636,000	
ＤＭ三井製糖ホールディ	6,300	1,865.00	11,749,500	
塩水港精糖	9,300	214.00	1,990,200	貸付株式数　2,700株
日新製糖	3,800	1,745.00	6,631,000	

ＬＩＦＵＬＬ	21,300	172.00	3,663,600	貸付株式数	8,600株
ミクシィ	16,200	2,179.00	35,299,800		
ジェイエイシーリクルートメント	5,700	1,796.00	10,237,200	貸付株式数	400株
日本M&Aセンターホールデ	116,900	1,423.00	166,348,700		
メンバーズ	1,900	2,887.00	5,485,300		
中広	1,100	399.00	438,900	貸付株式数	400株
ＵＴグループ	10,300	2,460.00	25,338,000		
アイティメディア	3,400	1,745.00	5,933,000	貸付株式数	1,200株
Ｅ・Ｊホールディングス	4,100	1,156.00	4,739,600	貸付株式数	1,500株
夢真ビーネックスグループ	23,200	1,428.00	33,129,600		
コシダカホールディングス	19,200	773.00	14,841,600	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,800	853.00	1,535,400		
パソナグループ	7,700	2,060.00	15,862,000		
ＣＤＳ	1,700	2,012.00	3,420,400		
リンクアンドモチベーション	15,700	445.00	6,986,500	貸付株式数	6,000株
エス・エム・エス	24,200	2,919.00	70,639,800		
サニーサイドアップG	2,500	663.00	1,657,500	貸付株式数	100株
パーソルホールディングス	71,300	2,547.00	181,601,100		
リニカル	3,900	838.00	3,268,200		
クックパッド	22,100	226.00	4,994,600	貸付株式数	5,200株
エスクリ	3,200	437.00	1,398,400	貸付株式数	1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	3,200	614.00	1,964,800	貸付株式数	1,200株
森永製菓	15,800	3,915.00	61,857,000		
中　村　屋	1,600	3,070.00	4,912,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	18,400	3,735.00	68,724,000		
名糖産業	3,000	1,623.00	4,869,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,900	2,334.00	9,102,600	貸付株式数	1,500株
不　二　家	4,400	2,340.00	10,296,000		
山崎製パン	49,200	1,518.00	74,685,600		
第一屋製パン	1,600	516.00	825,600	貸付株式数	400株
モロゾフ	2,300	3,270.00	7,521,000		
亀田製菓	4,000	4,320.00	17,280,000		
寿スピリッツ	6,700	7,620.00	51,054,000		
カルビー	34,000	2,388.00	81,192,000		
森永乳業	13,000	4,645.00	60,385,000		
六甲バター	5,200	1,430.00	7,436,000	貸付株式数	2,000株

ヤクルト	50,100	7,230.00	362,223,000		
明治ホールディングス	43,500	6,330.00	275,355,000		
雪印メグミルク	16,800	1,740.00	29,232,000		
プリマハム	9,400	2,161.00	20,313,400		
日本ハム	27,000	3,995.00	107,865,000		
林兼産業	2,700	494.00	1,333,800	貸付株式数	400株
丸大食品	7,000	1,490.00	10,430,000		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,700	3,095.00	20,736,500	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,400	2,428.00	5,827,200	貸付株式数	200株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	47,900	663.00	31,757,700		
学情	2,900	981.00	2,844,900	貸付株式数	200株
スタジオアリス	3,200	2,284.00	7,308,800	貸付株式数	1,100株
クロスキャット	3,800	872.00	3,313,600	貸付株式数	1,200株
シミックホールディングス	3,600	1,463.00	5,266,800	貸付株式数	1,400株
エプコ	1,600	750.00	1,200,000	貸付株式数	500株
システナ	104,600	446.00	46,651,600		
ＮＪＳ	1,600	2,030.00	3,248,000		
デジタルアーツ	3,900	6,640.00	25,896,000		
日鉄ソリューションズ	12,000	3,770.00	45,240,000		
綜合警備保障	26,800	3,535.00	94,738,000		
キューブシステム	3,600	925.00	3,330,000	貸付株式数	1,300株
いちご	81,400	304.00	24,745,600		
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	1,000	1,174.00	1,174,000		
日本駐車場開発	75,400	177.00	13,345,800	貸付株式数	29,400株
コア	3,000	1,480.00	4,440,000	貸付株式数	600株
カカクコム	52,300	2,480.00	129,704,000		
アイロムグループ	2,600	1,932.00	5,023,200	貸付株式数	900株
セントケア・ホールディング	4,600	870.00	4,002,000		
サイネックス	1,700	605.00	1,028,500	貸付株式数	200株
ルネサンス	4,900	963.00	4,718,700	貸付株式数	1,900株
ディップ	12,500	3,780.00	47,250,000	貸付株式数	4,000株
ＳＢＳホールディングス	5,500	3,060.00	16,830,000		
デジタルホールディングス	4,900	1,286.00	6,301,400		
新日本科学	8,700	1,934.00	16,825,800	貸付株式数	3,200株
キャリアデザインセンター	1,600	1,115.00	1,784,000		
ベネフィット・ワン	26,000	1,968.00	51,168,000		
エムスリー	125,700	3,856.00	484,699,200		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,400	378.00	1,663,200	貸付株式数	1,800株

ブラス	900	883.00	794,700	貸付株式数	300株
アウトソーシング	40,800	1,156.00	47,164,800		
ウェルネット	6,400	491.00	3,142,400	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,800	2,371.00	6,638,800	貸付株式数	1,000株
ディー・エヌ・エー	27,100	1,847.00	50,053,700		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	93,200	1,318.00	122,837,600		
ぐるなび	10,900	429.00	4,676,100	貸付株式数	100株
タカミヤ	8,600	374.00	3,216,400		
ジャパンベストレスキューＳ	4,300	798.00	3,431,400		
ファンコミュニケーションズ	16,600	405.00	6,723,000	貸付株式数	2,400株
ライク	2,400	2,110.00	5,064,000	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,000	451.00	902,000	貸付株式数	1,000株
エスプール	20,100	1,232.00	24,763,200		
ＷＤＢホールディングス	3,200	2,293.00	7,337,600		
手間いらず	1,100	5,530.00	6,083,000	貸付株式数	400株
ティア	3,100	458.00	1,419,800	貸付株式数	500株
ＣＤＧ	900	1,295.00	1,165,500	貸付株式数	200株
アドウェイズ	10,600	699.00	7,409,400	貸付株式数	4,000株
バリューコマース	5,600	3,275.00	18,340,000	貸付株式数	2,000株
インフォマート	78,300	485.00	37,975,500	貸付株式数	29,800株
サッポロホールディングス	23,100	2,840.00	65,604,000		
アサヒグループホールディン	160,400	4,442.00	712,496,800	貸付株式数	63,600株
キリンＨＤ	275,000	2,056.50	565,537,500		
宝ホールディングス	44,700	941.00	42,062,700		
オエノンホールディングス	20,800	298.00	6,198,400	貸付株式数	4,800株
養　命　酒	2,300	1,750.00	4,025,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	49,200	1,448.00	71,241,600		
サントリー食品インター	50,000	4,930.00	246,500,000	貸付株式数	18,000株
ダイドーグループＨＤ	3,800	4,975.00	18,905,000	貸付株式数	1,500株
伊　藤　園	22,700	5,470.00	124,169,000		
キーコーヒー	6,900	2,085.00	14,386,500		
ユニカフェ	2,400	919.00	2,205,600	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	1,100	1,167.00	1,283,700	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,800	3,025.00	26,620,000		
不二製油グループ	16,100	1,844.00	29,688,400	貸付株式数	100株
かどや製油	800	3,460.00	2,768,000	貸付株式数	300株

Ｊ－オイルミルズ	7,200	1,527.00	10,994,400		
ローソン	16,300	4,440.00	72,372,000		
サンエー	5,100	4,050.00	20,655,000		
カワチ薬品	5,600	2,071.00	11,597,600	貸付株式数	300株
エービーシー・マート	11,400	5,920.00	67,488,000		
ハードオフコーポレーション	3,600	890.00	3,204,000		
高千穂交易	2,600	1,814.00	4,716,400	貸付株式数	1,000株
アスクル	16,500	1,522.00	25,113,000	貸付株式数	4,800株 (100株)
ゲオホールディングス	9,100	1,278.00	11,629,800		
アダストリア	7,800	2,254.00	17,581,200	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,000	348.00	1,392,000	貸付株式数	1,700株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	700	392.00	274,400	貸付株式数	300株
オルバヘルスケアＨＬＤＧＳ	1,500	1,798.00	2,697,000		
伊藤忠食品	1,600	4,715.00	7,544,000	貸付株式数	600株
くら寿司	7,600	3,040.00	23,104,000	貸付株式数	2,900株
キャンドゥ	2,700	2,243.00	6,056,100	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,700	1,335.00	7,609,500		
アイケイ	2,400	517.00	1,240,800	貸付株式数	800株
パルグループＨＬＤＧＳ	6,500	1,756.00	11,414,000		
エディオン	33,500	1,205.00	40,367,500	貸付株式数	12,800株
あらた	5,500	3,955.00	21,752,500	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	14,700	641.00	9,422,700		
ワッツ	3,100	739.00	2,290,900	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,100	6,230.00	6,853,000		
ハローズ	3,300	3,250.00	10,725,000	貸付株式数	700株
ＪＰホールディングス	18,100	227.00	4,108,700	貸付株式数	6,300株
フジオフードＧ本社	5,800	1,397.00	8,102,600	貸付株式数	2,100株
あみやき亭	1,800	2,942.00	5,295,600	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,200	5,620.00	12,364,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,300	211.00	3,228,300		
フィールズ	6,400	1,072.00	6,860,800		
双日	77,200	2,100.00	162,120,000		
アルフレッサホールディングス	77,900	1,667.00	129,859,300		
大黒天物産	2,300	4,375.00	10,062,500	貸付株式数	800株 (200株)

ハニーズホールディングス	6,200	1,198.00	7,427,600	貸付株式数	2,300株
ファーマライズＨＤ	1,700	708.00	1,203,600	貸付株式数	300株
キッコーマン	47,900	6,990.00	334,821,000		
味　の　素	153,300	3,027.00	464,039,100		
ブルドックソース	2,800	1,827.00	5,115,600	貸付株式数	1,100株
キユーピー	34,800	2,160.00	75,168,000		
ハウス食品Ｇ本社	24,800	2,725.00	67,580,000		
カ　ゴ　メ	28,300	3,275.00	92,682,500		
焼津水産化工	3,400	917.00	3,117,800	貸付株式数	1,200株
アリアケジャパン	6,800	5,250.00	35,700,000		
ピエトロ	1,100	1,809.00	1,989,900	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	2,985.00	5,074,500	貸付株式数	500株
やまみ	700	1,628.00	1,139,600		
ニチレイ	30,000	2,307.00	69,210,000		
横浜冷凍	18,100	852.00	15,421,200	貸付株式数	6,900株
東洋水産	34,200	4,810.00	164,502,000	貸付株式数	1,100株
イートアンドＨＬＤＧＳ	2,800	2,307.00	6,459,600	貸付株式数	1,000株
大冷	900	1,910.00	1,719,000	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,900	561.00	2,187,900	貸付株式数	1,400株
日清食品ＨＤ	25,700	8,550.00	219,735,000		
永谷園ホールディングス	3,400	1,965.00	6,681,000	貸付株式数	1,100株
一正蒲鉾	3,100	840.00	2,604,000	貸付株式数	1,100株
フジッコ	7,100	1,931.00	13,710,100		
ロックフィールド	7,600	1,418.00	10,776,800	貸付株式数	2,900株
日本たばこ産業	401,200	2,389.00	958,466,800	貸付株式数	144,800株
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,403.00	5,612,000		
わらべや日洋ＨＤ	4,600	1,710.00	7,866,000		
なとり	4,400	1,997.00	8,786,800	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,500	995.00	1,492,500	貸付株式数	200株
ピックルスコーポレーション	3,600	1,348.00	4,852,800		
ファーマフーズ	9,400	1,369.00	12,868,600	貸付株式数	3,600株
北の達人コーポ	26,700	209.00	5,580,300	貸付株式数	9,900株 (2,600株)
ユーグレナ	38,300	953.00	36,499,900	貸付株式数	14,700株
紀文食品	5,800	986.00	5,718,800	貸付株式数	2,200株
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	4,000	1,590.00	6,360,000		
ＳＲＥホールディングス	1,900	2,037.00	3,870,300	貸付株式数	700株

ＡＤワークスグループ	12,400	156.00	1,934,400	貸付株式数	5,300株
片倉工業	7,000	2,133.00	14,931,000		
グ　ン　ゼ	4,500	3,745.00	16,852,500	貸付株式数	600株
ヒューリック	165,700	1,088.00	180,281,600	貸付株式数	63,100株
神　栄	1,100	942.00	1,036,200	貸付株式数	200株
ラサ商事	3,200	975.00	3,120,000		
アルペン	5,500	1,990.00	10,945,000	貸付株式数	2,100株
ハブ	2,500	571.00	1,427,500	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	6,200	1,420.00	8,804,000	貸付株式数	2,400株
クオールホールディングス	9,000	1,312.00	11,808,000	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	9,200	1,324.00	12,180,800		
神戸物産	52,700	3,125.00	164,687,500	貸付株式数	20,200株
ソリトンシステムズ	3,700	1,302.00	4,817,400	貸付株式数	1,400株 (100株)
ジンズホールディングス	4,200	4,210.00	17,682,000	貸付株式数	200株
ビックカメラ	43,100	1,127.00	48,573,700	貸付株式数	16,600株
ＤＣＭホールディングス	43,200	1,080.00	46,656,000		
ペッパーフードサービス	10,000	434.00	4,340,000	貸付株式数	3,800株
ハイパー	2,200	483.00	1,062,600	貸付株式数	600株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	92,800	1,979.00	183,651,200		
東京一番フーズ	2,200	595.00	1,309,000	貸付株式数	600株
ＤＤホールディングス	3,900	620.00	2,418,000	貸付株式数	1,100株
あい　ホールディングス	10,400	1,664.00	17,305,600	貸付株式数	2,800株
ディーブイエックス	2,900	1,087.00	3,152,300	貸付株式数	900株
きちりホールディングス	2,300	407.00	936,100	貸付株式数	500株
アークランドサービスＨＤ	5,600	2,139.00	11,978,400	貸付株式数	2,100株
Ｊ．　フロント　リテイリング	83,700	1,132.00	94,748,400		
ドトール・日レスＨＤ	12,000	1,529.00	18,348,000		
マツキヨココカラ＆カンパニー	43,700	5,100.00	222,870,000		
ブロンコビリー	4,000	2,491.00	9,964,000	貸付株式数	1,500株
ＺＯＺＯ	50,400	2,731.00	137,642,400		
トレジャー・ファクトリー	2,300	1,048.00	2,410,400	貸付株式数	700株
物語コーポレーション	3,600	5,840.00	21,024,000	貸付株式数	1,300株
三越伊勢丹ＨＤ	116,500	1,116.00	130,014,000		
東洋紡	29,600	1,052.00	31,139,200		
ユニチカ	21,200	236.00	5,003,200		
富士紡ホールディングス	3,100	3,445.00	10,679,500		
日清紡ホールディングス	42,600	1,083.00	46,135,800		

倉敷紡績	5,700	2,020.00	11,514,000		
ダイワボウＨＤ	32,700	1,770.00	57,879,000		
シキボウ	3,300	908.00	2,996,400		
日東紡績	9,800	2,665.00	26,117,000		
トヨタ紡織	27,600	2,147.00	59,257,200		
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	17,500	2,951.00	51,642,500		
Ｈａｍｅｅ	2,700	1,241.00	3,350,700	貸付株式数	900株
マーケットエンタープライズ	800	1,107.00	885,600	貸付株式数	200株
ラクト・ジャパン	2,500	2,064.00	5,160,000	貸付株式数	1,000株 (400株)
ウエルシアＨＤ	38,900	2,550.00	99,195,000	貸付株式数	300株
クリエイトＳＤＨ	10,800	2,883.00	31,136,400	貸付株式数	3,700株
グリムス	3,300	1,536.00	5,068,800		
バイタルＫＳＫＨＤ	12,100	713.00	8,627,300		
八洲電機	4,700	989.00	4,648,300	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	4,500	1,027.00	4,621,500	貸付株式数	1,600株
レスターホールディングス	6,800	2,023.00	13,756,400	貸付株式数	1,600株
ジューテックＨＤ	1,500	1,032.00	1,548,000	貸付株式数	600株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	10,600	393.00	4,165,800	貸付株式数	3,200株
大光	3,200	717.00	2,294,400	貸付株式数	1,100株
ＯＣＨＩホールディングス	1,800	1,230.00	2,214,000	貸付株式数	700株
ＴＯＫＡＩホールディングス	35,600	874.00	31,114,400		
黒谷	1,900	604.00	1,147,600	貸付株式数	700株
ミサワ	1,600	633.00	1,012,800	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,000	1,365.00	1,365,000	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,800	729.00	2,041,200	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,500	458.00	687,000	貸付株式数	500株
三洋貿易	7,000	974.00	6,818,000		
チムニー	2,300	1,255.00	2,886,500	貸付株式数	800株
シュッピン	6,100	1,572.00	9,589,200	貸付株式数	2,200株
ビューティガレージ	1,200	2,776.00	3,331,200	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	10,500	1,857.00	19,498,500	貸付株式数	4,000株
ウイン・パートナーズ	5,900	1,022.00	6,029,800	貸付株式数	2,000株
ネクステージ	14,900	2,188.00	32,601,200		
ジョイフル本田	21,900	1,592.00	34,864,800	貸付株式数	8,400株

鳥貴族ホールディングス	2,500	2,026.00	5,065,000	貸付株式数	900株
ホットランド	5,700	1,342.00	7,649,400	貸付株式数	1,900株 (1,500株)
すかいらーくＨＤ	91,000	1,607.00	146,237,000	貸付株式数	35,800株
ＳＦＰホールディングス	3,700	1,607.00	5,945,900	貸付株式数	1,300株
綿半ホールディングス	5,400	1,335.00	7,209,000	貸付株式数	1,400株
日本毛織	19,300	959.00	18,508,700	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	10,000	92.00	920,000	貸付株式数	4,400株
トーア紡コーポレーション	2,100	381.00	800,100	貸付株式数	500株
ダイドーリミテツド	7,700	139.00	1,070,300	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,500	2,301.00	3,451,500	貸付株式数	500株
ユナイテッド・スーパーマーケ	21,100	1,067.00	22,513,700	貸付株式数	8,200株
三栄建築設計	2,900	1,657.00	4,805,300		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	38,200	3,265.00	124,723,000		
三重交通グループＨＤ	14,800	507.00	7,503,600	貸付株式数	5,300株
サムティ	10,400	2,036.00	21,174,400	貸付株式数	3,700株
地主	4,600	2,140.00	9,844,000	貸付株式数	1,800株
プレサンスコーポレーション	8,600	1,504.00	12,934,400	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,300	1,203.00	1,563,900	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,070.00	963,000	貸付株式数	200株
日本管理センター	3,400	1,017.00	3,457,800		
サンセイランディック	1,700	886.00	1,506,200	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	555.00	610,500		
フージャースＨＤ	9,300	822.00	7,644,600	貸付株式数	100株
オープンハウスグループ	23,400	5,340.00	124,956,000		
東急不動産ＨＤ	206,200	685.00	141,247,000		
飯田ＧＨＤ	61,400	2,104.00	129,185,600		
イーグランド	1,000	1,498.00	1,498,000		
帝国繊維	7,700	1,593.00	12,266,100	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	62,700	129.00	8,088,300		
ゴルフダイジェスト・オン	3,800	1,303.00	4,951,400	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,700	929.00	1,579,300	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,700	1,904.00	7,044,800	貸付株式数	1,400株
あさひ	6,400	1,316.00	8,422,400	貸付株式数	2,200株
日本調剤	4,500	1,282.00	5,769,000	貸付株式数	200株
コスモス薬品	7,400	12,000.00	88,800,000	貸付株式数	2,800株
シップヘルスケアＨＤ	21,700	2,365.00	51,320,500		

トーエル	3,300	880.00	2,904,000	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイトHD	3,200	4,150.00	13,280,000		
セブン&アイ・HLDGS	259,900	5,435.00	1,412,556,500		
クリエイト・レストランツ・ホール	45,700	945.00	43,186,500	貸付株式数	15,900株 (1,600株)
明治電機工業	3,000	1,113.00	3,339,000	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	16,000	6,750.00	108,000,000	貸付株式数	4,900株
デリカフーズHLDGS	3,000	528.00	1,584,000	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディングス	1,700	850.00	1,445,000	貸付株式数	600株
サンマルクホールディングス	6,000	1,562.00	9,372,000		
フェリシモ	1,700	1,181.00	2,007,700	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	18,200	2,305.00	41,951,000	貸付株式数	6,800株 (200株)
帝　人	65,900	1,378.00	90,810,200		
東　レ	477,700	682.30	325,934,710		
ク　ラ　レ	101,100	1,124.00	113,636,400		
旭　化　成	462,500	1,055.50	488,168,750		
TOKYO　BASE	6,900	352.00	2,428,800	貸付株式数	2,700株
稲葉製作所	3,800	1,325.00	5,035,000	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,100	3,450.00	7,245,000		
トーカロ	19,300	1,371.00	26,460,300		
アルファCO	2,300	965.00	2,219,500	貸付株式数	1,000株
SUMCO	118,900	2,124.00	252,543,600	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,300	3,355.00	4,361,500		
RS　TECHNOLOGIES	2,400	6,520.00	15,648,000		
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,238.00	2,238,000		
信和	4,500	790.00	3,555,000		
ビーロット	4,700	510.00	2,397,000		
ファーストブラザーズ	1,700	878.00	1,492,600	貸付株式数	200株 (200株)
AND　DOホールディングス	3,600	925.00	3,330,000	貸付株式数	1,400株
シーアールイー	2,500	1,654.00	4,135,000	貸付株式数	800株
プロパティエージェント	800	1,551.00	1,240,800	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	3,300	4,875.00	16,087,500		
アグレ都市デザイン	1,200	1,587.00	1,904,400	貸付株式数	400株

ジェイ・エス・ビー	1,500	3,530.00	5,295,000	貸付株式数	500株
ロードスターキャピタル	1,900	1,520.00	2,888,000	貸付株式数	700株
テンポイノベーション	1,900	870.00	1,653,000	貸付株式数	200株
グロバルリンクマネジメント	1,200	955.00	1,146,000	貸付株式数	300株
フェイスネットワーク	700	1,388.00	971,600		
住江織物	1,200	1,713.00	2,055,600	貸付株式数	500株
日本フエルト	4,400	434.00	1,909,600	貸付株式数	1,600株
イチカワ	700	1,393.00	975,100	貸付株式数	300株
エコナックホールディングス	13,500	92.00	1,242,000	貸付株式数	4,600株
日東製網	700	1,388.00	971,600	貸付株式数	100株
芦森工業	1,500	1,072.00	1,608,000	貸付株式数	200株
アツギ	5,100	538.00	2,743,800		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,300	940.00	1,222,000	貸付株式数	400株
ＪＭホールディングス	5,300	1,557.00	8,252,100		
コメダホールディングス	16,000	2,350.00	37,600,000	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	3,600	662.00	2,383,200	貸付株式数	1,100株
アレンザホールディングス	5,200	1,007.00	5,236,400	貸付株式数	2,000株
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	2,000	1,892.00	3,784,000	貸付株式数	700株
バロックジャパン	4,800	819.00	3,931,200	貸付株式数	1,900株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,800	5,490.00	37,332,000	貸付株式数	2,600株
ダイニック	2,300	689.00	1,584,700	貸付株式数	100株
共和レザー	3,600	587.00	2,113,200		
ピーバンドットコム	800	552.00	441,600	貸付株式数	300株
力の源ＨＤ	4,000	770.00	3,080,000	貸付株式数	1,300株
ＦＯＯＤ＆ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮ	39,400	2,971.00	117,057,400		
アセンテック	2,500	764.00	1,910,000	貸付株式数	900株
セーレン	14,000	1,981.00	27,734,000	貸付株式数	5,500株
ソトー	2,500	855.00	2,137,500		
東海染工	500	1,147.00	573,500	貸付株式数	100株
小松マテーレ	11,200	1,289.00	14,436,800		
ワコールホールディングス	16,200	2,148.00	34,797,600		
ホギメディカル	9,400	2,984.00	28,049,600	貸付株式数	400株
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,600	241.00	385,600		
ＴＳＩホールディングス	22,900	376.00	8,610,400	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,000	1,018.00	2,036,000	貸付株式数	800株
ワールド	9,500	1,489.00	14,145,500		
ＴＩＳ	65,900	3,430.00	226,037,000		

ＪＮＳホールディングス	3,100	412.00	1,277,200	貸付株式数	1,100株
グリー	33,200	906.00	30,079,200	貸付株式数	16,200株
GMOペパボ	800	2,178.00	1,742,400	貸付株式数	200株
コーエーテクモＨＤ	23,300	4,480.00	104,384,000		
三菱総合研究所	3,400	4,185.00	14,229,000		
ボルテージ	2,000	372.00	744,000	貸付株式数	800株
電算	600	2,307.00	1,384,200	貸付株式数	100株
ＡＧＳ	2,800	739.00	2,069,200	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	6,100	625.00	3,812,500	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	6,200	1,151.00	7,136,200		
ＫＬａｂ	12,800	489.00	6,259,200		
ポールトゥウィンホールディン	10,500	1,065.00	11,182,500	貸付株式数	2,800株
ネクソン	166,200	3,160.00	525,192,000		
アイスタイル	18,600	253.00	4,705,800	貸付株式数	7,600株
エムアップホールディングス	8,400	1,335.00	11,214,000		
エイチーム	4,600	750.00	3,450,000	貸付株式数	1,800株
エニグモ	8,100	562.00	4,552,200	貸付株式数	2,900株
テクノスジャパン	5,800	511.00	2,963,800	貸付株式数	100株
ｅｎｉｓｈ	5,100	312.00	1,591,200	貸付株式数	1,600株
コロプラ	24,000	636.00	15,264,000	貸付株式数	7,900株
オルトプラス	5,800	346.00	2,006,800	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	36,400	413.00	15,033,200	貸付株式数	12,800株
クロス・マーケティングＧ	2,800	818.00	2,290,400	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,300	1,767.00	5,831,100	貸付株式数	1,200株
システム情報	5,400	1,011.00	5,459,400	貸付株式数	2,000株
メディアドゥ	2,600	1,889.00	4,911,400	貸付株式数	100株
じげん	20,700	356.00	7,369,200		
ブイキューブ	7,500	992.00	7,440,000	貸付株式数	2,800株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	900	531.00	477,900	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,500	1,138.00	2,845,000	貸付株式数	900株
ディー・エル・イー	4,300	337.00	1,449,100		
フィックスターズ	7,200	911.00	6,559,200	貸付株式数	2,800株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,900	1,902.00	5,515,800	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,300	840.00	4,452,000	貸付株式数	1,900株 (1,800株)
セレス	2,700	1,344.00	3,628,800	貸付株式数	1,000株

ＳＨＩＦＴ	4,300	19,690.00	84,667,000		
特種東海製紙	4,000	3,195.00	12,780,000		
ティーガイア	6,600	1,644.00	10,850,400	貸付株式数	2,300株
セック	1,000	2,610.00	2,610,000	貸付株式数	100株
テクマトリックス	12,400	1,660.00	20,584,000	貸付株式数	3,900株
プロシップ	2,300	1,505.00	3,461,500	貸付株式数	800株
ガンホー・オンライン・エンター	19,000	2,405.00	45,695,000	貸付株式数	7,300株
GMOペイメントゲートウェイ	14,200	10,720.00	152,224,000		
ザッパラス	2,600	396.00	1,029,600		
システムリサーチ	2,000	2,038.00	4,076,000	貸付株式数	700株
インターネットイニシアティブ	19,500	4,640.00	90,480,000		
さくらインターネット	7,700	575.00	4,427,500	貸付株式数	3,100株
ヴィンクス	2,000	1,078.00	2,156,000		
GMOグローバルサインHD	1,600	6,100.00	9,760,000	貸付株式数	600株
ＳＲＡホールディングス	3,500	2,840.00	9,940,000		
システムインテグレータ	1,900	486.00	923,400	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,700	608.00	4,073,600		
ｅＢＡＳＥ	8,800	520.00	4,576,000	貸付株式数	300株
アバント	7,800	1,340.00	10,452,000		
アドソル日進	2,600	1,576.00	4,097,600	貸付株式数	1,000株
ＯＤＫソリューションズ	1,300	576.00	748,800		
フリービット	3,800	923.00	3,507,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
コムチュア	8,200	2,830.00	23,206,000		
サイバーコム	900	1,129.00	1,016,100		
アステリア	5,300	1,252.00	6,635,600	貸付株式数	1,900株
アイル	3,700	1,447.00	5,353,900	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	289,800	561.00	162,577,800		
日本製紙	31,600	957.00	30,241,200	貸付株式数	12,200株
三菱製紙	8,100	301.00	2,438,100		
北越コーポレーション	44,900	645.00	28,960,500		
中越パルプ	2,400	915.00	2,196,000	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,700	635.00	1,714,500		
大王製紙	32,500	1,437.00	46,702,500		
阿波製紙	1,000	324.00	324,000	貸付株式数	400株
マークラインズ	3,700	2,389.00	8,839,300		

メディカル・データ・ビジ	9,400	960.00	9,024,000	貸付株式数	3,500株
ｇｕｍｉ	10,200	548.00	5,589,600		
ショーケース	1,600	454.00	726,400	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,700	1,121.00	1,905,700	貸付株式数	600株
テラスカイ	2,700	1,443.00	3,896,100	貸付株式数	1,000株
デジタル・インフォメーション	3,200	1,432.00	4,582,400		
ＰＣＩホールディングス	3,000	1,044.00	3,132,000	貸付株式数	1,200株
パイプドＨＤ	1,300	2,809.00	3,651,700	貸付株式数	500株
アイビーシー	900	504.00	453,600	貸付株式数	200株
ネオジャパン	2,000	1,242.00	2,484,000	貸付株式数	600株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,600	2,164.00	3,462,400	貸付株式数	600株
ラクス	33,600	1,537.00	51,643,200		
ランドコンピュータ	1,300	942.00	1,224,600	貸付株式数	600株
ダブルスタンダード	2,200	1,969.00	4,331,800	貸付株式数	800株
オープンドア	4,400	2,066.00	9,090,400	貸付株式数	1,600株
マイネット	2,600	525.00	1,365,000	貸付株式数	1,000株
アカツキ	3,300	2,841.00	9,375,300		
ベネフィットジャパン	600	1,993.00	1,195,800	貸付株式数	200株
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,900	2,700.00	5,130,000	貸付株式数	300株
カナミックネットワーク	9,200	509.00	4,682,800	貸付株式数	2,800株
ノムラシステムコーポレーション	3,500	234.00	819,000	貸付株式数	1,500株
レンゴー	61,000	708.00	43,188,000		
トーモク	3,800	1,520.00	5,776,000		
ザ・パック	5,000	2,303.00	11,515,000	貸付株式数	400株
チェンジ	14,700	1,797.00	26,415,900		
シンクロ・フード	4,000	321.00	1,284,000	貸付株式数	1,400株
オークネット	3,900	1,716.00	6,692,400	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,200	710.00	852,000	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,900	553.00	1,050,700	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,000	2,046.00	2,046,000	貸付株式数	500株
マクロミル	14,600	999.00	14,585,400		
ビーグリー	1,700	1,455.00	2,473,500		
オロ	2,300	1,831.00	4,211,300	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,200	1,740.00	3,828,000	貸付株式数	800株
テモナ	1,600	385.00	616,000	貸付株式数	600株
ニーズウェル	1,800	684.00	1,231,200	貸付株式数	500株

マネーフォワード	14,900	3,340.00	49,766,000	貸付株式数	4,100株
サインポスト	2,300	886.00	2,037,800	貸付株式数	900株
昭和電工	63,900	2,604.00	166,395,600		
住友化学	510,800	541.00	276,342,800		
住友精化	3,000	2,976.00	8,928,000	貸付株式数	400株
日産化学	35,300	7,510.00	265,103,000		
ラサ工業	2,600	2,026.00	5,267,600		
クレハ	5,400	10,250.00	55,350,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,500	4,690.00	11,725,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,600	1,303.00	5,993,800		
石原産業	12,600	1,177.00	14,830,200	貸付株式数	100株
片倉コープアグリ	1,800	1,460.00	2,628,000	貸付株式数	200株
日本曹達	8,400	4,170.00	35,028,000	貸付株式数	900株
東ソー	95,300	1,828.00	174,208,400		
トクヤマ	22,300	1,736.00	38,712,800		
セントラル硝子	11,200	3,030.00	33,936,000	貸付株式数	100株
東亞合成	36,700	1,046.00	38,388,200		
大阪ソーダ	5,900	3,060.00	18,054,000	貸付株式数	2,500株
関東電化	14,100	950.00	13,395,000	貸付株式数	100株
デンカ	25,300	3,265.00	82,604,500		
イビデン	37,000	4,575.00	169,275,000		
信越化学	118,900	18,420.00	2,190,138,000		
日本カーバイド	2,500	1,431.00	3,577,500		
電算システムＨＤ	3,000	2,373.00	7,119,000		
堺　化　学	4,900	1,934.00	9,476,600	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,400	1,110.00	7,104,000	貸付株式数	2,400株
エア・ウォーター	61,900	1,724.00	106,715,600		
日本酸素ＨＬＤＧＳ	63,400	2,476.00	156,978,400		
日本化学工業	2,100	2,123.00	4,458,300		
東邦アセチレン	1,600	1,178.00	1,884,800		
日本パーカライジング	32,600	916.00	29,861,600		
高圧ガス	11,000	653.00	7,183,000		
チタン工業	900	1,806.00	1,625,400	貸付株式数	300株
四国化成	8,700	1,250.00	10,875,000		
戸田工業	1,500	2,782.00	4,173,000		
ステラ　ケミファ	3,600	2,565.00	9,234,000	貸付株式数	1,200株
保土谷化学	2,100	3,645.00	7,654,500		
日本触媒	10,900	5,450.00	59,405,000		
大日精化	5,400	1,899.00	10,254,600		
カネカ	16,700	3,345.00	55,861,500		

協和キリン	79,200	2,759.00	218,512,800		
三菱瓦斯化学	60,900	2,136.00	130,082,400		
三井化学	60,000	3,230.00	193,800,000		
ＪＳＲ	68,000	4,160.00	282,880,000	貸付株式数	25,600株
東京応化工業	11,200	7,540.00	84,448,000		
大阪有機化学	5,500	2,739.00	15,064,500	貸付株式数	700株
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	464,600	783.60	364,060,560		
ＫＨネオケム	11,400	2,595.00	29,583,000	貸付株式数	4,300株
ダイセル	99,200	845.00	83,824,000		
住友ベークライト	10,700	4,520.00	48,364,000		
積水化学	145,400	1,860.00	270,444,000		
日本ゼオン	58,000	1,401.00	81,258,000		
アイカ工業	18,200	2,854.00	51,942,800		
ＵＢＥ	34,400	2,049.00	70,485,600		
積水樹脂	10,300	1,706.00	17,571,800		
タキロンシーアイ	17,200	542.00	9,322,400		
旭有機材	4,500	2,179.00	9,805,500		
ニチバン	4,100	1,615.00	6,621,500	貸付株式数	1,500株
リケンテクノス	16,100	440.00	7,084,000		
大倉工業	3,200	1,742.00	5,574,400	貸付株式数	1,300株
積水化成品	14,700	414.00	6,085,800		
群栄化学	1,600	2,720.00	4,352,000		
タイガース　ポリマー	7,500	433.00	3,247,500	貸付株式数	1,600株
ミライアル	2,300	1,887.00	4,340,100		
ダイキアクシス	2,700	761.00	2,054,700	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	17,300	510.00	8,823,000		
竹本容器	2,500	825.00	2,062,500	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,600	1,922.00	6,919,200		
恵和	2,000	4,460.00	8,920,000		
日本化薬	52,400	1,115.00	58,426,000		
カーリットホールディングス	6,200	736.00	4,563,200	貸付株式数	2,500株
ソルクシーズ	6,200	381.00	2,362,200	貸付株式数	2,300株
ＣＬホールディングス	1,500	1,016.00	1,524,000	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	26,500	646.00	17,119,000		
フェイス	1,900	682.00	1,295,800	貸付株式数	700株
プロトコーポレーション	7,900	987.00	7,797,300	貸付株式数	1,400株
ハイマックス	1,900	1,297.00	2,464,300	貸付株式数	600株
アミューズ	3,900	2,101.00	8,193,900		
野村総合研究所	132,000	3,590.00	473,880,000		

ドリームインキュベータ	2,100	2,275.00	4,777,500	貸付株式数	700株
サイバネットシステム	5,200	731.00	3,801,200		
クイック	4,600	1,415.00	6,509,000		
ＴＡＣ	2,300	228.00	524,400		
ＣＥホールディングス	3,400	455.00	1,547,000	貸付株式数	1,400株
日本システム技術	1,300	2,492.00	3,239,600		
電通グループ	69,000	4,275.00	294,975,000		
インテージホールディングス	8,400	1,417.00	11,902,800		
テイクアンドギヴニーズ	3,300	1,690.00	5,577,000		
東邦システムサイエンス	1,600	933.00	1,492,800	貸付株式数	600株
ぴあ	2,300	3,555.00	8,176,500	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	2,700	2,554.00	6,895,800	貸付株式数	1,000株
ソースネクスト	31,600	265.00	8,374,000	貸付株式数	11,900株 (1,200株)
シーティーエス	8,000	855.00	6,840,000	貸付株式数	3,000株
ネクシィーズグループ	2,300	530.00	1,219,000	貸付株式数	800株
インフォコム	8,000	2,160.00	17,280,000		
メディカルシステムネットワーク	6,700	437.00	2,927,900		
日本精化	5,100	2,014.00	10,271,400	貸付株式数	2,100株
扶桑化学工業	6,000	4,010.00	24,060,000		
トリケミカル	7,500	2,664.00	19,980,000		
シンプレクスＨＤ	11,600	1,955.00	22,678,000		
ＨＥＲＯＺ	2,100	946.00	1,986,600	貸付株式数	700株 (700株)
ラクスル	8,500	2,141.00	18,198,500	貸付株式数	3,100株
ＩＰＳ	2,000	2,417.00	4,834,000	貸付株式数	700株
ＦＩＧ	7,600	321.00	2,439,600	貸付株式数	2,700株
システムサポート	2,600	1,231.00	3,200,600	貸付株式数	1,000株
ＡＤＥＫＡ	30,400	2,533.00	77,003,200		
日油	22,300	5,180.00	115,514,000		
ミヨシ油脂	2,800	1,045.00	2,926,000	貸付株式数	900株
新日本理化	10,900	264.00	2,877,600	貸付株式数	800株
ハリマ化成グループ	5,000	770.00	3,850,000		
イーソル	4,500	585.00	2,632,500	貸付株式数	1,600株
アルテリア・ネットワークス	7,600	1,267.00	9,629,200	貸付株式数	100株
東海ソフト	1,100	1,018.00	1,119,800	貸付株式数	400株
ウイングアーク１ＳＴ	5,600	1,421.00	7,957,600		

ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,700	1,656.00	2,815,200	貸付株式数	500株
サーバーワークス	1,300	2,098.00	2,727,400	貸付株式数	400株
東名	700	1,090.00	763,000	貸付株式数	100株
ヴィッツ	600	1,184.00	710,400		
トビラシステムズ	1,400	804.00	1,125,600	貸付株式数	500株
Ｓａｎｓａｎ	24,200	998.00	24,151,600	貸付株式数	9,200株
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,400	670.00	938,000	貸付株式数	500株
ギフティ	6,200	1,120.00	6,944,000	貸付株式数	2,300株
花　王	157,600	5,254.00	828,030,400		
第一工業製薬	2,600	2,285.00	5,941,000		
石原ケミカル	3,600	1,346.00	4,845,600		
日華化学	2,500	855.00	2,137,500	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,286.00	3,200,400	貸付株式数	500株
三洋化成	4,300	4,715.00	20,274,500		
ベース	1,200	6,020.00	7,224,000	貸付株式数	400株
ＪＭＤＣ	9,200	5,400.00	49,680,000	貸付株式数	3,500株
武田薬品	585,900	3,649.00	2,137,949,100		
アステラス製薬	637,300	2,048.50	1,305,509,050		
住友ファーマ	46,100	1,096.00	50,525,600		
塩野義製薬	88,900	6,857.00	609,587,300		
わかもと製薬	7,700	262.00	2,017,400	貸付株式数	3,000株
日本新薬	17,300	7,500.00	129,750,000		
中外製薬	233,200	3,542.00	825,994,400		
科研製薬	10,900	3,680.00	40,112,000	貸付株式数	500株
エーザイ	84,700	5,257.00	445,267,900		
理研ビタミン	6,700	1,607.00	10,766,900		
ロート製薬	36,400	3,305.00	120,302,000		
小野薬品	151,700	3,257.00	494,086,900		
久光製薬	17,100	3,355.00	57,370,500		
有機合成薬品	5,200	285.00	1,482,000		
持田製薬	8,600	3,135.00	26,961,000	貸付株式数	100株
参天製薬	133,000	1,004.00	133,532,000		
扶桑薬品	2,500	2,126.00	5,315,000		
日本ケミファ	900	1,913.00	1,721,700		
ツムラ	21,900	2,922.00	63,991,800		
日医工	21,800	352.00	7,673,600	貸付株式数	8,500株
テ　ル　モ	210,800	4,130.00	870,604,000		
ＨＵグループＨＤ	18,600	2,656.00	49,401,600		
キッセイ薬品工業	11,500	2,511.00	28,876,500		

生化学工業	13,000	799.00	10,387,000		
栄研化学	11,700	1,614.00	18,883,800		
日水製薬	2,900	1,702.00	4,935,800		
鳥居薬品	4,000	2,990.00	11,960,000		
ＪＣＲファーマ	21,000	2,311.00	48,531,000		
東和薬品	10,700	2,452.00	26,236,400		
富士製薬工業	4,300	934.00	4,016,200		
ゼリア新薬工業	11,800	2,068.00	24,402,400	貸付株式数	4,900株
第一三共	555,800	3,400.00	1,889,720,000		
キョーリン製薬ＨＤ	13,900	1,687.00	23,449,300	貸付株式数	100株
大幸薬品	11,200	576.00	6,451,200	貸付株式数	4,300株
ダイト	4,700	2,671.00	12,553,700		
大塚ホールディングス	146,300	4,365.00	638,599,500		
大正製薬ＨＤ	15,100	4,810.00	72,631,000		
ペプチドリーム	39,200	1,445.00	56,644,000		
大日本塗料	8,400	759.00	6,375,600	貸付株式数	3,100株
日本ペイントＨＯＬＤ	274,300	969.00	265,796,700		
関西ペイント	67,300	1,724.00	116,025,200		
神東塗料	6,800	157.00	1,067,600	貸付株式数	2,100株
中国塗料	16,200	881.00	14,272,200	貸付株式数	5,200株
日本特殊塗料	4,600	940.00	4,324,000		
藤倉化成	8,700	477.00	4,149,900	貸付株式数	100株
太陽ホールディングス	10,600	3,115.00	33,019,000		
ＤＩＣ	27,800	2,538.00	70,556,400	貸付株式数	11,000株
サカタインクス	14,300	937.00	13,399,100	貸付株式数	5,300株
東洋インキＳＣホールディン	14,200	1,977.00	28,073,400	貸付株式数	5,600株
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,900	838.00	4,944,200		
アルプス技研	5,900	1,899.00	11,204,100		
サニックス	12,300	243.00	2,988,900	貸付株式数	4,800株 (300株)
ダイオーズ	1,200	1,071.00	1,285,200	貸付株式数	400株
日本空調サービス	7,600	809.00	6,148,400		
オリエンタルランド	78,600	19,360.00	1,521,696,000		
フォーカスシステムズ	4,500	919.00	4,135,500	貸付株式数	1,600株
ダスキン	15,700	2,722.00	42,735,400		
パーク２４	43,600	2,085.00	90,906,000	貸付株式数	5,500株
明光ネットワークジャパン	8,100	602.00	4,876,200	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	3,100	2,094.00	6,491,400	貸付株式数	400株
クレスコ	5,300	2,146.00	11,373,800		

フジ・メディア・ＨＤ	66,600	1,129.00	75,191,400		
秀英予備校	2,200	435.00	957,000	貸付株式数	800株
田谷	1,600	572.00	915,200	貸付株式数	600株
ラウンドワン	19,900	1,605.00	31,939,500		
リゾートトラスト	31,000	2,185.00	67,735,000		
オービック	23,100	19,190.00	443,289,000		
ジャストシステム	10,400	4,295.00	44,668,000		
ＴＤＣソフト	6,000	1,052.00	6,312,000		
Ｚホールディングス	1,054,800	436.10	459,998,280		
ビー・エム・エル	9,000	3,460.00	31,140,000		
トレンドマイクロ	37,000	7,420.00	274,540,000		
りらいあコミュニケーショ	10,500	1,092.00	11,466,000		
ＩＤホールディングス	4,200	854.00	3,586,800		
リソー教育	32,700	346.00	11,314,200	貸付株式数	200株
日本オラクル	11,900	7,830.00	93,177,000		
早稲田アカデミー	3,700	1,137.00	4,206,900	貸付株式数	400株
アルファシステムズ	1,900	4,195.00	7,970,500	貸付株式数	700株
フューチャー	15,500	1,688.00	26,164,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,800	1,410.00	5,358,000		
ＳＢテクノロジー	3,200	2,340.00	7,488,000		
トーセ	2,300	760.00	1,748,000	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	79,700	2,416.00	192,555,200		
オービックビジネスＣ	7,000	4,565.00	31,955,000		
伊藤忠テクノソリュー	33,400	3,245.00	108,383,000		
アイティフォー	8,700	797.00	6,933,900		
東京個別指導学院	6,200	607.00	3,763,400	貸付株式数	2,400株
東計電算	800	5,980.00	4,784,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	160,000	1,379.00	220,640,000	貸付株式数	64,600株
楽天グループ	342,400	720.00	246,528,000	貸付株式数	137,500株
エックスネット	700	1,005.00	703,500	貸付株式数	200株
クリーク・アンド・リバー社	3,700	2,092.00	7,740,400	貸付株式数	1,300株
モーニングスター	12,500	530.00	6,625,000	貸付株式数	4,800株
テー・オー・ダブリュー	13,500	336.00	4,536,000	貸付株式数	4,200株
大塚商会	39,600	4,050.00	160,380,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,900	1,063.00	10,523,700		
山田コンサルティングＧＰ	3,700	1,149.00	4,251,300	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,600	2,467.00	6,414,200	貸付株式数	1,000株
パラカ	1,900	1,821.00	3,459,900	貸付株式数	600株
電通国際情報Ｓ	9,600	4,170.00	40,032,000	貸付株式数	3,800株

ＡＣＣＥＳＳ	8,200	679.00	5,567,800	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	12,100	4,040.00	48,884,000	貸付株式数	4,400株
イーエムシステムズ	12,100	950.00	11,495,000	貸付株式数	4,400株
ウェザーニューズ	2,300	6,540.00	15,042,000	貸付株式数	600株
ＣＩＪ	5,200	797.00	4,144,400		
ビジネスエンジニアリング	1,600	2,052.00	3,283,200	貸付株式数	400株
日本エンタープライズ	6,700	160.00	1,072,000	貸付株式数	400株
WOWOW	3,500	1,498.00	5,243,000	貸付株式数	400株
スカラ	6,100	778.00	4,745,800		
インテリジェント　ウェイブ	3,300	693.00	2,286,900	貸付株式数	1,300株
フルキャストホールディングス	6,000	2,250.00	13,500,000		
エン・ジャパン	12,300	1,905.00	23,431,500		
あすか製薬ＨＤ	7,500	1,005.00	7,537,500		
サワイグループＨＤ	14,900	3,850.00	57,365,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	131,000	7,074.00	926,694,000		
コニカミノルタ	155,000	458.00	70,990,000		
資　生　堂	138,900	5,609.00	779,090,100		
ライオン	79,000	1,459.00	115,261,000	貸付株式数	32,500株
高砂香料	4,500	2,384.00	10,728,000		
マンダム	14,800	1,515.00	22,422,000		
ミルボン	9,200	5,110.00	47,012,000	貸付株式数	2,200株
ファンケル	30,200	2,325.00	70,215,000		
コーセー	14,000	12,150.00	170,100,000		
コタ	5,300	1,445.00	7,658,500		
シーボン	1,000	1,763.00	1,763,000	貸付株式数	300株
ポーラ・オルビスＨＤ	31,800	1,580.00	50,244,000	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,700	5,630.00	32,091,000		
アジュバンホールディング	1,800	998.00	1,796,400	貸付株式数	600株
新日本製薬	3,000	1,403.00	4,209,000	貸付株式数	900株 (500株)
エステー	4,900	1,472.00	7,212,800	貸付株式数	400株
アグロカネショウ	2,500	1,350.00	3,375,000	貸付株式数	900株
コ　ニ　シ	12,200	1,599.00	19,507,800		
長谷川香料	12,700	2,518.00	31,978,600	貸付株式数	500株
星光ＰＭＣ	4,400	573.00	2,521,200		
小林製薬	20,900	8,580.00	179,322,000		
荒川化学工業	5,600	1,010.00	5,656,000	貸付株式数	1,800株
メック	5,200	2,811.00	14,617,200	貸付株式数	100株

日本高純度化学	1,900	2,357.00	4,478,300		
タカラバイオ	19,500	1,865.00	36,367,500		
ＪＣＵ	7,800	3,710.00	28,938,000		
新田ゼラチン	4,300	614.00	2,640,200	貸付株式数	900株
ＯＡＴアグリオ	3,000	1,697.00	5,091,000		
デクセリアルズ	19,400	4,320.00	83,808,000		
アース製薬	6,100	5,140.00	31,354,000		
北興化学	6,500	1,128.00	7,332,000		
大成ラミック	2,000	2,706.00	5,412,000		
クミアイ化学	27,500	1,062.00	29,205,000		
日本農薬	13,200	868.00	11,457,600		
富士興産	1,800	1,149.00	2,068,200		
ニチレキ	8,500	1,314.00	11,169,000		
ユシロ化学	3,500	1,004.00	3,514,000		
ビーピー・カストロール	2,600	1,223.00	3,179,800		
富士石油	17,400	342.00	5,950,800		
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,600	1,271.00	3,304,600		
出光興産	78,200	3,800.00	297,160,000		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,122,000	561.50	630,003,000		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	26,800	3,930.00	105,324,000		
テスホールディングス	6,500	1,346.00	8,749,000	貸付株式数	2,400株
インフロニアＨＤ	90,700	915.00	82,990,500		
横浜ゴム	37,900	1,762.00	66,779,800		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	36,800	1,813.00	66,718,400		
ブリヂストン	203,800	5,196.00	1,058,944,800		
住友ゴム	62,900	1,226.00	77,115,400		
藤倉コンポジット	6,500	882.00	5,733,000	貸付株式数	2,400株
オカモト	4,300	3,880.00	16,684,000		
アキレス	5,200	1,367.00	7,108,400	貸付株式数	500株
フ　コ　ク	2,900	981.00	2,844,900		
ニッタ	8,000	2,952.00	23,616,000		
クリエートメディック	3,000	998.00	2,994,000	貸付株式数	700株
住友理工	16,200	567.00	9,185,400		
三ツ星ベルト	9,200	2,870.00	26,404,000		
バンドー化学	13,900	913.00	12,690,700	貸付株式数	100株
ＡＧＣ	65,000	5,100.00	331,500,000		
日本板硝子	34,500	420.00	14,490,000		
石塚硝子	1,400	1,748.00	2,447,200	貸付株式数	400株

有沢製作所	10,200	1,105.00	11,271,000	貸付株式数	1,100株
日本山村硝子	1,900	749.00	1,423,100		
日本電気硝子	28,400	2,820.00	80,088,000		
オハラ	2,900	1,276.00	3,700,400	貸付株式数	1,100株 (100株)
住友大阪セメント	12,600	3,230.00	40,698,000		
太平洋セメント	42,400	1,943.00	82,383,200		
リソルホールディングス	700	4,670.00	3,269,000	貸付株式数	300株
日本ヒユーム	6,000	696.00	4,176,000		
日本コンクリート	13,300	287.00	3,817,100	貸付株式数	100株
三谷セキサン	3,200	4,970.00	15,904,000		
アジアパイルＨＤ	9,800	455.00	4,459,000		
東海カーボン	59,100	1,182.00	69,856,200		
日本カーボン	3,800	4,355.00	16,549,000		
東洋炭素	4,900	2,996.00	14,680,400		
ノリタケ	3,900	4,290.00	16,731,000		
ＴＯＴＯ	47,900	4,360.00	208,844,000		
日本碍子	76,000	1,947.00	147,972,000		
日本特殊陶業	53,500	2,530.00	135,355,000		
ダントーホールディングス	4,800	304.00	1,459,200	貸付株式数	1,800株
ＭＡＲＵＷＡ	2,600	16,130.00	41,938,000		
品川リフラクトリーズ	1,700	3,680.00	6,256,000		
黒崎播磨	1,200	4,360.00	5,232,000		
ヨータイ	4,600	1,505.00	6,923,000		
東京窯業	6,700	281.00	1,882,700	貸付株式数	1,800株
ニッカトー	2,800	504.00	1,411,200	貸付株式数	1,300株
フジミインコーポレーテッド	6,000	6,060.00	36,360,000		
クニミネ工業	2,000	955.00	1,910,000	貸付株式数	900株
エーアンドエーマテリアル	500	881.00	440,500	貸付株式数	300株
ニチアス	16,300	2,271.00	37,017,300	貸付株式数	800株
日本製鉄	315,400	2,229.50	703,184,300		
神戸製鋼所	131,700	709.00	93,375,300		
中山製鋼所	10,400	441.00	4,586,400		
合同製鐵	3,600	1,388.00	4,996,800		
ＪＦＥホールディングス	180,300	1,579.00	284,693,700		
東京製鐵	22,700	1,609.00	36,524,300		
共英製鋼	7,500	1,375.00	10,312,500		
大和工業	12,500	4,575.00	57,187,500	貸付株式数	100株
東京鐵鋼	2,900	1,245.00	3,610,500	貸付株式数	1,100株

大阪製鐵	3,800	1,467.00	5,574,600		
淀川製鋼所	8,600	2,299.00	19,771,400	貸付株式数	400株
丸一鋼管	22,000	3,065.00	67,430,000		
モリ工業	1,900	2,483.00	4,717,700		
大同特殊鋼	10,600	3,725.00	39,485,000		
日本高周波	2,000	345.00	690,000	貸付株式数	800株
日本冶金工	5,100	2,311.00	11,786,100		
山陽特殊製鋼	6,700	2,220.00	14,874,000		
愛知製鋼	4,100	2,178.00	8,929,800		
日立金属	71,500	2,092.00	149,578,000		
日本金属	1,800	1,230.00	2,214,000	貸付株式数	600株
大平洋金属	4,500	2,914.00	13,113,000		
新日本電工	42,900	377.00	16,173,300		
栗本鉄工所	2,900	1,654.00	4,796,600		
虹　技	700	1,002.00	701,400	貸付株式数	100株
日本鋳鉄管	800	1,009.00	807,200	貸付株式数	200株
日本製鋼所	19,800	3,395.00	67,221,000		
三菱製鋼	4,700	995.00	4,676,500	貸付株式数	1,400株
日亜鋼業	7,600	266.00	2,021,600		
日本精線	1,200	4,295.00	5,154,000	貸付株式数	300株
エンビプロＨＤ	4,900	944.00	4,625,600	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	9,800	1,358.00	13,308,400		
日本軽金属ＨＤ	18,700	1,617.00	30,237,900		
三井金属	19,900	3,440.00	68,456,000		
東邦亜鉛	3,900	2,433.00	9,488,700		
三菱マテリアル	44,700	2,057.00	91,947,900		
住友鉱山	85,300	5,514.00	470,344,200		
ＤＯＷＡホールディングス	18,200	4,820.00	87,724,000		
古河機金	11,100	1,263.00	14,019,300		
エス・サイエンス	33,300	28.00	932,400	貸付株式数	9,700株
大阪チタニウム	8,500	2,612.00	22,202,000		
東邦チタニウム	13,200	2,548.00	33,633,600	貸付株式数	400株
ＵＡＣＪ	10,500	2,311.00	24,265,500		
ＣＫサンエツ	1,400	4,100.00	5,740,000	貸付株式数	500株
古河電工	22,000	2,249.00	49,478,000		
住友電工	263,300	1,479.50	389,552,350		
フジクラ	82,300	804.00	66,169,200		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	6,400	1,817.00	11,628,800	貸付株式数	100株
東京特殊電線	900	2,356.00	2,120,400	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,700	489.00	6,210,300		

カナレ電気	1,100	1,685.00	1,853,500	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,800	1,133.00	4,305,400	貸付株式数	1,400株
リョービ	7,700	1,145.00	8,816,500		
アーレステイ	7,400	391.00	2,893,400	貸付株式数	1,100株
アサヒＨＤ	29,500	2,136.00	63,012,000		
東洋製罐グループＨＤ	40,700	1,416.00	57,631,200		
ホッカンホールディングス	5,000	1,249.00	6,245,000	貸付株式数	1,400株
コロナ	3,600	836.00	3,009,600		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11,300	1,939.00	21,910,700		
駒井ハルテック	1,200	1,721.00	2,065,200		
高田機工	500	2,515.00	1,257,500	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	69,700	1,282.00	89,355,400		
文化シヤッター	22,100	988.00	21,834,800	貸付株式数	8,500株
三協立山	9,500	587.00	5,576,500		
アルインコ	4,700	864.00	4,060,800	貸付株式数	1,800株
東洋シヤッター	1,600	640.00	1,024,000		
ＬＩＸＩＬ	116,100	2,474.00	287,231,400		
日本フイルコン	7,100	500.00	3,550,000	貸付株式数	2,100株
ノーリツ	12,600	1,536.00	19,353,600		
長府製作所	7,300	1,799.00	13,132,700		
リンナイ	13,200	8,820.00	116,424,000		
ユニプレス	11,800	908.00	10,714,400		
ダイニチ工業	3,500	648.00	2,268,000	貸付株式数	1,300株
日東精工	9,800	511.00	5,007,800		
三洋工業	900	1,784.00	1,605,600	貸付株式数	100株
岡　部	11,600	634.00	7,354,400		
ジーテクト	8,300	1,319.00	10,947,700		
東　プ　レ	12,000	1,071.00	12,852,000		
高周波熱錬	12,100	704.00	8,518,400		
東京製綱	4,500	985.00	4,432,500		
サンコール	6,000	663.00	3,978,000		
モリテックスチル	5,800	312.00	1,809,600	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,800	1,923.00	18,845,400		
エイチワン	6,300	615.00	3,874,500		
日本発条	63,300	928.00	58,742,400	貸付株式数	100株
中央発條	4,700	707.00	3,322,900		
アドバネクス	1,200	1,579.00	1,894,800	貸付株式数	300株
三浦工業	29,800	2,809.00	83,708,200		
タ　ク　マ	22,100	1,480.00	32,708,000		

テクノプロ・ホールディング	42,700	2,990.00	127,673,000	貸付株式数	15,700株
アトラグループ	1,900	205.00	389,500	貸付株式数	600株
インターワークス	2,000	387.00	774,000	貸付株式数	500株
アイ・アールジャパンＨＤ	3,300	3,570.00	11,781,000		
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,600	3,535.00	16,261,000		
ファーストロジック	1,300	764.00	993,200	貸付株式数	500株
三機サービス	1,100	1,015.00	1,116,500	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	3,900	909.00	3,545,100	貸付株式数	1,400株
デザインワン・ジャパン	2,300	184.00	423,200	貸付株式数	700株
イー・ガーディアン	2,600	3,070.00	7,982,000		
リブセンス	4,100	169.00	692,900	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	21,900	1,799.00	39,398,100		
ベクトル	10,000	1,067.00	10,670,000	貸付株式数	3,600株
ウチヤマホールディングス	2,800	308.00	862,400	貸付株式数	1,400株
チャームケアコーポレーション	5,300	1,043.00	5,527,900	貸付株式数	2,100株
キャリアリンク	2,600	1,931.00	5,020,600	貸付株式数	1,000株
ＩＢＪ	6,000	722.00	4,332,000	貸付株式数	2,300株
アサンテ	3,100	1,509.00	4,677,900	貸付株式数	1,000株
バリューＨＲ	6,000	1,246.00	7,476,000	貸付株式数	2,100株
Ｍ＆Ａキャピタルパートナー	5,900	3,380.00	19,942,000	貸付株式数	300株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,800	1,217.00	3,407,600	貸付株式数	1,000株
ＥＲＩホールディングス	2,000	1,400.00	2,800,000		
アビスト	1,100	2,881.00	3,169,100	貸付株式数	400株 (300株)
シグマクシス・ホールディンク	8,500	1,060.00	9,010,000		
ウィルグループ	5,200	1,179.00	6,130,800		
エスクローＡＪ	8,400	173.00	1,453,200	貸付株式数	3,300株
メドピア	5,200	2,020.00	10,504,000	貸付株式数	1,900株
レアジョブ	1,300	568.00	738,400	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	523,400	4,536.00	2,374,142,400		
エラン	9,900	1,039.00	10,286,100		
ツ　ガ　ミ	15,700	1,237.00	19,420,900		
オークマ	7,700	5,580.00	42,966,000		

芝浦機械	8,300	3,260.00	27,058,000		
アマダ	115,500	1,059.00	122,314,500		
アイダエンジニア	17,900	943.00	16,879,700		
滝澤鉄工所	2,700	1,282.00	3,461,400		
ＦＵＪＩ	30,700	2,183.00	67,018,100		
牧野フライス	7,700	4,720.00	36,344,000	貸付株式数	100株
オーエスジー	32,700	1,673.00	54,707,100		
ダイジェット	1,300	916.00	1,190,800		
旭ダイヤモンド	19,300	608.00	11,734,400		
ＤＭＧ森精機	41,400	1,928.00	79,819,200		
ソディツク	17,100	835.00	14,278,500	貸付株式数	3,700株
ディスコ	10,900	35,250.00	384,225,000		
日東工器	4,600	1,550.00	7,130,000		
日進工具	6,100	1,304.00	7,954,400		
パンチ工業	6,900	482.00	3,325,800		
冨士ダイス	5,300	684.00	3,625,200		
土木管理総合試験	3,500	336.00	1,176,000		
ネットマーケティング	3,500	691.00	2,418,500	貸付株式数	1,300株
日本郵政	852,700	958.50	817,312,950		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,200	1,453.00	14,820,600		
鎌倉新書	8,100	518.00	4,195,800	貸付株式数	3,100株 (1,800株)
ＳＭＮ	1,600	598.00	956,800	貸付株式数	500株
一蔵	700	564.00	394,800	貸付株式数	300株
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,000	675.00	675,000		
エアトリ	4,300	2,921.00	12,560,300	貸付株式数	1,600株
アトラエ	5,000	1,849.00	9,245,000	貸付株式数	500株
ストライク	3,000	3,745.00	11,235,000		
ソラスト	17,700	704.00	12,460,800		
セラク	2,300	1,166.00	2,681,800	貸付株式数	800株
インソース	7,600	2,210.00	16,796,000	貸付株式数	2,700株
豊田自動織機	55,300	8,190.00	452,907,000		
豊和工業	4,700	934.00	4,389,800	貸付株式数	1,500株
ＯＫＫ	2,800	1,137.00	3,183,600	貸付株式数	1,100株
石川製作所	2,200	1,565.00	3,443,000	貸付株式数	600株
東洋機械金属	5,500	611.00	3,360,500	貸付株式数	700株
津田駒工業	2,000	581.00	1,162,000	貸付株式数	400株
エンシュウ	2,000	868.00	1,736,000		
島精機製作所	10,800	2,154.00	23,263,200	貸付株式数	1,100株

オプトラン	9,200	2,018.00	18,565,600		
ＮＣホールディングス	2,000	1,988.00	3,976,000		
イワキポンプ	5,200	983.00	5,111,600		
フリュー	6,600	1,140.00	7,524,000	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	13,900	332.00	4,614,800		
日阪製作所	10,000	845.00	8,450,000		
やまびこ	12,900	1,216.00	15,686,400		
野村マイクロ・サイエンス	2,500	4,200.00	10,500,000	貸付株式数	800株
平田機工	3,300	4,390.00	14,487,000		
ペガサスミシン製造	7,800	573.00	4,469,400		
マルマエ	3,000	2,140.00	6,420,000	貸付株式数	1,100株 (900株)
タツモ	3,300	1,272.00	4,197,600	貸付株式数	100株
ナブテスコ	39,700	3,145.00	124,856,500	貸付株式数	15,100株
三井海洋開発	7,800	1,341.00	10,459,800		
レオン自動機	8,000	1,370.00	10,960,000	貸付株式数	900株
ＳＭＣ	21,700	69,180.00	1,501,206,000		
ホソカワミクロン	5,200	2,613.00	13,587,600		
ユニオンツール	3,000	3,655.00	10,965,000	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	11,300	1,578.00	17,831,400	貸付株式数	3,900株
日精エーエスビー	2,800	3,325.00	9,310,000		
サト－ホールディングス	9,700	1,913.00	18,556,100		
技研製作所	6,500	3,460.00	22,490,000		
日本エアーテック	3,700	1,060.00	3,922,000	貸付株式数	1,300株
カ　ワ　タ	2,600	1,039.00	2,701,400		
日精樹脂工業	5,400	913.00	4,930,200		
オカダアイヨン	2,200	1,520.00	3,344,000	貸付株式数	700株
ワイエイシイホールディングス	2,900	1,743.00	5,054,700		
小松製作所	337,700	3,385.00	1,143,114,500		
住友重機械	40,100	3,215.00	128,921,500		
日立建機	29,900	3,235.00	96,726,500		
日　工	8,700	613.00	5,333,100		
巴工業	3,200	2,383.00	7,625,600	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,100	1,270.00	7,747,000	貸付株式数	800株
ＴＯＷＡ	6,400	1,857.00	11,884,800	貸付株式数	2,400株
丸山製作所	1,300	1,577.00	2,050,100	貸付株式数	300株
北川鉄工所	2,900	1,488.00	4,315,200		
シンニッタン	14,800	227.00	3,359,600		
ローツェ	3,700	10,820.00	40,034,000		

タカキタ	2,300	579.00	1,331,700	貸付株式数	800株
クボタ	361,200	2,462.50	889,455,000		
荏原実業	3,400	2,396.00	8,146,400		
東洋エンジニア	9,800	670.00	6,566,000	貸付株式数	3,600株
三菱化工機	2,200	2,132.00	4,690,400		
月島機械	12,400	926.00	11,482,400	貸付株式数	4,000株
帝国電機製作所	5,100	1,603.00	8,175,300		
東京機械	3,100	1,070.00	3,317,000		
新東工業	16,500	693.00	11,434,500		
渋谷工業	6,400	2,357.00	15,084,800		
アイチ　コーポレーション	10,100	891.00	8,999,100	貸付株式数	100株
小森コーポレーション	18,500	796.00	14,726,000		
鶴見製作所	5,900	1,817.00	10,720,300		
住友精密	1,000	2,915.00	2,915,000	貸付株式数	100株
日本ギア工業	8,700	274.00	2,383,800	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,200	3,015.00	3,618,000		
荏原製作所	29,600	5,630.00	166,648,000	貸付株式数	11,100株
石井鉄工所	700	2,855.00	1,998,500	貸付株式数	300株
酉島製作所	6,800	1,339.00	9,105,200		
北越工業	6,200	838.00	5,195,600		
ダイキン工業	86,000	21,060.00	1,811,160,000		
オルガノ	2,100	10,240.00	21,504,000		
トーヨーカネツ	2,600	2,847.00	7,402,200		
栗田工業	38,600	5,180.00	199,948,000		
椿本チエイン	10,300	3,245.00	33,423,500		
大同工業	3,400	856.00	2,910,400		
日　機　装	20,100	838.00	16,843,800		
木村化工機	5,900	681.00	4,017,900	貸付株式数	2,300株
レイズネクスト	10,400	1,174.00	12,209,600		
アネスト岩田	12,300	879.00	10,811,700	貸付株式数	100株
ダイフク	37,100	8,240.00	305,704,000		
サムコ	1,900	2,718.00	5,164,200	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,100	843.00	2,613,300		
油研工業	1,600	1,800.00	2,880,000	貸付株式数	200株
タダノ	36,900	969.00	35,756,100		
フジテック	24,200	2,649.00	64,105,800	貸付株式数	9,100株
ＣＫＤ	20,000	1,889.00	37,780,000		
キトー	5,800	2,646.00	15,346,800		
平和	20,700	1,998.00	41,358,600		
理想科学工業	6,000	2,240.00	13,440,000		

ＳＡＮＫＹＯ	16,100	4,255.00	68,505,500		
日本金銭機械	7,400	689.00	5,098,600	貸付株式数	1,400株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,700	1,729.00	8,126,300		
フクシマガリレイ	4,800	3,440.00	16,512,000		
オーイズミ	2,800	436.00	1,220,800	貸付株式数	700株
ダイコク電機	3,400	1,206.00	4,100,400	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	11,400	2,349.00	26,778,600		
ア　マ　ノ	19,500	2,551.00	49,744,500		
ＪＵＫＩ	10,400	711.00	7,394,400	貸付株式数	400株
サンデン	10,000	209.00	2,090,000	貸付株式数	2,000株
ジャノメ	6,100	707.00	4,312,700	貸付株式数	800株
ブラザー工業	86,300	2,421.00	208,932,300		
マックス	9,800	1,583.00	15,513,400		
モリタホールディングス	11,700	1,323.00	15,479,100		
グローリー	18,100	2,081.00	37,666,100		
新晃工業	6,900	1,656.00	11,426,400		
大和冷機工業	10,600	1,049.00	11,119,400		
セガサミーホールディングス	73,900	2,299.00	169,896,100		
日本ピストンリング	2,400	1,321.00	3,170,400		
リ　ケ　ン	2,800	2,356.00	6,596,800	貸付株式数	400株
ＴＰＲ	8,800	1,283.00	11,290,400		
ツバキ・ナカシマ	16,400	1,017.00	16,678,800		
ホシザキ	21,800	7,700.00	167,860,000		
大豊工業	5,800	726.00	4,210,800		
日本精工	130,500	786.00	102,573,000		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	146,700	291.00	42,689,700		
ジェイテクト	66,300	1,033.00	68,487,900		
不　二　越	5,900	3,745.00	22,095,500		
ミネベアミツミ	121,900	2,461.00	299,995,900		
日本トムソン	19,300	561.00	10,827,300		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	41,600	2,783.00	115,772,800	貸付株式数	10,000株
ユーシン精機	7,300	707.00	5,161,100		
前澤給装工業	5,000	844.00	4,220,000	貸付株式数	1,400株
イーグル工業	8,300	1,014.00	8,416,200		
前澤工業	4,900	613.00	3,003,700		
日本ピラー工業	6,900	2,916.00	20,120,400		
キッツ	24,900	695.00	17,305,500		
日　立	358,600	6,874.00	2,465,016,400		
東　芝	130,300	5,742.00	748,182,600		

三菱電機	712,600	1,447.00	1,031,132,200		
富士電機	42,700	6,220.00	265,594,000		
東洋電機製造	2,100	914.00	1,919,400		
安川電機	75,500	4,615.00	348,432,500		
シンフォニア　テクノロジー	7,700	1,415.00	10,895,500	貸付株式数	3,200株
明　電　舎	11,300	2,075.00	23,447,500		
オリジン	1,600	1,275.00	2,040,000		
山洋電気	2,900	5,820.00	16,878,000		
デンヨー	5,500	1,588.00	8,734,000		
ＰＨＣホールディングス	11,400	1,522.00	17,350,800	貸付株式数	1,200株
ベイカレントコンサルティング	5,000	37,450.00	187,250,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,400	2,584.00	3,617,600	貸付株式数	200株
アイモバイル	3,000	1,475.00	4,425,000	貸付株式数	1,000株
キャリアインデックス	2,400	514.00	1,233,600		
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,900	881.00	2,554,900	貸付株式数	1,000株
船場	700	690.00	483,000		
ジャパンエレベーターＳＨＤ	22,600	1,538.00	34,758,800		
フルテック	1,100	1,368.00	1,504,800	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,500	705.00	1,762,500	貸付株式数	1,000株
ツナググループＨＬＤＧＳ	1,600	347.00	555,200	貸付株式数	300株
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	1,900	510.00	969,000	貸付株式数	600株
ＭＳ&ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	1,100	741.00	815,100	貸付株式数	200株
ウェルビー	4,700	823.00	3,868,100	貸付株式数	1,800株
エル・ティー・エス	900	3,440.00	3,096,000	貸付株式数	300株
ミダックホールディングス	3,200	2,740.00	8,768,000	貸付株式数	1,200株
日総工産	5,600	605.00	3,388,000	貸付株式数	2,100株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,300	1,428.00	4,712,400		
ＲＰＡホールディングス	10,000	405.00	4,050,000	貸付株式数	3,800株
三桜工業	10,400	662.00	6,884,800		
マキタ	85,700	3,440.00	294,808,000		
東芝テック	8,000	4,240.00	33,920,000		
芝浦メカトロニクス	1,300	10,890.00	14,157,000	貸付株式数	500株
マブチモーター	17,100	3,655.00	62,500,500		
日本電産	174,800	8,688.00	1,518,662,400		

ユーエムシーエレクトロニクス	2,700	477.00	1,287,900	貸付株式数	1,000株
トレックス・セミコンダクター	3,400	3,055.00	10,387,000	貸付株式数	1,300株
東光高岳	4,100	1,808.00	7,412,800	貸付株式数	1,600株
ダブル・スコープ	21,500	1,385.00	29,777,500	貸付株式数	8,200株 (100株)
宮越ホールディングス	2,800	942.00	2,637,600	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,300	4,405.00	32,156,500		
ヤーマン	12,100	1,263.00	15,282,300	貸付株式数	4,600株
ＪＶＣケンウッド	60,500	190.00	11,495,000		
ミマキエンジニアリング	6,500	583.00	3,789,500	貸付株式数	200株
Ｉ－ＰＥＸ	3,400	1,416.00	4,814,400	貸付株式数	400株
日新電機	17,500	1,522.00	26,635,000		
大崎電気	12,400	504.00	6,249,600	貸付株式数	500株
オムロン	61,800	7,459.00	460,966,200		
日東工業	9,300	2,336.00	21,724,800	貸付株式数	100株
ＩＤＥＣ	9,200	2,774.00	25,520,800	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,100	1,137.00	2,387,700	貸付株式数	800株
不二電機工業	700	1,160.00	812,000	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサ　コーポ	23,100	2,181.00	50,381,100		
サクサホールディングス	1,700	1,481.00	2,517,700	貸付株式数	100株
メルコホールディングス	1,900	3,655.00	6,944,500	貸付株式数	600株
テクノメディカ	2,000	1,577.00	3,154,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリクＨＤ	2,100	1,189.00	2,496,900	貸付株式数	800株
日本電気	90,600	5,230.00	473,838,000		
富　士　通	67,100	18,980.00	1,273,558,000		
沖　電　気	28,900	762.00	22,021,800		
岩崎通信機	3,200	851.00	2,723,200	貸付株式数	100株
電気興業	3,900	2,600.00	10,140,000		
サンケン電気	6,600	5,390.00	35,574,000		
ナカヨ	1,400	1,124.00	1,573,600	貸付株式数	100株
アイホン	3,600	1,718.00	6,184,800	貸付株式数	900株
ルネサスエレクトロニクス	405,200	1,524.00	617,524,800		
セイコーエプソン	86,300	2,266.00	195,555,800		
ワコム	57,900	948.00	54,889,200	貸付株式数	22,200株
アルバック	14,700	5,630.00	82,761,000		
アクセル	2,800	845.00	2,366,000	貸付株式数	1,100株
ＥＩＺＯ	5,400	3,755.00	20,277,000		

ジャパンディスプレイ	61,700	69.00	4,257,300		
日本信号	16,600	920.00	15,272,000		
京三製作所	14,400	447.00	6,436,800		
能美防災	8,900	1,747.00	15,548,300		
ホーチキ	4,600	1,269.00	5,837,400		
星和電機	3,200	480.00	1,536,000	貸付株式数	1,300株
エレコム	17,000	1,541.00	26,197,000		
パナソニック　ホールディンク	795,200	1,199.50	953,842,400		
シャープ	75,600	1,058.00	79,984,800	貸付株式数	28,300株
アンリツ	47,600	1,526.00	72,637,600	貸付株式数	18,400株
富士通ゼネラル	20,200	2,518.00	50,863,600		
ソニーグループ ※	467,000	12,075.00	5,639,025,000		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	108,000	4,640.00	501,120,000		
帝国通信工業	3,200	1,403.00	4,489,600		
タムラ製作所	27,400	580.00	15,892,000	貸付株式数	10,300株
アルプスアルパイン	62,600	1,456.00	91,145,600		
池上通信機	2,400	599.00	1,437,600		
日本電波工業	7,400	1,170.00	8,658,000	貸付株式数	2,800株
鈴木	3,400	846.00	2,876,400	貸付株式数	1,300株
メイコー	8,100	4,395.00	35,599,500		
日本トリム	1,400	2,493.00	3,490,200		
ローランド　ディー.ジー.	4,300	3,425.00	14,727,500	貸付株式数	700株
フオスター電機	6,800	739.00	5,025,200		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,500	2,154.00	3,231,000	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,100	2,358.00	12,025,800		
ティアック	10,900	126.00	1,373,400	貸付株式数	2,500株
ホシデン	16,900	1,245.00	21,040,500		
ヒロセ電機	10,900	17,990.00	196,091,000		
日本航空電子	15,600	2,053.00	32,026,800		
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,600	798.00	6,064,800	貸付株式数	100株
マクセル	13,900	1,307.00	18,167,300		
古野電気	8,800	1,053.00	9,266,400	貸付株式数	3,400株
ユニデンホールディングス	1,600	3,345.00	5,352,000		
スミダコーポレーション	6,900	847.00	5,844,300		
アイコム	2,500	2,490.00	6,225,000	貸付株式数	1,000株
リオン	2,700	2,629.00	7,098,300		
本多通信工業	5,000	540.00	2,700,000	貸付株式数	2,100株
横河電機	70,200	2,379.00	167,005,800		

新電元工業	2,700	3,300.00	8,910,000		
アズビル	43,700	3,720.00	162,564,000		
東亜ディーケーケー	4,300	943.00	4,054,900	貸付株式数	1,100株
日本光電工業	29,200	3,015.00	88,038,000		
チ　ノ　ー	2,500	1,643.00	4,107,500	貸付株式数	700株
共和電業	8,700	342.00	2,975,400	貸付株式数	2,600株
日本電子材料	3,600	1,929.00	6,944,400	貸付株式数	1,200株
堀場製作所	13,100	6,810.00	89,211,000	貸付株式数	4,900株
アドバンテスト	55,400	9,180.00	508,572,000		
小野測器	3,600	443.00	1,594,800		
エスペック	5,900	1,925.00	11,357,500		
キーエンス ※	67,500	51,270.00	3,460,725,000		
日置電機	3,500	7,310.00	25,585,000	貸付株式数	1,300株
シスメックス	56,600	8,415.00	476,289,000		
日本マイクロニクス	11,800	1,460.00	17,228,000	貸付株式数	3,400株
メガチップス	6,600	3,470.00	22,902,000		
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,400	2,907.00	9,883,800	貸付株式数	1,400株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,500	733.00	4,031,500		
澤藤電機	800	1,529.00	1,223,200	貸付株式数	300株
デンソー	152,000	7,920.00	1,203,840,000		
原田工業	3,100	930.00	2,883,000	貸付株式数	1,100株 (1,000株)
コーセル	7,900	785.00	6,201,500		
イリソ電子工業	6,300	3,565.00	22,459,500	貸付株式数	2,300株
オプテックスグループ	12,200	2,083.00	25,412,600		
千代田インテグレ	2,800	1,935.00	5,418,000		
レーザーテック	31,300	18,345.00	574,198,500		
スタンレー電気	49,500	2,270.00	112,365,000		
岩崎電気	2,400	2,537.00	6,088,800		
ウシオ電機	36,200	1,756.00	63,567,200		
岡谷電機	4,000	282.00	1,128,000	貸付株式数	2,000株
ヘリオステクノＨ	9,000	288.00	2,592,000		
エノモト	2,000	1,672.00	3,344,000	貸付株式数	700株
日本セラミック	6,900	2,107.00	14,538,300	貸付株式数	400株
遠藤照明	3,300	782.00	2,580,600		
古河電池	5,300	1,244.00	6,593,200	貸付株式数	2,000株
双信電機	3,400	583.00	1,982,200	貸付株式数	1,300株
山一電機	5,000	1,920.00	9,600,000	貸付株式数	600株
図　研	4,800	2,897.00	13,905,600	貸付株式数	1,700株

日本電子	14,700	6,250.00	91,875,000		
カ　シ　オ	48,100	1,206.00	58,008,600		
ファナック	65,400	21,645.00	1,415,583,000		
日本シイエムケイ	13,500	465.00	6,277,500	貸付株式数	5,500株
エンプラス	1,800	3,465.00	6,237,000		
大真空	9,500	1,025.00	9,737,500	貸付株式数	3,700株
ロ　ー　ム	31,800	10,770.00	342,486,000		
浜松ホトニクス	50,900	6,170.00	314,053,000		
三井ハイテック	6,700	11,390.00	76,313,000	貸付株式数	800株
新光電気工業	21,900	4,615.00	101,068,500		
京　セ　ラ	104,900	7,481.00	784,756,900		
協栄産業	500	1,421.00	710,500		
太陽誘電	34,200	5,620.00	192,204,000		
村田製作所	208,600	8,521.00	1,777,480,600		
双葉電子工業	12,300	700.00	8,610,000		
日東電工	44,900	9,660.00	433,734,000		
北陸電気工業	2,600	1,241.00	3,226,600	貸付株式数	300株
東海理化電機	19,600	1,472.00	28,851,200		
ニチコン	21,000	1,384.00	29,064,000		
日本ケミコン	7,000	1,950.00	13,650,000		
ＫＯＡ	10,600	1,772.00	18,783,200	貸付株式数	500株 (500株)
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	383.00	8,311,100		
日立造船	59,900	872.00	52,232,800		
三菱重工業	111,900	5,338.00	597,322,200		
川崎重工業	51,800	2,914.00	150,945,200		
ＩＨＩ	46,400	3,950.00	183,280,000		
名村造船所	20,100	425.00	8,542,500	貸付株式数	8,400株
サノヤスホールディングス	6,000	130.00	780,000	貸付株式数	2,400株
スプリックス	2,300	1,044.00	2,401,200		
マネジメントソリューションズ	3,500	4,205.00	14,717,500	貸付株式数	1,100株
プロレド・パートナーズ	1,700	583.00	991,100	貸付株式数	600株 (100株)
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	1,600	448.00	716,800	貸付株式数	400株
テノ．ホールディングス	800	675.00	540,000	貸付株式数	300株
フロンティア・マネジメント	1,900	1,350.00	2,565,000		
ピアラ	1,200	742.00	890,400	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	1,400	938.00	1,313,200		

ギークス	1,200	880.00	1,056,000	貸付株式数	400株
カーブスホールディングス	19,500	709.00	13,825,500	貸付株式数	6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,500	933.00	4,198,500		
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰ	1,300	1,681.00	2,185,300	貸付株式数	500株
日本車輌	2,300	2,079.00	4,781,700		
三菱ロジスネクスト	9,800	870.00	8,526,000		
近畿車輌	800	1,215.00	972,000	貸付株式数	400株
一家ホールディングス	1,300	570.00	741,000	貸付株式数	400株
フルサト・マルカＨＤ	6,600	3,535.00	23,331,000	貸付株式数	2,500株
ヤマエグループＨＤ	4,400	1,210.00	5,324,000		
藤久ホールディングス	2,400	728.00	1,747,200	貸付株式数	800株
ＦＰＧ	24,700	933.00	23,045,100	貸付株式数	2,900株
島根銀行	2,000	514.00	1,028,000		
じもとホールディングス	4,700	574.00	2,697,800		
全国保証	17,500	4,355.00	76,212,500	貸付株式数	100株
めぶきフィナンシャルＧ	321,200	249.00	79,978,800		
ジャパンインベストメントＡ	5,600	1,265.00	7,084,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
東京きらぼしＦＧ	8,800	1,932.00	17,001,600		
九州フィナンシャルＧ	136,200	383.00	52,164,600	貸付株式数	12,300株
かんぽ生命保険	73,900	2,126.00	157,111,400		
ゆうちょ銀行	173,600	993.00	172,384,800	貸付株式数	66,600株
あんしん保証	3,500	274.00	959,000	貸付株式数	1,100株
富山第一銀行	16,100	394.00	6,343,400	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
コンコルディア・フィナンシャル	383,900	453.00	173,906,700		
ジェイリース	2,500	1,776.00	4,440,000	貸付株式数	900株
西日本フィナンシャルＨＤ	41,100	768.00	31,564,800		
イントラスト	3,500	547.00	1,914,500		
日本モーゲージサービス	4,200	973.00	4,086,600	貸付株式数	1,600株
Ｃａｓａ	2,900	851.00	2,467,900	貸付株式数	1,000株
アルヒ	10,800	991.00	10,702,800	貸付株式数	4,100株
プレミアグループ	3,700	3,915.00	14,485,500		
日産自動車	879,600	540.50	475,423,800		
いすゞ自動車	222,000	1,620.00	359,640,000		
トヨタ自動車	3,524,400	2,163.00	7,623,277,200		
日野自動車	93,300	729.00	68,015,700		

三菱自動車工業	276,100	405.00	111,820,500	貸付株式数	106,300株
エフテック	4,800	578.00	2,774,400		
レシップホールディングス	2,300	582.00	1,338,600		
GMB	1,200	734.00	880,800	貸付株式数	400株
ファルテック	1,000	608.00	608,000		
武蔵精密工業	16,700	1,420.00	23,714,000		
日産車体	10,500	588.00	6,174,000	貸付株式数	4,100株
新明和工業	20,400	1,139.00	23,235,600		
極東開発工業	12,500	1,413.00	17,662,500		
トピー工業	5,600	1,386.00	7,761,600		
ティラド	1,900	2,831.00	5,378,900		
タチエス	12,400	1,135.00	14,074,000		
Ｎ　Ｏ　Ｋ	30,700	1,210.00	37,147,000		
フタバ産業	17,100	387.00	6,617,700		
ＫＹＢ	7,000	3,035.00	21,245,000		
市光工業	8,800	383.00	3,370,400		
大同メタル工業	13,000	529.00	6,877,000	貸付株式数	1,400株
プレス工業	33,400	432.00	14,428,800		
ミクニ	8,700	365.00	3,175,500		
太平洋工業	14,700	1,074.00	15,787,800		
河西工業	8,500	276.00	2,346,000	貸付株式数	3,200株
アイシン	54,600	4,360.00	238,056,000		
マ　ツ　ダ	224,400	1,126.00	252,674,400		
今仙電機製作所	4,300	613.00	2,635,900	貸付株式数	1,700株
本田技研 ※	559,100	3,299.00	1,844,470,900		
スズキ	155,400	3,942.00	612,586,800		
ＳＵＢＡＲＵ	201,800	2,363.00	476,853,400		
安永	3,000	725.00	2,175,000	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	97,400	2,661.00	259,181,400		
小糸製作所	38,500	4,735.00	182,297,500		
ＴＢＫ	6,000	345.00	2,070,000		
エクセディ	11,200	1,765.00	19,768,000		
ミツバ	12,200	401.00	4,892,200		
豊田合成	22,100	2,118.00	46,807,800		
愛三工業	11,600	753.00	8,734,800		
盟和産業	600	1,006.00	603,600	貸付株式数	300株
日本プラスト	5,100	467.00	2,381,700	貸付株式数	500株
ヨ　ロ　ズ	6,000	867.00	5,202,000	貸付株式数	2,400株
エフ・シー・シー	12,100	1,361.00	16,468,100	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,500	1,511.00	2,266,500		

シマノ	28,400	22,485.00	638,574,000		
テイ・エス　テック	31,500	1,384.00	43,596,000		
３３ＦＧ	6,000	1,378.00	8,268,000		
第四北越フィナンシャルＧ	10,900	2,539.00	27,675,100		
ひろぎんＨＬＤＧＳ	99,200	617.00	61,206,400		
マーキュリアホールディングス	3,500	601.00	2,103,500	貸付株式数	800株
おきなわＦＧ	6,400	2,152.00	13,772,800	貸付株式数	2,400株
ダイレクトマケティングミクス	7,500	1,775.00	13,312,500		
ポピンズ	1,700	2,202.00	3,743,400		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,800	2,621.00	15,201,800		
十六ＦＧ	9,100	2,293.00	20,866,300		
北國ＦＨＤ	6,500	4,100.00	26,650,000		
ネットプロＨＤ	22,400	564.00	12,633,600	貸付株式数	8,500株
プロクレアホールディングス	7,500	1,903.00	14,272,500	貸付株式数	2,900株
ジャムコ	4,300	1,147.00	4,932,100	貸付株式数	1,600株 (100株)
小　野　建	6,700	1,418.00	9,500,600		
はるやまＨＬＤＧＳ	3,700	475.00	1,757,500	貸付株式数	1,200株
南　陽	1,700	1,863.00	3,167,100		
ノ　ジ　マ	11,800	2,937.00	34,656,600		
佐鳥電機	4,400	1,223.00	5,381,200		
カッパ・クリエイト	10,500	1,417.00	14,878,500	貸付株式数	3,900株
エコートレーディング	1,800	595.00	1,071,000	貸付株式数	500株
伯東	4,400	2,818.00	12,399,200		
コンドーテック	5,400	1,073.00	5,794,200	貸付株式数	2,000株
中山福	3,800	334.00	1,269,200	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,700	760.00	4,332,000	貸付株式数	1,800株
ナガイレーベン	9,000	1,945.00	17,505,000		
三菱食品	7,000	3,035.00	21,245,000		
良品計画	84,500	1,429.00	120,750,500		
パリミキホールディングス	10,000	270.00	2,700,000	貸付株式数	3,400株
松田産業	5,300	2,096.00	11,108,800		
第一興商	14,000	4,000.00	56,000,000		
メディパルＨＤ	71,600	1,750.00	125,300,000		
アドヴァングループ	6,600	822.00	5,425,200	貸付株式数	600株
ＳＰＫ	2,500	1,387.00	3,467,500	貸付株式数	1,000株
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,300	2,113.00	4,859,900		

アルビス	2,400	2,208.00	5,299,200	貸付株式数	700株
アズワン	10,500	5,940.00	62,370,000		
スズデン	2,600	2,037.00	5,296,200		
尾家産業	1,800	895.00	1,611,000	貸付株式数	700株
シモジマ	4,600	965.00	4,439,000	貸付株式数	1,700株
ドウシシャ	6,900	1,555.00	10,729,500	貸付株式数	2,600株 (100株)
小津産業	1,400	1,840.00	2,576,000	貸付株式数	500株
コナカ	8,200	347.00	2,845,400	貸付株式数	3,100株
高速	4,300	1,572.00	6,759,600		
ハウス　ローゼ	1,100	1,694.00	1,863,400	貸付株式数	300株
Ｇ－７ホールディングス	8,100	1,456.00	11,793,600		
たけびし	2,200	1,488.00	3,273,600	貸付株式数	1,000株
イオン北海道	10,700	1,086.00	11,620,200	貸付株式数	4,600株
コ　ジ　マ	12,800	628.00	8,038,400	貸付株式数	4,800株
ヒマラヤ	2,500	958.00	2,395,000		
コーナン商事	10,300	3,780.00	38,934,000		
ネットワンシステムズ	27,000	2,792.00	75,384,000		
エコス	2,400	2,041.00	4,898,400	貸付株式数	1,000株
ワタミ	8,800	974.00	8,571,200	貸付株式数	2,600株
マルシェ	2,700	470.00	1,269,000	貸付株式数	800株
リックス	2,300	1,933.00	4,445,900	貸付株式数	600株
システムソフト	19,600	108.00	2,116,800	貸付株式数	5,800株
パンパシフィックＨＤ	146,800	2,081.00	305,490,800		
丸文	5,700	811.00	4,622,700		
西松屋チェーン	14,900	1,484.00	22,111,600	貸付株式数	6,000株
ゼンショーホールディングス	35,600	3,050.00	108,580,000	貸付株式数	13,500株
ハピネット	5,600	1,596.00	8,937,600		
幸楽苑ホールディングス	4,500	1,287.00	5,791,500	貸付株式数	1,700株
ハークスレイ	3,600	597.00	2,149,200	貸付株式数	1,100株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,300	1,995.00	2,593,500	貸付株式数	400株
日本ライフライン	22,000	930.00	20,460,000		
サイゼリヤ	10,800	2,630.00	28,404,000	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,500	789.00	4,339,500	貸付株式数	1,900株
ＶＴホールディングス	27,400	467.00	12,795,800		
アルゴグラフィックス	5,700	3,145.00	17,926,500		
魚力	2,300	2,303.00	5,296,900	貸付株式数	700株
ＩＤＯＭ	22,200	698.00	15,495,600	貸付株式数	8,000株
日本エム・ディ・エム	4,500	1,623.00	7,303,500	貸付株式数	200株

ポプラ	1,800	152.00	273,600	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	4,100	1,240.00	5,084,000	貸付株式数	1,400株
ユナイテッドアローズ	7,600	2,260.00	17,176,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,900	2,210.00	10,829,000	貸付株式数	1,700株
エスケイジャパン	1,800	465.00	837,000		
ダイトロン	2,800	2,068.00	5,790,400		
ハイデイ日高	10,600	2,074.00	21,984,400	貸付株式数	4,000株
シークス	9,700	1,097.00	10,640,900		
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　Ｈ	5,200	240.00	1,248,000	貸付株式数	500株
コロワイド	30,000	1,800.00	54,000,000	貸付株式数	11,500株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	8,800	368.00	3,238,400	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,200	622.00	1,368,400	貸付株式数	100株
オーハシテクニカ	3,500	1,275.00	4,462,500		
壱番屋	5,200	4,945.00	25,714,000	貸付株式数	1,200株
白銅	2,300	2,532.00	5,823,600	貸付株式数	400株
トップカルチャー	3,700	283.00	1,047,100		
ＰＬＡＮＴ	1,700	658.00	1,118,600	貸付株式数	600株
スギホールディングス	14,700	5,340.00	78,498,000		
ダイコー通産	600	1,171.00	702,600	貸付株式数	300株
薬王堂ホールディングス	3,800	1,988.00	7,554,400		
島津製作所	91,200	4,745.00	432,744,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	6,300	583.00	3,672,900		
クボテック	2,200	263.00	578,600	貸付株式数	600株
長野計器	5,200	1,182.00	6,146,400		
ブイ・テクノロジー	3,300	3,035.00	10,015,500		
スター精密	10,700	1,722.00	18,425,400		
東京計器	5,100	1,474.00	7,517,400	貸付株式数	1,600株
愛知時計	2,800	1,510.00	4,228,000		
インターアクション	3,800	2,115.00	8,037,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
オーバル	7,300	321.00	2,343,300	貸付株式数	2,500株
東京精密	11,900	4,985.00	59,321,500		
マニー	27,700	1,471.00	40,746,700	貸付株式数	10,500株
ニコン	107,900	1,667.00	179,869,300		
トプコン	34,900	1,922.00	67,077,800		
オリンパス	370,700	2,801.50	1,038,516,050		
理研計器	5,200	4,050.00	21,060,000	貸付株式数	2,100株

ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,200	12,070.00	147,254,000		
キヤノン電子	6,600	1,555.00	10,263,000		
タムロン	5,300	2,494.00	13,218,200	貸付株式数	1,000株
ＨＯＹＡ	143,900	13,520.00	1,945,528,000		
シ　ー　ド	4,300	504.00	2,167,200	貸付株式数	1,200株
ノーリツ鋼機	6,700	2,469.00	16,542,300		
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	8,400	996.00	8,366,400	貸付株式数	2,400株
朝日インテック	81,500	1,897.00	154,605,500		
キヤノン	370,300	3,331.00	1,233,469,300		
リ　コ　ー	187,200	1,172.00	219,398,400		
シチズン時計	77,600	567.00	43,999,200		
リズム	2,300	1,785.00	4,105,500		
大研医器	7,200	513.00	3,693,600		
メニコン	23,600	2,830.00	66,788,000	貸付株式数	400株
シンシア	1,000	453.00	453,000	貸付株式数	200株
中本パックス	2,100	1,631.00	3,425,100	貸付株式数	700株
スノーピーク	9,700	2,660.00	25,802,000	貸付株式数	3,700株 (100株)
パラマウントベッドＨＤ	14,300	2,013.00	28,785,900		
トランザクション	4,600	1,087.00	5,000,200	貸付株式数	1,100株
粧美堂	2,400	415.00	996,000	貸付株式数	700株
ニホンフラッシュ	5,900	950.00	5,605,000	貸付株式数	2,100株
前田工繊	7,400	2,700.00	19,980,000	貸付株式数	100株
永大産業	7,900	271.00	2,140,900		
アートネイチャー	6,100	741.00	4,520,100		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	63,400	9,608.00	609,147,200		
アイフィスジャパン	2,100	687.00	1,442,700	貸付株式数	700株
共立印刷	10,900	158.00	1,722,200	貸付株式数	4,100株
ＳＨＯＥＩ	6,700	4,760.00	31,892,000		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,300	895.00	8,323,500	貸付株式数	3,400株
マーベラス	11,500	708.00	8,142,000		
パイロットコーポレーション	11,300	5,140.00	58,082,000		
萩原工業	4,800	1,146.00	5,500,800	貸付株式数	1,800株
エイベックス	12,700	1,242.00	15,773,400	貸付株式数	4,500株
フジシールインターナショナル	16,000	1,563.00	25,008,000		
タカラトミー	30,700	1,316.00	40,401,200	貸付株式数	3,000株

広済堂ホールディングス	4,600	1,071.00	4,926,600	貸付株式数	1,600株
エステールホールディングス	1,400	635.00	889,000	貸付株式数	700株
レック	9,100	708.00	6,442,800		
タカノ	2,500	843.00	2,107,500	貸付株式数	800株
三光合成	9,800	350.00	3,430,000	貸付株式数	3,300株
プロネクサス	5,800	1,080.00	6,264,000		
ホクシン	5,100	146.00	744,600		
ウッドワン	2,200	1,197.00	2,633,400	貸付株式数	500株
大建工業	3,900	1,854.00	7,230,600		
き　も　と	10,900	241.00	2,626,900		
凸版印刷	102,500	2,434.00	249,485,000		
大日本印刷	83,200	2,915.00	242,528,000		
共同印刷	2,000	2,638.00	5,276,000	貸付株式数	700株
ＮＩＳＳＨＡ	13,700	1,483.00	20,317,100	貸付株式数	200株
光村印刷	600	1,275.00	765,000	貸付株式数	200株
藤森工業	6,100	3,685.00	22,478,500		
ヴィア・ホールディングス	9,900	156.00	1,544,400	貸付株式数	3,500株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,300	1,812.00	7,791,600	貸付株式数	1,300株
前澤化成工業	4,300	1,292.00	5,555,600	貸付株式数	1,400株
未来工業	2,700	1,560.00	4,212,000		
アシックス	60,100	2,555.00	153,555,500		
ツ　ツ　ミ	1,900	1,988.00	3,777,200	貸付株式数	600株
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	3,100	664.00	2,058,400	貸付株式数	900株
ジェイ　エス　ピー	4,200	1,448.00	6,081,600	貸付株式数	1,600株
ニ　チ　ハ	9,800	2,427.00	23,784,600		
ローランド	5,200	4,735.00	24,622,000	貸付株式数	1,900株
エフピコ	13,600	2,750.00	37,400,000		
小松ウオール工業	2,200	1,897.00	4,173,400		
ヤマハ	43,400	5,470.00	237,398,000		
河合楽器	1,900	2,855.00	5,424,500		
クリナップ	6,700	579.00	3,879,300		
ピジョン	45,100	1,829.00	82,487,900	貸付株式数	17,200株
天馬	6,300	2,365.00	14,899,500	貸付株式数	2,200株
兼松サステック	500	1,647.00	823,500	貸付株式数	100株
キングジム	5,800	921.00	5,341,800	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	19,000	1,433.00	27,227,000	貸付株式数	500株 (500株)
リンテック	15,800	2,428.00	38,362,400		

信越ポリマー	13,200	1,145.00	15,114,000		
東　リ	16,500	208.00	3,432,000		
イトーキ	13,200	392.00	5,174,400	貸付株式数	3,700株
任　天　堂	42,100	57,830.00	2,434,643,000		
三菱鉛筆	10,700	1,371.00	14,669,700	貸付株式数	400株
松　風	2,800	1,700.00	4,760,000	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	13,100	1,244.00	16,296,400	貸付株式数	100株
コ　ク　ヨ	33,700	1,655.00	55,773,500	貸付株式数	12,900株
ナカバヤシ	6,300	501.00	3,156,300	貸付株式数	600株
ニ　フ　コ	24,700	3,220.00	79,534,000		
立川ブラインド	2,900	1,090.00	3,161,000	貸付株式数	1,000株
グローブライド	5,900	2,281.00	13,457,900		
オカムラ	22,500	1,122.00	25,245,000		
バルカー	6,700	2,892.00	19,376,400		
ＭＵＴＯＨホールディングス	800	2,128.00	1,702,400	貸付株式数	300株
伊　藤　忠	464,700	3,739.00	1,737,513,300		
丸　紅	670,500	1,404.00	941,382,000		
スクロール	11,200	860.00	9,632,000	貸付株式数	4,200株
高　島	1,100	2,462.00	2,708,200		
ヨンドシーホールディングス	6,300	1,762.00	11,100,600	貸付株式数	2,400株
三陽商会	3,200	964.00	3,084,800	貸付株式数	700株
長瀬産業	35,200	1,846.00	64,979,200		
ナイガイ	2,300	306.00	703,800	貸付株式数	900株
蝶　理	4,100	1,986.00	8,142,600		
豊田通商	68,300	4,985.00	340,475,500		
オンワードホールディングス	41,400	284.00	11,757,600	貸付株式数	16,100株
三共生興	9,100	566.00	5,150,600		
兼　松	26,000	1,349.00	35,074,000		
美　津　濃	6,500	2,259.00	14,683,500		
ツカモトコーポレーション	1,200	1,295.00	1,554,000	貸付株式数	400株
ルックホールディングス	2,300	1,612.00	3,707,600	貸付株式数	800株
三井物産	544,800	3,309.00	1,802,743,200		
日本紙パルプ	3,500	3,630.00	12,705,000		
東京エレクトロン	47,300	60,670.00	2,869,691,000		
カメイ	8,100	1,085.00	8,788,500	貸付株式数	100株
東都水産	400	4,385.00	1,754,000		
ＯＵＧホールディングス	1,100	2,792.00	3,071,200	貸付株式数	400株

スターゼン	5,200	1,972.00	10,254,400	貸付株式数	1,900株
セイコーＨＤ	10,500	2,678.00	28,119,000		
山　善	27,800	968.00	26,910,400	貸付株式数	11,600株
椿本興業	1,500	3,730.00	5,595,000	貸付株式数	400株
住友商事	444,200	1,904.00	845,756,800		
ＢＩＰＲＯＧＹ	22,900	2,885.00	66,066,500		
内田洋行	3,000	5,260.00	15,780,000	貸付株式数	1,100株
三菱商事	504,400	4,537.00	2,288,462,800		
第一実業	3,000	3,285.00	9,855,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	18,100	3,020.00	54,662,000		
西華産業	3,300	1,658.00	5,471,400		
佐藤商事	5,100	1,175.00	5,992,500		
菱洋エレクトロ	4,300	2,278.00	9,795,400	貸付株式数	1,600株
東京産業	5,600	714.00	3,998,400	貸付株式数	400株
ユアサ商事	6,200	3,280.00	20,336,000		
神鋼商事	1,700	3,850.00	6,545,000		
トルク	10,100	212.00	2,141,200	貸付株式数	1,100株
阪和興業	13,400	3,025.00	40,535,000		
正栄食品	4,700	4,110.00	19,317,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	6,200	1,030.00	6,386,000	貸付株式数	2,200株
菱電商事	5,800	1,661.00	9,633,800	貸付株式数	2,300株
ニプロ	52,600	1,046.00	55,019,600		
岩谷産業	16,700	5,510.00	92,017,000		
ナイス	2,500	1,673.00	4,182,500		
ニチモウ	1,000	2,490.00	2,490,000		
極東貿易	2,100	2,662.00	5,590,200	貸付株式数	700株
アステナホールディングス	9,800	423.00	4,145,400		
兼松エレクトロニクス	3,900	3,955.00	15,424,500		
三愛オブリ	17,000	985.00	16,745,000		
稲畑産業	14,700	2,304.00	33,868,800	貸付株式数	2,000株
ＧＳＩクレオス	3,500	1,296.00	4,536,000	貸付株式数	1,300株
明和産業	6,700	694.00	4,649,800	貸付株式数	2,500株
クワザワホールディングス	2,500	468.00	1,170,000	貸付株式数	1,000株
ゴールドウイン	12,400	8,260.00	102,424,000		
ユニ・チャーム	143,700	4,278.00	614,748,600		
デサント	13,100	2,950.00	38,645,000		
キ　ン　グ	3,300	565.00	1,864,500	貸付株式数	1,300株
ワ　キ　タ	13,800	1,129.00	15,580,200		
ヤマトインターナシヨナル	5,200	288.00	1,497,600	貸付株式数	2,300株

東邦ホールディングス	21,000	1,949.00	40,929,000		
サンゲツ	18,000	1,540.00	27,720,000		
ミツウロコグループ	9,100	942.00	8,572,200		
シナネンホールディングス	2,500	3,395.00	8,487,500		
伊藤忠エネクス	16,000	1,073.00	17,168,000		
サンリオ	21,300	2,620.00	55,806,000	貸付株式数	900株
サンワ　テクノス	3,700	1,400.00	5,180,000		
リョーサン	7,600	2,382.00	18,103,200		
新光商事	9,700	896.00	8,691,200		
トーホー	3,000	1,206.00	3,618,000	貸付株式数	1,200株
三信電気	3,000	1,620.00	4,860,000		
東陽テクニカ	7,900	1,106.00	8,737,400		
モスフード　サービス	9,600	3,065.00	29,424,000	貸付株式数	3,600株
加賀電子	6,200	3,140.00	19,468,000		
三益半導体	5,700	2,426.00	13,828,200	貸付株式数	700株
都築電気	3,400	1,344.00	4,569,600	貸付株式数	1,300株
ソーダニツカ	6,500	624.00	4,056,000		
立花エレテック	5,100	1,565.00	7,981,500	貸付株式数	1,800株
木曽路	9,800	2,207.00	21,628,600	貸付株式数	2,800株
ＳＲＳホールディングス	10,700	879.00	9,405,300	貸付株式数	3,200株
千　趣　会	13,700	398.00	5,452,600	貸付株式数	4,900株
タカキユー	6,300	94.00	592,200	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	10,400	1,131.00	11,762,400	貸付株式数	3,300株
ケーヨー	13,700	966.00	13,234,200		
上新電機	7,600	1,863.00	14,158,800	貸付株式数	2,000株
日本瓦斯	35,700	1,994.00	71,185,800		
ロイヤルホールディングス	12,000	2,315.00	27,780,000	貸付株式数	4,600株
東　天　紅	700	941.00	658,700		
いなげや	7,700	1,198.00	9,224,600		
チヨダ	6,700	744.00	4,984,800	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	6,100	2,647.00	16,146,700		
リンガーハット	8,700	2,331.00	20,279,700	貸付株式数	3,300株
ＭｒＭａｘＨＤ	9,400	622.00	5,846,800		
テンアライド	7,300	315.00	2,299,500	貸付株式数	2,600株
ＡＯＫＩホールディングス	14,000	700.00	9,800,000	貸付株式数	2,400株
オークワ	10,500	859.00	9,019,500		
コメリ	11,300	2,780.00	31,414,000		
青山商事	14,300	902.00	12,898,600	貸付株式数	100株
しまむら	8,500	11,060.00	94,010,000		
はせがわ	4,800	287.00	1,377,600	貸付株式数	900株

高　島　屋	50,900	1,335.00	67,951,500		
松　屋	13,200	921.00	12,157,200	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	32,900	1,068.00	35,137,200	貸付株式数	12,100株
近鉄百貨店	2,300	2,520.00	5,796,000	貸付株式数	900株
丸井グループ	54,800	2,514.00	137,767,200		
クレディセゾン	44,400	1,530.00	67,932,000		
アクシアル　リテイリング	5,100	3,020.00	15,402,000	貸付株式数	1,900株
井　筒　屋	3,400	342.00	1,162,800	貸付株式数	1,300株
イオン	255,700	2,352.50	601,534,250		
イ　ズ　ミ	12,200	2,893.00	35,294,600	貸付株式数	1,300株
フオーバル	2,800	874.00	2,447,200	貸付株式数	500株
平　和　堂	11,300	1,931.00	21,820,300	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	17,400	2,256.00	39,254,400	貸付株式数	7,400株
ヤオコー	8,300	6,430.00	53,369,000	貸付株式数	3,000株
ゼビオホールディングス	10,200	891.00	9,088,200		
ケーズホールディングス	63,900	1,274.00	81,408,600		
ＰＡＬＴＡＣ	10,300	4,230.00	43,569,000	貸付株式数	100株
三谷産業	11,600	319.00	3,700,400	貸付株式数	3,700株
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,000	681.00	2,043,000	貸付株式数	1,200株
日産東京販売ＨＤ	9,000	252.00	2,268,000		
新生銀行	48,000	1,975.00	94,800,000		
あおぞら銀行	41,100	2,678.00	110,065,800		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,406,400	738.80	3,255,448,320	貸付株式数	1,720,900株
りそなホールディングス	796,500	492.30	392,116,950		
三井住友トラストＨＤ	127,400	4,017.00	511,765,800		
三井住友フィナンシャルＧ ※	487,800	3,982.00	1,942,419,600		
千葉銀行	220,800	691.00	152,572,800		
群馬銀行	125,400	359.00	45,018,600		
武蔵野銀行	9,900	1,774.00	17,562,600		
千葉興業銀行	15,800	262.00	4,139,600	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	28,300	186.00	5,263,800	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	20,800	1,785.00	37,128,000		
秋田銀行	4,300	1,537.00	6,609,100		
山形銀行	7,000	854.00	5,978,000	貸付株式数	400株
岩手銀行	4,500	2,066.00	9,297,000		
東邦銀行	54,600	199.00	10,865,400	貸付株式数	7,900株
東北銀行	3,000	992.00	2,976,000		

ふくおかフィナンシャルG	56,200	2,340.00	131,508,000		
静岡銀行	161,200	776.00	125,091,200		
スルガ銀行	63,000	363.00	22,869,000		
八十二銀行	150,100	468.00	70,246,800		
山梨中央銀行	7,400	1,142.00	8,450,800	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	13,200	1,750.00	23,100,000		
福井銀行	5,900	1,337.00	7,888,300	貸付株式数	100株
清水銀行	2,500	1,501.00	3,752,500		
富山銀行	1,100	1,864.00	2,050,400	貸付株式数	400株
滋賀銀行	12,600	2,723.00	34,309,800	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,500	1,957.00	20,548,500	貸付株式数	100株
百五銀行	64,800	321.00	20,800,800		
京都銀行	24,000	5,810.00	139,440,000		
紀陽銀行	23,000	1,378.00	31,694,000		
ほくほくフィナンシャルG	43,000	825.00	35,475,000		
山陰合同銀行	41,900	673.00	28,198,700	貸付株式数	13,600株
中国銀行	55,500	927.00	51,448,500	貸付株式数	400株
鳥取銀行	2,000	1,211.00	2,422,000		
伊予銀行	87,900	643.00	56,519,700		
百十四銀行	7,000	1,743.00	12,201,000		
四国銀行	10,000	808.00	8,080,000	貸付株式数	3,800株 (700株)
阿波銀行	10,200	2,020.00	20,604,000		
大分銀行	4,000	1,757.00	7,028,000		
宮崎銀行	4,100	2,042.00	8,372,200		
佐賀銀行	3,700	1,431.00	5,294,700	貸付株式数	200株
琉球銀行	15,700	790.00	12,403,000	貸付株式数	1,900株
セブン銀行	219,600	243.00	53,362,800	貸付株式数	19,900株
みずほフィナンシャルG	901,200	1,531.00	1,379,737,200		
高知銀行	2,200	738.00	1,623,600	貸付株式数	1,000株
山口フィナンシャルG	78,000	744.00	58,032,000		
芙蓉総合リース	6,700	7,710.00	51,657,000		
みずほリース	9,800	3,080.00	30,184,000		
東京センチュリー	12,400	4,230.00	52,452,000		
ＳＢＩホールディングス	90,800	2,643.00	239,984,400		
日本証券金融	28,700	879.00	25,227,300		
アイフル	123,500	345.00	42,607,500		
日本アジア投資	5,900	263.00	1,551,700		
長野銀行	2,100	1,295.00	2,719,500		
名古屋銀行	4,800	3,070.00	14,736,000		

北洋銀行	99,200	220.00	21,824,000		
愛知銀行	2,400	5,060.00	12,144,000		
中京銀行	2,300	1,635.00	3,760,500		
大光銀行	2,200	1,293.00	2,844,600	貸付株式数	900株
愛媛銀行	9,700	833.00	8,080,100		
トマト銀行	2,100	1,015.00	2,131,500		
京葉銀行	30,700	462.00	14,183,400	貸付株式数	11,200株
栃木銀行	33,400	268.00	8,951,200		
北日本銀行	2,000	1,592.00	3,184,000	貸付株式数	700株
東和銀行	12,100	514.00	6,219,400		
福島銀行	7,300	226.00	1,649,800		
大東銀行	2,900	652.00	1,890,800		
リコーリース	6,500	3,470.00	22,555,000		
イオンフィナンシャルサービス	40,100	1,230.00	49,323,000		
ア　コ　ム	144,900	320.00	46,368,000		
ジャックス	7,600	3,370.00	25,612,000		
オ　リ　コ	198,600	125.00	24,825,000		
オリックス	436,900	2,461.50	1,075,429,350		
三菱ＨＣキャピタル	248,500	628.00	156,058,000		
ジャフコ　グループ	28,100	1,599.00	44,931,900		
九州　リースサービス	3,300	579.00	1,910,700	貸付株式数	1,300株
トモニホールディングス	54,400	313.00	17,027,200		
大和証券Ｇ本社	524,000	622.60	326,242,400		
野村ホールディングス	1,122,300	503.60	565,190,280		
岡三証券グループ	54,000	342.00	18,468,000	貸付株式数	400株
丸三証券	21,900	484.00	10,599,600		
東洋証券	22,800	196.00	4,468,800	貸付株式数	8,600株
東海東京ＨＤ	75,300	372.00	28,011,600		
光世証券	1,900	480.00	912,000	貸付株式数	500株
水戸証券	18,900	276.00	5,216,400		
いちよし証券	13,100	640.00	8,384,000	貸付株式数	100株
松井証券	35,900	824.00	29,581,600		
ＳＯＭＰＯホールディングス	110,000	6,021.00	662,310,000		
日本取引所グループ	175,300	2,069.00	362,695,700		
マネックスＧ	61,300	504.00	30,895,200	貸付株式数	23,200株
極東証券	8,900	677.00	6,025,300	貸付株式数	3,500株
岩井コスモホールディング	7,000	1,245.00	8,715,000	貸付株式数	900株
アイザワ証券グループ	10,800	695.00	7,506,000	貸付株式数	100株

フィデアホール	6,700	1,273.00	8,529,100	貸付株式数	200株
池田泉州ＨＤ	80,600	187.00	15,072,200		
アニコム　ホールディングス	22,500	658.00	14,805,000	貸付株式数	8,200株
ＭＳ＆ＡＤ	155,700	4,166.00	648,646,200		
マネーパートナーズＧＰ	7,500	239.00	1,792,500	貸付株式数	2,000株
スパークス・グループ	33,800	262.00	8,855,600	貸付株式数	12,600株 (200株)
小林洋行	3,000	230.00	690,000		
第一生命ＨＬＤＧＳ	350,100	2,699.50	945,094,950		
東京海上ＨＤ	215,100	7,605.00	1,635,835,500		
アドバンテッジリスクマネ	3,600	495.00	1,782,000	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	10,800	2,077.00	22,431,600		
アサックス	4,600	613.00	2,819,800	貸付株式数	1,500株
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,200	1,977.00	6,326,400		
Ｔ＆Ｄホールディングス	172,800	1,547.00	267,321,600		
アドバンスクリエイト	3,500	952.00	3,332,000	貸付株式数	1,100株
三井不動産	303,700	2,825.50	858,104,350		
三菱地所	440,400	1,943.00	855,697,200		
平和不動産	12,000	3,925.00	47,100,000		
東京建物	66,500	1,720.00	114,380,000		
京阪神ビルディング	10,200	1,270.00	12,954,000		
住友不動産	139,700	3,558.00	497,052,600		
太平洋興発	2,700	664.00	1,792,800		
テーオーシー	11,900	631.00	7,508,900	貸付株式数	2,500株
東京楽天地	1,000	4,050.00	4,050,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	10,100	2,492.00	25,169,200		
フジ住宅	8,200	658.00	5,395,600		
空港施設	6,900	536.00	3,698,400	貸付株式数	800株
明和地所	3,100	626.00	1,940,600		
ゴールドクレスト	5,800	1,701.00	9,865,800		
リログループ	39,000	2,188.00	85,332,000	貸付株式数	200株
エスリード	2,700	1,721.00	4,646,700	貸付株式数	700株
日神グループＨＬＤＧＳ	11,600	455.00	5,278,000	貸付株式数	4,400株
日本エスコン	13,600	789.00	10,730,400	貸付株式数	4,900株
タカラレーベン	30,400	345.00	10,488,000	貸付株式数	200株
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,200	858.00	2,745,600	貸付株式数	600株
イオンモール	37,100	1,640.00	60,844,000		
毎日コムネット	2,100	685.00	1,438,500	貸付株式数	900株

ファースト住建	2,600	1,118.00	2,906,800	貸付株式数	900株
ランド	403,800	10.00	4,038,000	貸付株式数	144,600株
カチタス	18,300	3,045.00	55,723,500		
東祥	5,400	1,406.00	7,592,400	貸付株式数	1,500株
トーセイ	10,200	1,179.00	12,025,800	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,500	2,370.00	3,555,000	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	10,300	1,090.00	11,227,000		
インテリックス	1,500	625.00	937,500	貸付株式数	100株
ランドビジネス	1,700	240.00	408,000	貸付株式数	1,100株
サンネクスタグループ	2,200	1,187.00	2,611,400	貸付株式数	900株
グランディハウス	4,800	532.00	2,553,600		
東武鉄道	69,600	3,020.00	210,192,000		
相鉄ホールディングス	22,500	2,287.00	51,457,500		
東急	178,200	1,526.00	271,933,200		
京浜急行	87,200	1,436.00	125,219,200	貸付株式数	9,700株
小田急電鉄	99,600	1,763.00	175,594,800		
京王電鉄	34,800	4,570.00	159,036,000		
京成電鉄	46,500	3,630.00	168,795,000		
富士急行	8,000	4,265.00	34,120,000	貸付株式数	2,600株
新京成電鉄	2,000	2,959.00	5,918,000	貸付株式数	200株
東日本旅客鉄道	119,600	7,025.00	840,190,000		
西日本旅客鉄道	82,900	5,082.00	421,297,800		
東海旅客鉄道	55,600	16,430.00	913,508,000		
西武ホールディングス	92,300	1,414.00	130,512,200		
鴻池運輸	10,800	1,146.00	12,376,800		
西日本鉄道	18,700	2,830.00	52,921,000		
ハマキョウレックス	4,900	2,931.00	14,361,900		
サカイ引越センター	3,400	4,390.00	14,926,000	貸付株式数	1,200株
近鉄グループＨＬＤＧＳ	67,700	3,965.00	268,430,500		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	84,300	3,570.00	300,951,000		
南海電鉄	30,100	2,526.00	76,032,600	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	28,900	3,195.00	92,335,500		
神戸電鉄	2,000	3,325.00	6,650,000	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	71,300	2,223.00	158,499,900		
山陽電鉄	5,000	2,168.00	10,840,000	貸付株式数	600株
アルプス物流	4,800	1,137.00	5,457,600		
トランコム	2,000	6,460.00	12,920,000	貸付株式数	700株
ヤマトホールディングス	99,000	2,204.00	218,196,000		
山　九	17,700	3,890.00	68,853,000		
日　新	5,200	1,686.00	8,767,200		

丸　運	3,100	239.00	740,900	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	5,100	3,030.00	15,453,000	貸付株式数	1,500株
センコーグループＨＬＤＧＳ	33,800	855.00	28,899,000	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,400	3,495.00	4,893,000		
ニッコンホールディングス	22,700	2,097.00	47,601,900		
日石輸送	700	2,603.00	1,822,100	貸付株式数	200株
福山通運	9,900	3,245.00	32,125,500		
セイノーホールディングス	41,700	1,020.00	42,534,000	貸付株式数	15,300株
エスライン	1,800	858.00	1,544,400	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,000	3,545.00	7,090,000	貸付株式数	600株
日立物流	13,300	8,550.00	113,715,000		
丸和運輸機関	12,900	1,563.00	20,162,700	貸付株式数	400株
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,300	1,042.00	6,564,600		
日本郵船	59,100	10,690.00	631,779,000		
商船三井	111,700	3,525.00	393,742,500		
川崎汽船	21,800	10,700.00	233,260,000		
ＮＳユナイテッド海運	3,500	4,400.00	15,400,000	貸付株式数	1,400株
明治海運	7,200	1,387.00	9,986,400	貸付株式数	3,000株
飯野海運	29,500	737.00	21,741,500		
共栄タンカー	1,200	1,141.00	1,369,200	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	49,700	2,678.00	133,096,600		
ＳＧホールディングス	123,600	2,282.00	282,055,200		
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳ	22,100	7,890.00	174,369,000		
日本航空	155,200	2,379.00	369,220,800		
ＡＮＡホールディングス	172,000	2,593.00	445,996,000		
ビーウィズ	1,900	1,443.00	2,741,700	貸付株式数	700株
パスコ	1,400	1,317.00	1,843,800		
ＴＲＥホールディングス	12,200	2,095.00	25,559,000	貸付株式数	3,600株
人・夢・技術グループ	2,800	2,445.00	6,846,000		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,700	3,595.00	6,111,500	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,600	1,575.00	2,520,000	貸付株式数	600株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	800	1,881.00	1,504,800		
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	3,200	3,390.00	10,848,000	貸付株式数	1,200株
コーア商事ＨＬＤＧＳ	4,600	853.00	3,923,800		

国際紙パルプ商事	14,000	430.00	6,020,000	貸付株式数	5,500株
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	921.00	1,473,600	貸付株式数	500株
ブックオフＧＨＤ	4,600	983.00	4,521,800	貸付株式数	1,500株
ギフトホールディングス	1,200	2,236.00	2,683,200		
三菱倉庫	19,800	3,100.00	61,380,000		
三井倉庫ＨＯＬＤ	7,100	3,015.00	21,406,500		
住友倉庫	22,000	2,110.00	46,420,000	貸付株式数	8,200株
渋沢倉庫	3,700	2,286.00	8,458,200	貸付株式数	600株
ヤマタネ	3,000	1,630.00	4,890,000	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	10,200	304.00	3,100,800	貸付株式数	1,700株
乾汽船	4,400	1,830.00	8,052,000	貸付株式数	1,800株
日本トランスシティ	13,500	538.00	7,263,000		
ケイヒン	1,200	1,387.00	1,664,400		
中央倉庫	3,700	994.00	3,677,800	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,300	1,163.00	1,511,900	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,700	962.00	4,521,400		
ファイズホールディングス	1,500	824.00	1,236,000		
東洋埠頭	1,800	1,329.00	2,392,200		
上　組	36,400	2,593.00	94,385,200	貸付株式数	9,900株
サンリツ	1,600	742.00	1,187,200		
キムラユニティー	1,800	1,504.00	2,707,200	貸付株式数	200株
キユーソー流通システム	3,400	1,104.00	3,753,600	貸付株式数	1,200株
近鉄エクスプレス	12,800	4,175.00	53,440,000		
東海運	3,400	300.00	1,020,000	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,400	1,567.00	6,894,800		
内外トランスライン	2,700	1,999.00	5,397,300	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,700	582.00	1,571,400	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,200	1,619.00	3,561,800		
ＴＢＳホールディングス	38,300	1,716.00	65,722,800		
日本テレビＨＬＤＳ	60,800	1,243.00	75,574,400		
朝日放送グループＨＤ	6,400	668.00	4,275,200	貸付株式数	2,500株
テレビ朝日ＨＤ	18,000	1,481.00	26,658,000		
スカパーＪＳＡＴＨＤ	61,700	480.00	29,616,000	貸付株式数	700株
テレビ東京ＨＤ	5,000	2,010.00	10,050,000		
日本ＢＳ放送	3,000	1,066.00	3,198,000	貸付株式数	900株
ビジョン	12,000	1,323.00	15,876,000		
スマートバリュー	1,700	529.00	899,300	貸付株式数	600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	6,000	2,038.00	12,228,000	貸付株式数	2,500株

ワイヤレスゲート	3,000	322.00	966,000	貸付株式数	1,100株
コネクシオ	5,300	1,346.00	7,133,800		
日本通信	60,700	192.00	11,654,400	貸付株式数	23,000株
クロップス	1,400	1,129.00	1,580,600		
日本電信電話	801,600	3,927.00	3,147,883,200		
ＫＤＤＩ	533,200	4,489.00	2,393,534,800		
ソフトバンク	1,107,600	1,473.00	1,631,494,800		
光通信	8,400	14,320.00	120,288,000		
エムティーアイ	6,100	458.00	2,793,800	貸付株式数	2,200株
GMOインターネット	25,600	2,604.00	66,662,400		
ファイバーゲート	3,400	1,023.00	3,478,200	貸付株式数	1,200株
アイドママーケティングコミュ	1,800	293.00	527,400	貸付株式数	600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	39,500	2,890.00	114,155,000		
学研ホールディングス	10,300	886.00	9,125,800	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	12,100	929.00	11,240,900	貸付株式数	4,300株
昭文社ホールディングス	3,000	406.00	1,218,000	貸付株式数	1,000株
インプレスホールディングス	6,500	220.00	1,430,000		
東京電力ＨＤ	558,100	492.00	274,585,200	貸付株式数	105,400株
中部電力	216,500	1,296.00	280,584,000		
関西電力	267,900	1,249.00	334,607,100		
中国電力	110,400	850.00	93,840,000		
北陸電力	64,500	520.00	33,540,000	貸付株式数	25,700株
東北電力	167,000	712.00	118,904,000		
四国電力	63,500	765.00	48,577,500		
九州電力	146,400	841.00	123,122,400	貸付株式数	5,200株
北海道電力	64,400	484.00	31,169,600		
沖縄電力	15,700	1,176.00	18,463,200		
電源開発	57,800	2,035.00	117,623,000		
エフオン	4,500	546.00	2,457,000	貸付株式数	1,600株
イーレックス	10,100	2,041.00	20,614,100	貸付株式数	4,000株
レノバ	14,600	1,891.00	27,608,600	貸付株式数	5,600株
東京瓦斯	136,100	2,631.00	358,079,100		
大阪瓦斯	128,600	2,508.00	322,528,800		
東邦瓦斯	30,900	2,938.00	90,784,200		
北海道瓦斯	3,600	1,624.00	5,846,400	貸付株式数	400株
広島ガス	13,000	325.00	4,225,000		
西部ガスＨＬＤＧＳ	7,500	1,898.00	14,235,000	貸付株式数	600株
静岡ガス	18,200	854.00	15,542,800		

メタウォーター	7,800	2,074.00	16,177,200		
アイネット	3,300	1,231.00	4,062,300		
松　竹	4,400	13,370.00	58,828,000		
東　宝	43,200	5,120.00	221,184,000		
エイチ・アイ・エス	15,200	2,356.00	35,811,200	貸付株式数	5,900株
東　映	2,200	17,920.00	39,424,000		
ラックランド	2,100	3,010.00	6,321,000	貸付株式数	800株
ＮＴＴデータ	194,900	2,020.00	393,698,000		
共立メンテナンス	12,700	5,030.00	63,881,000	貸付株式数	4,800株
イチネンホールディングス	7,600	1,226.00	9,317,600		
建設技術研究所	3,800	2,529.00	9,610,200		
スペース	4,700	935.00	4,394,500		
アインホールディングス	9,300	6,460.00	60,078,000		
燦ホールディングス	3,100	1,855.00	5,750,500		
ピー・シー・エー	4,300	1,235.00	5,310,500	貸付株式数	1,100株
スバル興業	400	8,750.00	3,500,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,000	1,246.00	2,492,000	貸付株式数	900株
タナベ経営	2,900	705.00	2,044,500	貸付株式数	300株
ビジネスＢ太田昭和	2,300	1,508.00	3,468,400		
ナ　ガ　ワ	2,100	8,760.00	18,396,000	貸付株式数	800株
東京都競馬	5,400	3,875.00	20,925,000		
常磐興産	2,200	1,308.00	2,877,600	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,900	2,002.00	23,823,800		
ＤＴＳ	13,700	3,105.00	42,538,500	貸付株式数	4,000株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	34,000	6,090.00	207,060,000		
シーイーシー	7,800	1,253.00	9,773,400		
カプコン	69,000	3,420.00	235,980,000		
西尾レントオール	6,100	2,790.00	17,019,000		
アイ・エス・ビー	3,400	1,072.00	3,644,800	貸付株式数	1,200株
アゴーラ　ホスピタリティーＧ	34,000	24.00	816,000		
日本空港ビルデング	25,200	5,610.00	141,372,000	貸付株式数	10,300株
トランス・コスモス	9,000	3,535.00	31,815,000	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	30,400	927.00	28,180,800	貸付株式数	7,000株 (7,000株)
ジャステック	4,100	1,174.00	4,813,400	貸付株式数	200株
ＳＣＳＫ	50,800	2,221.00	112,826,800		
藤田観光	3,100	2,612.00	8,097,200	貸付株式数	1,200株

ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,400	1,802.00	7,928,800	貸付株式数	100株
日本管財	7,500	2,595.00	19,462,500	貸付株式数	1,700株
トーカイ	5,700	1,687.00	9,615,900	貸付株式数	100株
白　洋　舎	600	1,577.00	946,200	貸付株式数	300株
セコム	70,200	8,568.00	601,473,600		
日本システムウエア	2,700	2,491.00	6,725,700		
セントラル警備保障	3,500	2,285.00	7,997,500	貸付株式数	1,200株
アイネス	6,100	1,506.00	9,186,600	貸付株式数	2,300株
丹青社	13,700	872.00	11,946,400		
メイテツク	8,400	7,080.00	59,472,000		
ＴＫＣ	11,600	3,440.00	39,904,000		
富士ソフト	7,300	7,480.00	54,604,000	貸付株式数	2,800株
応用地質	7,200	1,768.00	12,729,600		
船井総研ホールディン	13,700	2,094.00	28,687,800		
ＮＳＤ	23,000	2,416.00	55,568,000		
進学会ホールディングス	1,700	364.00	618,800	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	700	1,878.00	1,314,600		
オ　オ　バ	4,500	757.00	3,406,500	貸付株式数	1,800株
コナミホールディングス	26,600	8,870.00	235,942,000		
いであ	1,800	1,800.00	3,240,000	貸付株式数	600株
学　究　社	2,200	1,605.00	3,531,000		
ベネッセホールディングス	23,800	2,089.00	49,718,200		
イオンディライト	8,100	2,862.00	23,182,200		
ナック	3,200	962.00	3,078,400	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータＨＬＤＳ	3,400	3,300.00	11,220,000		
ダイセキ	13,000	4,565.00	59,345,000		
ステップ	2,500	1,732.00	4,330,000	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,700	5,300.00	24,910,000		
泉州電業	1,900	5,370.00	10,203,000	貸付株式数	700株
元気寿司	2,200	2,536.00	5,579,200	貸付株式数	700株
トラスコ中山	15,300	1,852.00	28,335,600		
ヤマダホールディングス	266,300	472.00	125,693,600		
オートバックスセブン	23,400	1,386.00	32,432,400	貸付株式数	9,300株
モリト	5,200	772.00	4,014,400	貸付株式数	2,000株
アークランドサカモト	11,400	1,534.00	17,487,600		
ニトリホールディングス	29,100	13,030.00	379,173,000		
グルメ杵屋	5,900	1,040.00	6,136,000	貸付株式数	2,200株
愛　眼	7,400	191.00	1,413,400	貸付株式数	900株
ケーユーホールディングス	3,700	1,090.00	4,033,000		

吉野家ホールディングス	25,400	2,467.00	62,661,800	貸付株式数	9,800株
加藤産業	8,800	3,120.00	27,456,000		
北恵	1,900	892.00	1,694,800	貸付株式数	600株
イノテック	4,200	1,351.00	5,674,200		
イエローハット	12,000	1,647.00	19,764,000	貸付株式数	4,600株
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,700	3,850.00	14,245,000	貸付株式数	1,200株
ＪＢＣＣホールディングス	4,900	1,642.00	8,045,800		
ＪＫホールディングス	5,300	955.00	5,061,500	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	10,800	1,185.00	12,798,000	貸付株式数	4,100株
日　伝	6,200	1,986.00	12,313,200	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	6,300	1,250.00	7,875,000	貸付株式数	300株
ミロク情報サービス	6,400	1,207.00	7,724,800	貸付株式数	1,800株
北沢産業	4,100	216.00	885,600		
杉本商事	3,800	2,248.00	8,542,400	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,200	2,659.00	48,393,800		
王将フードサービス	4,900	6,920.00	33,908,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	8,300	1,947.00	16,160,100		
ミニストップ	5,200	1,417.00	7,368,400	貸付株式数	2,000株
アークス	13,300	1,978.00	26,307,400	貸付株式数	5,000株
バローホールディングス	15,400	1,861.00	28,659,400		
東　テ　ク	2,300	3,075.00	7,072,500		
ミスミグループ本社	91,800	2,980.00	273,564,000		
アルテック	5,700	240.00	1,368,000		
ベ　ル　ク	3,200	5,200.00	16,640,000		
大　庄	3,900	1,187.00	4,629,300	貸付株式数	1,300株
タキヒヨー	1,900	1,065.00	2,023,500	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	9,800	68,700.00	673,260,000		
ソフトバンクグループ	438,700	5,391.00	2,365,031,700		
蔵王産業	1,900	2,015.00	3,828,500	貸付株式数	400株
スズケン	27,000	3,445.00	93,015,000		
サンドラッグ	27,700	2,883.00	79,859,100		
サックスバーホールディング	7,100	592.00	4,203,200	貸付株式数	2,400株
ジェコス	5,100	840.00	4,284,000		
ヤマザワ	1,600	1,507.00	2,411,200	貸付株式数	600株
や　ま　や	1,800	2,511.00	4,519,800	貸付株式数	500株
グローセル	7,400	414.00	3,063,600	貸付株式数	3,000株
ベルーナ	15,700	680.00	10,676,000	貸付株式数	100株
合計			189,725,861,600		

（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

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	453,635,712	1,785,323,632
コール・ローン	7,243,115,392	2,859,391,174
株式	199,282,719,518	258,776,639,198
投資証券	4,908,406,142	6,825,418,951
派生商品評価勘定	258,465,709	183,753,161
未収入金	63,829,653	59,346,882
未収配当金	268,921,252	401,762,924
差入委託証拠金	3,514,930,360	4,355,430,192
流動資産合計	215,994,023,738	275,247,066,114
資産合計	215,994,023,738	275,247,066,114
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	4,724,448	97,190,351
未払金	－	491,234,462
未払解約金	84,794,800	33,560,500
その他未払費用	－	189
流動負債合計	89,519,248	621,985,502
負債合計	89,519,248	621,985,502
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	58,182,794,639	65,219,352,126
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	157,721,709,851	209,405,728,486
元本等合計	215,904,504,490	274,625,080,612
純資産合計	215,904,504,490	274,625,080,612
負債純資産合計	215,994,023,738	275,247,066,114

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年6月8日 至　2022年6月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1. ※1　期首	2020年6月6日	2021年6月8日
期首元本額	51,293,925,045円	58,182,794,639円
期中追加設定元本額	13,640,586,671円	13,258,685,462円
期中一部解約元本額	6,751,717,077円	6,222,127,975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	383,529,944円	349,068,733円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,549,034円	3,751,596円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	78,505,468円	45,554,421円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,555,264円	7,085,384円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	269,933,131円	205,400,687円
外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	27,604,939円	52,416,335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）	504,914,542円	510,901,757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）	2,461,237,714円	2,693,828,278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）	494,255,626円	636,825,515円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	11,991,941円	17,598,341円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	18,033,648円	42,109,081円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	3,092,178,917円	5,032,009,377円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,041,878,873円	1,256,810,253円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	127,831,257円	220,052,668円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	35,748,871,257円	41,251,827,650円
ダイワ・ライフ・バランス３０	529,092,010円	528,041,544円
ダイワ・ライフ・バランス５０	938,183,739円	988,869,306円
ダイワ・ライフ・バランス７０	717,717,769円	798,656,593円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,632,567,507円	1,825,240,470円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	11,485,409円	12,623,928円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,497,384円	11,303,219円
ダイワつみたてインデックス外国株式	599,531,918円	1,007,956,945円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,997,402円	1,932,349円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,040,718円	2,153,578円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,583,521円	4,254,951円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	－円	246,407円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	123,939,186円	81,384,880円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	232,900,284円	153,275,360円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,760,933,852円	1,330,992,536円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	90,149,674円	68,880,810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	－円

ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	234,082,341円	188,669,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	853,880,708円	1,063,368,930円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	233,874,969円	385,242,890円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,826,744,251円	1,570,304,135円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,742,298,017円	2,779,529,325円
ダイワライフスタイル２５	14,059,133円	11,267,821円
ダイワライフスタイル５０	54,804,382円	44,106,095円
ダイワライフスタイル７５	45,101,321円	35,810,932円
計	58,182,794,639円	65,219,352,126円
2. 期末日における受益権の総数	58,182,794,639口	65,219,352,126口

（金融商品に関する注記）

Ｉ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年6月8日 至 2022年6月6日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年6月6日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2021年6月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2022年6月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	24,776,852,072	△29,993,463,493
投資証券	706,125,033	△550,957,982
合計	25,482,977,105	△30,544,421,475

（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2021年6月7日まで、及び2021年12月1日から2022年6月6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	2021年6月7日 現在				2022年6月6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	11,313,846,826	－	11,564,905,616	251,058,790	8,633,026,393	－	8,683,393,283	50,366,890
合計	11,313,846,826	－	11,564,905,616	251,058,790	8,633,026,393	－	8,683,393,283	50,366,890

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種　類	2021年6月7日 現在				2022年6月6日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 買　建	7,097,104,729	－	7,099,787,200	2,682,471	2,573,465,390	－	2,609,661,310	36,195,920
アメリカ･ドル	5,026,491,120	－	5,033,363,000	6,871,880	772,485,000	－	784,039,800	11,554,800
イギリス･ポンド	311,237,390	－	310,340,000	△897,390	211,045,900	－	212,047,290	1,001,390
オーストラリア･ドル	238,992,180	－	239,051,400	59,220	305,737,740	－	310,782,120	5,044,380
カナダ･ドル	304,836,045	－	304,584,000	△252,045	254,487,500	－	259,509,750	5,022,250
スイス･フラン	296,086,202	－	296,265,600	179,398	268,806,800	－	271,902,400	3,095,600
ユーロ	919,461,792	－	916,183,200	△3,278,592	760,902,450	－	771,379,950	10,477,500
合計	7,097,104,729	－	7,099,787,200	2,682,471	2,573,465,390	－	2,609,661,310	36,195,920

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.7108円 (37,108円)	4.2108円 (42,108円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,700	146.290	687,563.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	4,000	512.580	2,050,320.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,400	146.730	1,085,802.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,400	87.210	470,934.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,400	151.670	364,008.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	35.440	747,784.000	

ABBOTT LABORATORIES	71,466	116.570	8,330,791.620	
HOWMET AEROSPACE INC	14,983	36.630	548,827.290	
VERISK ANALYTICS INC	6,500	173.660	1,128,790.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	13,900	34.960	485,944.000	
AMPHENOL CORP-CL A	24,300	70.880	1,722,384.000	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,800	457.460	823,428.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,700	103.820	2,564,354.000	
QORVO INC	4,420	109.060	482,045.200	
AFLAC INC	25,000	58.820	1,470,500.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,100	125.780	641,478.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,800	95.300	648,040.000	
ADOBE INC	19,120	429.760	8,217,011.200	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,400	95.860	805,224.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,800	300.800	1,443,840.000	
GARMIN LTD	6,300	104.810	660,303.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,000	252.270	2,270,430.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,800	194.820	5,415,996.000	
WR BERKLEY CORP	8,642	70.610	610,211.620	
AUTOZONE INC	820	2,058.040	1,687,592.800	
DOLLAR TREE INC	9,071	159.880	1,450,271.480	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	45,900	9.300	426,870.000	
CELANESE CORP	4,450	156.830	697,893.500	
DR HORTON INC	13,616	76.000	1,034,816.000	
DENTSPLY SIRONA INC	8,900	40.490	360,361.000	
AUTODESK INC	8,900	208.370	1,854,493.000	
MOODY'S CORP	6,800	285.280	1,939,904.000	
DEVON ENERGY CORP	25,600	77.020	1,971,712.000	
ALBEMARLE CORP	4,700	250.760	1,178,572.000	
ATMOS ENERGY CORP	5,500	116.110	638,605.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,200	62.110	633,522.000	
CITIGROUP INC	80,473	51.330	4,130,679.090	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,000	220.680	3,751,560.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,400	101.950	2,079,780.000	
ALLEGHANY CORP	520	834.160	433,763.200	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	368.120	563,223.600	
HESS CORP	11,300	127.890	1,445,157.000	

DAVITA INC	2,750	96.700	265,925.000	
DANAHER CORP	27,650	266.050	7,356,282.500	
FORTIVE CORP	13,800	62.580	863,604.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	22,800	100.940	2,301,432.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,800	87.910	2,004,348.000	
BUNGE LTD	5,700	112.990	644,043.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,195	130.070	1,716,273.650	
APPLE INC	661,100	145.380	96,110,718.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,400	110.280	1,257,192.000	
BOEING CO/THE	22,500	139.250	3,133,125.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,215	126.340	785,203.100	
BECTON DICKINSON AND CO	11,499	252.340	2,901,657.660	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,400	105.780	571,212.000	
NISOURCE INC	16,500	31.420	518,430.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,100	108.020	550,902.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,771	45.590	1,402,849.890	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	170,304	50.810	8,653,146.240	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	52,350	310.940	16,277,709.000	
ANSYS INC	3,500	259.040	906,640.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	53,817	49.090	2,641,876.530	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	28,400	121.350	3,446,340.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	88,300	75.170	6,637,511.000	
JPMORGAN CHASE & CO	119,670	130.160	15,576,247.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,300	125.050	1,162,965.000	
LKQ CORP	10,800	50.680	547,344.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,612	66.170	834,536.040	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,200	158.560	1,775,872.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,500	271.350	1,221,075.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,400	226.950	2,133,330.000	
SERVICENOW INC	8,100	492.480	3,989,088.000	
CATERPILLAR INC	21,700	222.900	4,836,930.000	
BROWN & BROWN INC	9,700	58.740	569,778.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,400	47.160	443,304.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,000	242.980	485,960.000	
CMS ENERGY CORP	11,700	71.140	832,338.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	59.690	889,381.000	
DELTA AIR LINES INC	6,200	38.540	238,948.000	

CORNING INC	32,600	35.840	1,168,384.000	
CISCO SYSTEMS INC	168,450	45.250	7,622,362.500	
MORGAN STANLEY	54,152	84.120	4,555,266.240	
MSCI INC	3,300	438.450	1,446,885.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	420.450	462,495.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	210.750	273,975.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,400	64.480	606,112.000	
BROADCOM INC	16,612	563.320	9,357,871.840	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,900	131.520	644,448.000	
ARAMARK	9,000	34.620	311,580.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,900	132.090	1,043,511.000	
CENTENE CORP	23,607	81.970	1,935,065.790	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,200	114.000	478,800.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,200	40.470	817,494.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,500	162.210	1,378,785.000	
GARTNER INC	3,350	266.790	893,746.500	
SPLUNK INC	6,300	105.520	664,776.000	
DOMINION ENERGY INC	32,941	82.710	2,724,550.110	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,100	88.830	1,430,163.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	60.840	322,452.000	
DEERE & CO	11,800	361.000	4,259,800.000	
QUANTA SERVICES INC	6,000	129.120	774,720.000	
POOL CORP	1,600	407.270	651,632.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,284	129.680	1,463,309.120	
VMWARE INC-CLASS A	8,500	131.990	1,121,915.000	
CABLE ONE INC	200	1,288.590	257,718.000	
BURLINGTON STORES INC	2,700	170.870	461,349.000	
NASDAQ INC	4,600	154.070	708,722.000	
VAIL RESORTS INC	1,600	257.170	411,472.000	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,900	12.450	260,205.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,000	77.350	696,150.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,800	139.780	391,384.000	
WESTLAKE CORP	1,600	130.730	209,168.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,400	97.910	1,409,904.000	
COGNEX CORP	6,900	48.060	331,614.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,300	50.220	366,606.000	
TELEFLEX INC	1,900	281.850	535,515.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,400	179.400	609,960.000	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,000	309.880	929,640.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	900	535.580	482,022.000	
CATALENT INC	6,900	110.820	764,658.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,600	187.970	1,052,632.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,400	281.740	676,176.000	
IDEX CORP	3,100	195.160	604,996.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,400	78.930	2,557,332.000	
ROLLINS INC	8,607	34.920	300,556.440	
AMETEK INC	9,400	122.410	1,150,654.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,800	88.740	869,652.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	49.030	316,243.500	
HEICO CORP	1,800	145.700	262,260.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,600	268.880	699,088.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,500	379.320	568,980.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,600	107.400	1,138,440.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,700	356.850	606,645.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	17,960	476.250	8,553,450.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,250	79.950	259,837.500	
EPAM SYSTEMS INC	2,300	332.340	764,382.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,300	87.950	466,135.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,100	1,375.060	1,512,566.000	
UGI CORP	8,500	43.210	367,285.000	
CUMMINS INC	5,800	211.020	1,223,916.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,600	77.890	2,461,324.000	
CDW CORP/DE	5,500	175.590	965,745.000	
SIGNATURE BANK	2,550	218.040	556,002.000	
COSTAR GROUP INC	16,000	62.520	1,000,320.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,400	480.280	1,152,672.000	
AMERCO	400	498.710	199,484.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,000	268.190	1,072,760.000	
MERCADOLIBRE INC	1,790	788.900	1,412,131.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,000	186.080	558,240.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,316	142.170	1,608,795.720	
DEXCOM INC	3,900	292.790	1,141,881.000	
NORDSON CORP	2,090	220.380	460,594.200	
COPART INC	8,700	115.260	1,002,762.000	

DIAMONDBACK ENERGY INC	6,800	154.660	1,051,688.000	
SEAGEN INC	5,600	139.940	783,664.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,000	273.600	820,800.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,300	198.050	653,565.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,090	616.350	1,288,171.500	
BIO-TECHNE CORP	1,580	363.100	573,698.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,900	95.540	372,606.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,700	91.290	794,223.000	
KINDER MORGAN INC	82,681	19.930	1,647,832.330	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	207.590	2,034,382.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,500	278.480	417,720.000	
COTERRA ENERGY INC	33,000	35.180	1,160,940.000	
T-MOBILE US INC	25,327	136.610	3,459,921.470	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	39.350	265,612.500	
COCA-COLA CO/THE	167,050	62.970	10,519,138.500	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,500	53.440	454,240.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	109.940	764,083.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,700	26.460	309,582.000	
CSX CORP	88,900	32.110	2,854,579.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,800	243.650	925,870.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,125	131.660	806,417.500	
AMAZON.COM INC	18,560	2,447.000	45,416,320.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25,300	96.730	2,447,269.000	
EXXON MOBIL CORP	171,705	99.090	17,014,248.450	
AES CORP	27,100	22.270	603,517.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	280.290	448,464.000	
EOG RESOURCES INC	23,700	142.480	3,376,776.000	
EQT CORP	14,100	47.990	676,659.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,500	100.840	655,460.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	684.600	342,300.000	
ABIOMED INC	1,800	262.250	472,050.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,400	147.030	940,992.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,200	128.490	1,567,578.000	
FORD MOTOR CO	159,523	13.500	2,153,560.500	
EXACT SCIENCES CORP	7,100	47.550	337,605.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,237	24.140	150,561.180	
ENTEGRIS INC	5,500	111.680	614,240.000	

AERCAP HOLDINGS NV	5,600	49.210	275,576.000	
FORTINET INC	5,500	296.640	1,631,520.000	
MARKEL CORP	550	1,380.160	759,088.000	
NEXTERA ENERGY INC	79,580	78.690	6,262,150.200	
MASIMO CORP	2,000	140.000	280,000.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	59,008	41.330	2,438,800.640	
INSULET CORP	2,800	212.570	595,196.000	
US BANCORP	57,200	51.940	2,970,968.000	
UNITED RENTALS INC	2,900	301.250	873,625.000	
F5 NETWORKS INC	2,500	166.510	416,275.000	
FASTENAL CO	23,300	54.440	1,268,452.000	
FISERV INC	25,133	99.670	2,505,006.110	
GENERAL ELECTRIC CO	44,606	76.970	3,433,323.820	
GENERAL MOTORS CO	56,000	37.610	2,106,160.000	
ZENDESK INC	4,900	89.780	439,922.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,600	230.130	2,209,248.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,750	318.680	4,381,850.000	
ALPHABET INC-CL A	12,190	2,290.820	27,925,095.800	
ALPHABET INC-CL C	11,507	2,291.280	26,365,758.960	
OWENS CORNING	3,900	94.880	370,032.000	
GENERAL MILLS INC	24,500	68.390	1,675,555.000	
FIRSTENERGY CORP	22,018	41.880	922,113.840	
GENUINE PARTS CO	5,850	135.950	795,307.500	
FIFTH THIRD BANCORP	27,700	38.920	1,078,084.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,850	243.140	1,908,649.000	
HALLIBURTON CO	36,400	41.950	1,526,980.000	
HOME DEPOT INC	42,350	305.080	12,920,138.000	
ASSURANT INC	2,250	180.390	405,877.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	58,300	13.590	792,297.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,610	212.840	342,672.400	
HERSHEY CO/THE	5,900	209.180	1,234,162.000	
HUMANA INC	5,100	442.410	2,256,291.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,900	182.370	1,987,833.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,320	63.540	210,952.800	
HENRY SCHEIN INC	5,600	84.170	471,352.000	
HP INC	47,300	39.810	1,883,013.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	52,700	15.080	794,716.000	

LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	40.670	277,694.760	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,900	62.160	491,064.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	40.690	120,035.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,400	46.720	719,488.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	29,803	36.300	1,081,848.900	
ENPHASE ENERGY INC	5,400	196.340	1,060,236.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,500	141.180	5,153,070.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,300	47.090	673,387.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	70.850	368,420.000	
ZOETIS INC	19,100	169.010	3,228,091.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,499	138.440	1,315,041.560	
CHENIERE ENERGY INC	9,400	141.960	1,334,424.000	
ALLEGION PLC	3,650	111.440	406,756.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	25.240	327,438.520	
WASTE CONNECTIONS INC	10,437	129.160	1,348,042.920	
JUNIPER NETWORKS INC	12,700	30.800	391,160.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,400	122.770	540,188.000	
JOHNSON & JOHNSON	106,600	176.420	18,806,372.000	
PLUG POWER INC	21,100	17.900	377,690.000	
ABBVIE INC	71,672	147.170	10,547,968.240	
HOLOGIC INC	10,100	75.300	760,530.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	13,700	131.440	1,800,728.000	
KROGER CO	28,300	52.540	1,486,882.000	
KLA CORP	6,100	362.440	2,210,884.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,900	442.690	4,382,631.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	243.670	755,377.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	38.100	400,050.000	
LOWE'S COS INC	27,200	195.450	5,316,240.000	
ELI LILLY & CO	32,785	301.650	9,889,595.250	
LAM RESEARCH CORP	5,680	513.980	2,919,406.400	
LOEWS CORP	8,600	64.740	556,764.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	55.670	370,149.830	
MCDONALD'S CORP	30,150	248.360	7,488,054.000	
3M CO	23,190	145.970	3,385,044.300	

META PLATFORMS INC CLASS A	93,600	190.780	17,857,008.000	
S&P GLOBAL INC	14,439	335.930	4,850,493.270	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,500	345.640	864,100.000	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,120	298.340	632,480.800	
ALCOA CORP	7,700	61.830	476,091.000	
PHILLIPS 66	19,500	104.460	2,036,970.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	34.710	557,095.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,100	89.850	907,485.000	
METLIFE INC	28,400	66.190	1,879,796.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	34,200	58.960	2,016,432.000	
ARISTA NETWORKS INC	10,000	103.170	1,031,700.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,798	225.550	1,533,288.900	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	900	1,298.900	1,169,010.000	
BAKER HUGHES CO	38,823	37.820	1,468,285.860	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,700	218.270	1,025,869.000	
MERCK & CO. INC.	102,521	89.910	9,217,663.110	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	66.920	1,388,656.920	
MASCO CORP	9,500	56.330	535,135.000	
M & T BANK CORP	7,299	177.970	1,299,003.030	
MARSH & MCLENNAN COS	20,370	157.260	3,203,386.200	
BLACK KNIGHT INC	6,350	69.560	441,706.000	
HEICO CORP-CLASS A	3,020	117.910	356,088.200	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,202	174.650	1,956,429.300	
WORKDAY INC-CLASS A	8,000	162.130	1,297,040.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,900	58.300	169,070.000	
BLOCK INC CLASS A	21,012	83.100	1,746,097.200	
TRANSUNION	7,800	85.860	669,708.000	
VISTRA CORP	17,600	25.850	454,960.000	
NOVOCURE LTD	3,850	79.790	307,191.500	
NETAPP INC	9,000	71.110	639,990.000	
NIKE INC -CL B	51,700	120.950	6,253,115.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,700	244.660	2,373,202.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,500	71.240	1,602,900.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,605	95.970	729,851.850	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	42.350	601,370.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,000	478.370	2,870,220.000	
APTIV PLC	11,000	106.280	1,169,080.000	

NEWMONT CORP	32,311	67.820	2,191,332.020	
MCKESSON CORP	6,100	316.380	1,929,918.000	
XYLEM INC	7,300	85.480	624,004.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,800	105.520	6,626,656.000	
NUCOR CORP	11,100	128.710	1,428,681.000	
WESTERN UNION CO	15,246	17.600	268,329.600	
GODADDY INC - CLASS A	6,800	72.730	494,564.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	21.120	347,255.040	
EVERGY INC	9,350	70.010	654,593.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	37,924	70.290	2,665,677.960	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,050	170.880	179,424.000	
OKTA INC	6,000	98.380	590,280.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,900	70.760	205,204.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	122.190	684,264.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	24.190	418,607.950	
LINDE PLC	20,846	331.900	6,918,787.400	
WIX.COM LTD	2,310	59.140	136,613.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	29.390	464,362.000	
KKR & CO INC	22,600	55.320	1,250,232.000	
PAYCHEX INC	13,200	125.810	1,660,692.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	631.610	1,705,347.000	
ALTRIA GROUP INC	73,700	53.820	3,966,534.000	
P G & E CORP	60,400	12.400	748,960.000	
PFIZER INC	228,013	53.200	12,130,291.600	
CIGNA CORP	13,000	253.970	3,301,610.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	51.020	602,087.020	
XCEL ENERGY INC	22,100	74.880	1,654,848.000	
STERIS PLC	4,100	220.470	903,927.000	
SEA LTD-ADR	14,900	78.760	1,173,524.000	
FOX CORP - CLASS B	6,033	31.650	190,944.450	
FOX CORP - CLASS A	12,799	34.130	436,829.870	
STRYKER CORP	13,780	229.020	3,155,895.600	
LYFT INC-A	12,500	17.400	217,500.000	
DOW INC	29,818	67.030	1,998,700.540	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,100	67.640	277,324.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,800	109.420	962,896.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,200	276.840	1,439,568.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	59,400	24.150	1,434,510.000	

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,400	279.470	2,627,018.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	97,167	145.890	14,175,693.630	
EXELON CORP	39,722	48.730	1,935,653.060	
TELADOC HEALTH INC	6,500	34.530	224,445.000	
INGERSOLL-RAND INC	16,508	48.850	806,415.800	
NVR INC	130	4,428.000	575,640.000	
CONOCOPHILLIPS	52,702	118.120	6,225,160.240	
TWILIO INC - A	7,000	101.740	712,180.000	
DOCUSIGN INC	8,000	83.780	670,240.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,100	298.520	626,892.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,300	55.180	292,454.000	
PEPSICO INC	56,100	164.850	9,248,085.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,620	143.660	232,729.200	
DROPBOX INC-CLASS A	11,400	22.820	260,148.000	
MONGODB INC	2,700	273.130	737,451.000	
SNAP INC - A	44,400	14.490	643,356.000	
CORTEVA INC	29,468	62.000	1,827,016.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,200	103.960	1,580,192.000	
AMCOR PLC	61,400	13.390	822,146.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,000	162.100	1,296,800.000	
ROKU INC	4,800	87.280	418,944.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,400	155.150	1,148,110.000	
ACCENTURE PLC-CL A	25,600	304.950	7,806,720.000	
KORNIT DIGITAL LTD	1,900	40.630	77,197.000	
PENTAIR PLC	6,675	50.800	339,090.000	
QUALCOMM INC	45,700	141.220	6,453,754.000	
INVESCO LTD	14,100	18.700	263,670.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,550	190.730	486,361.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	70.880	751,328.000	
DATADOG INC - CLASS A	9,100	105.440	959,504.000	
PINTEREST INC- CLASS A	23,100	19.460	449,526.000	
AVALARA INC	3,650	88.870	324,375.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,300	630.350	2,710,505.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,000	134.410	1,209,690.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	2,335.870	3,970,979.000	
ROSS STORES INC	14,300	82.720	1,182,896.000	

PACKAGING CORP OF AMERICA	3,830	159.120	609,429.600	
RESMED INC	5,900	208.310	1,229,029.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	136.200	644,226.000	
ROBERT HALF INTL INC	4,500	89.990	404,955.000	
MODERNA INC	13,900	137.150	1,906,385.000	
HUBSPOT INC	1,780	354.110	630,315.800	
PERKINELMER INC	5,100	147.670	753,117.000	
CARRIER GLOBAL CORP	34,687	39.590	1,373,258.330	
OTIS WORLDWIDE CORP	17,338	75.190	1,303,644.220	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,800	127.390	484,082.000	
AVANTOR INC	24,800	32.680	810,464.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,000	39.730	317,840.000	
DYNATRACE INC	8,100	40.980	331,938.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,900	51.150	915,585.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	37,985	21.750	826,173.750	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	41.270	453,970.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,000	40.520	567,280.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,230	87.890	283,884.700	
MATCH GROUP INC	11,600	82.210	953,636.000	
CHEVRON CORP	79,018	177.600	14,033,596.800	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	11,700	12.530	146,601.000	
ZSCALER INC	3,400	156.930	533,562.000	
EDISON INTERNATIONAL	15,400	69.780	1,074,612.000	
ETSY INC	5,200	80.980	421,096.000	
TESLA INC	35,550	703.550	25,011,202.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,700	129.820	1,129,434.000	
NORTONLIFELOCK INC	23,600	24.680	582,448.000	
UNITY SOFTWARE INC	7,900	41.760	329,904.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	114.530	756,127.060	
SYNOPSYS INC	6,200	327.680	2,031,616.000	
CARVANA CO	3,900	26.520	103,428.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,250	28.800	93,600.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,100	54.540	550,854.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	491.070	2,408,698.350	
VIATRIS INC	49,021	11.710	574,035.910	
DOORDASH INC - A	7,850	68.040	534,114.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	14,600	30.000	438,000.000	
AIRBNB INC-CLASS A	13,600	119.830	1,629,688.000	

CBRE GROUP INC - A	13,600	79.900	1,086,640.000	
TWITTER INC	32,500	40.160	1,305,200.000	
SOUTHERN CO/THE	43,000	75.260	3,236,180.000	
SYSCO CORP	20,600	84.250	1,735,550.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,803	174.190	1,707,584.570	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	36.860	92,150.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,600	57.900	266,340.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,850	82.940	651,079.000	
SCHLUMBERGER LTD	57,252	47.470	2,717,752.440	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	48.220	298,964.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	25.100	193,270.000	
AT&T INC	289,591	20.900	6,052,451.900	
APA CORP	14,400	48.300	695,520.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,050	43.840	265,232.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,500	62.940	1,101,450.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,700	50.600	440,220.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,000	268.880	2,688,800.000	
SEMPRA ENERGY	12,800	160.250	2,051,200.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,800	35.410	276,198.000	
CLARIVATE PLC	13,400	14.690	196,846.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	66,500	8.940	594,510.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	82.710	698,899.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,900	66.690	326,781.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	37,400	172.330	6,445,142.000	
SALESFORCE.COM INC	39,866	184.910	7,371,622.060	
WESTROCK CO	10,700	49.270	527,189.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	16,209	57.780	936,556.020	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	28,534	54.410	1,552,534.940	
TERADYNE INC	6,600	107.430	709,038.000	
UNION PACIFIC CORP	25,780	224.000	5,774,720.000	
MARATHON OIL CORP	29,900	31.680	947,232.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	105.620	2,533,612.560	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	60,479	96.330	5,825,942.070	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,700	185.490	5,509,053.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,704	219.440	1,690,565.760	

AMEREN CORPORATION	10,500	93.310	979,755.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,066	485.610	18,485,230.260	
APPLOVIN CORP CLASS A	4,900	39.430	193,207.000	
VERISIGN INC	4,000	177.700	710,800.000	
LUCID GROUP INC	16,800	18.670	313,656.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	7,000	30.190	211,330.000	
VALERO ENERGY CORP	16,642	135.420	2,253,659.640	
UPSTART HOLDINGS INC	2,800	48.540	135,912.000	
ULTA BEAUTY INC	2,200	404.410	889,702.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,888	42.310	460,671.280	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	121.170	342,911.100	
ANTHEM INC	9,800	493.260	4,833,948.000	
WALT DISNEY CO/THE	73,762	108.670	8,015,716.540	
WELLS FARGO & CO	155,022	44.820	6,948,086.040	
WASTE MANAGEMENT INC	16,800	159.120	2,673,216.000	
WILLIAMS COS INC	49,300	37.510	1,849,243.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,600	194.440	894,424.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	176.040	422,496.000	
WALMART INC	61,900	125.320	7,757,308.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,500	120.630	1,025,355.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	65.230	293,535.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	45,500	2.540	115,570.000	
WABTEC CORP	7,111	94.670	673,198.370	
TJX COMPANIES INC	48,400	62.030	3,002,252.000	
WATERS CORP	2,500	339.010	847,525.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	334.770	736,494.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	29,700	43.140	1,281,258.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	206.630	1,004,841.690	
WESTERN DIGITAL CORP	12,700	60.080	763,016.000	
WEC ENERGY GROUP INC	12,800	104.180	1,333,504.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,400	68.500	1,397,400.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	67,250	212.650	14,300,712.500	
PPL CORP	29,800	29.830	888,934.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	13,224	65.170	861,808.080	

PULTEGROUP INC	9,850	45.060	443,841.000	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	90,253	17.500	1,579,427.500	
PPG INDUSTRIES INC	9,600	125.460	1,204,416.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,000	110.030	880,240.000	
NVIDIA CORP	101,380	187.200	18,978,336.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,013	173.300	2,948,352.900	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	67.700	236,950.000	
TYSON FOODS INC-CL A	11,900	87.410	1,040,179.000	
NETFLIX INC	17,990	198.980	3,579,650.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,900	558.100	8,873,790.000	
NRG ENERGY INC	9,850	45.480	447,978.000	
GLOBE LIFE INC	3,655	96.400	352,342.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,200	153.740	1,106,928.000	
TEXTRON INC	8,600	66.580	572,588.000	
NEWS CORP - CLASS A	15,287	17.200	262,936.400	
OMNICOM GROUP	8,300	71.630	594,529.000	
ORACLE CORP	64,933	71.790	4,661,540.070	
MASTERCARD INC - A	35,400	357.820	12,666,828.000	
ONEOK INC	18,100	67.270	1,217,587.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	37,352	11.640	434,777.280	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,300	432.060	1,857,858.000	
YUM! BRANDS INC	11,700	118.620	1,387,854.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	6,600	126.970	838,002.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,400	53.560	396,344.000	
BANK OF AMERICA CORP	294,401	36.190	10,654,372.190	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,900	405.150	769,785.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,500	77.490	581,175.000	
AMERICAN EXPRESS CO	26,200	166.830	4,370,946.000	
ANALOG DEVICES INC	21,191	165.240	3,501,600.840	
ADVANCED MICRO DEVICES	66,327	106.300	7,050,560.100	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	57.290	1,888,965.880	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,600	106.710	704,286.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,300	56.330	523,869.000	

AVERY DENNISON CORP	3,330	177.320	590,475.600	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,300	73.560	1,566,828.000	
EMERSON ELECTRIC CO	24,100	90.280	2,175,748.000	
AON PLC-CLASS A	8,700	268.580	2,336,646.000	
AMGEN INC	22,600	248.450	5,614,970.000	
EATON CORP PLC	16,236	140.350	2,278,722.600	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	243.330	1,630,311.000	
APPLIED MATERIALS INC	35,800	114.960	4,115,568.000	
CME GROUP INC	14,600	200.000	2,920,000.000	
ECOLAB INC	10,500	170.460	1,789,830.000	
EQUIFAX INC	4,900	200.560	982,744.000	
GILEAD SCIENCES INC	50,800	63.450	3,223,260.000	
KEURIG DR PEPPER INC	31,700	34.930	1,107,281.000	
HORMEL FOODS CORP	12,100	45.120	545,952.000	
STATE STREET CORP	14,813	71.300	1,056,166.900	
SCHWAB (CHARLES) CORP	58,840	70.070	4,122,918.800	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,400	72.540	1,479,816.000	
CAMPBELL SOUP CO	8,600	45.730	393,278.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	106.850	532,113.000	
CARDINAL HEALTH INC	11,000	53.820	592,020.000	
FEDEX CORP	10,200	218.700	2,230,740.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	124.050	2,078,333.700	
FMC CORP	5,150	121.320	624,798.000	
CERNER CORP	11,900	94.970	1,130,143.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,313	132.570	1,367,194.410	
CITRIX SYSTEMS INC	5,100	101.410	517,191.000	
INTEL CORP	165,100	43.390	7,163,689.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,000	31.080	497,280.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,450	71.880	966,786.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,700	207.830	2,639,441.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.270	242,022.000	
ILLUMINA INC	6,400	232.970	1,491,008.000	
SEALED AIR CORP	5,800	62.790	364,182.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	14,500	217.790	3,157,955.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	129.760	564,456.000	
SNAP-ON INC	2,200	220.190	484,418.000	
CARMAX INC	6,600	96.350	635,910.000	
DUKE ENERGY CORP	31,228	111.160	3,471,304.480	

TARGET CORP	19,400	161.040	3,124,176.000	
DOVER CORP	5,800	133.430	773,894.000	
WW GRAINGER INC	1,900	496.280	942,932.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	138.130	721,038.600	
CINTAS CORP	3,800	396.090	1,505,142.000	
CONAGRA BRANDS INC	19,400	32.000	620,800.000	
CLOROX COMPANY	5,000	138.880	694,400.000	
ENTERGY CORP	8,200	120.000	984,000.000	
MICROSOFT CORP	288,600	270.020	77,927,772.000	
INCYTE CORP	7,600	73.960	562,096.000	
CVS HEALTH CORP	53,169	94.900	5,045,738.100	
MEDTRONIC PLC	54,398	95.480	5,193,921.040	
MICRON TECHNOLOGY INC	45,400	69.940	3,175,276.000	
BLACKROCK INC	6,200	671.740	4,164,788.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	25,500	31.670	807,585.000	
HASBRO INC	5,400	88.790	479,466.000	
KELLOGG CO	10,400	67.760	704,704.000	
KEYCORP	37,600	19.640	738,464.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	56,311	62.410	3,514,369.510	
COOPER COS INC/THE	2,000	342.270	684,540.000	
CHUBB LTD	17,299	208.530	3,607,360.470	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	121.950	329,265.000	
ALLSTATE CORP	11,200	131.970	1,478,064.000	
EBAY INC	24,900	47.090	1,172,541.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	44,950	86.530	3,889,523.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	110.220	573,144.000	
DISH NETWORK CORP-A	9,600	21.500	206,400.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,400	264.220	2,483,668.000	
TRIMBLE INC	10,200	68.630	700,026.000	
LENNAR CORP-A	10,600	80.190	850,014.000	
LEAR CORP	2,300	138.280	318,044.000	
PROGRESSIVE CORP	23,700	119.110	2,822,907.000	
PACCAR INC	14,137	88.290	1,248,155.730	
BIOGEN INC	6,000	200.620	1,203,720.000	
IDEXX LABORATORIES INC	3,400	372.630	1,266,942.000	
STARBUCKS CORP	46,600	79.050	3,683,730.000	
PTC INC	4,400	118.560	521,664.000	

	EVERSOURCE ENERGY	14,000	92.300	1,292,200.000	
	INTUIT INC	10,880	408.950	4,449,376.000	
	BORGWARNER INC	9,700	39.300	381,210.000	
	BEST BUY CO INC	8,850	80.390	711,451.500	
	BALL CORP	13,004	73.600	957,094.400	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,897	39.910	2,310,669.270	
	ELECTRONIC ARTS INC	11,400	141.000	1,607,400.000	
	VULCAN MATERIALS CO	5,400	165.940	896,076.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,300	269.440	2,775,232.000	
	VF CORP	13,400	50.080	671,072.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	24,625	30.800	758,450.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	139.150	306,130.000	
	CARNIVAL CORP	34,000	13.510	459,340.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	22.980	500,964.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	183,390	42.930	7,872,932.700	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	57.430	499,641.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,800	5.170	231,616.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 1,448,372,654.080 (189,505,078,060)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	305,297	23.610	7,208,062.170	
	BP PLC	781,294	4.313	3,369,721.020	
	UNILEVER PLC	102,796	37.050	3,808,591.800	
	BARCLAYS PLC	672,697	1.678	1,128,785.560	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	336,390	0.887	298,478.840	
	PRUDENTIAL PLC	110,258	10.180	1,122,426.440	
	NATWEST GROUP PLC	225,536	2.267	511,290.110	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	21.000	148,344.000	
	BAE SYSTEMS PLC	126,279	7.782	982,703.170	
	AVIVA PLC	115,648	4.287	495,782.970	
	AVEVA GROUP PLC	4,400	22.150	97,460.000	
	GSK	204,162	17.078	3,486,678.630	
	INFORMA PLC	60,095	5.374	322,950.530	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	169,100	1.334	225,579.400	
	AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	5.868	222,995.730	
	DCC PLC	3,964	56.040	222,142.560	
	OCADO GROUP PLC	18,300	9.086	166,273.800	

SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,900	104.800	303,920.000	
HALMA PLC	15,260	21.810	332,820.600	
ENTAIN PLC	22,700	14.600	331,420.000	
JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.221	121,733.700	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	6.334	191,084.110	
M&G PLC	104,504	2.164	226,146.650	
RELX PLC	77,624	22.070	1,713,161.680	
DIAGEO PLC	92,930	36.220	3,365,924.600	
RIO TINTO PLC	45,102	57.580	2,596,973.160	
STANDARD CHARTERED PLC	104,659	6.328	662,282.150	
TESCO PLC	306,336	2.589	793,103.900	
SMITH & NEPHEW PLC	35,311	12.690	448,096.590	
GLENCORE PLC	396,950	5.237	2,078,827.150	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	8.384	111,088.000	
SMITHS GROUP PLC	15,383	15.610	240,128.630	
PEARSON PLC	28,363	7.488	212,382.140	
SAINSBURY (J) PLC	65,325	2.272	148,418.400	
NEXT PLC	5,311	64.620	343,196.820	
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.297	190,308.210	
WHITBREAD PLC	8,127	26.290	213,658.830	
BUNZL PLC	13,562	28.110	381,227.820	
VODAFONE GROUP PLC	1,081,003	1.267	1,369,630.800	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,601	67.580	378,515.580	
KINGFISHER PLC	78,711	2.599	204,569.880	
WPP PLC	45,847	9.228	423,076.110	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,400	10.400	274,560.000	
SEVERN TRENT PLC	9,733	28.330	275,735.890	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,706	4.940	369,047.640	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,699	61.800	1,773,598.200	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,732	12.475	271,106.700	
SCHRODERS PLC	4,650	28.940	134,571.000	
SSE PLC	42,791	17.605	753,335.550	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,500	5.000	197,500.000	
ASTRAZENECA PLC	62,204	104.420	6,495,341.680	
FERGUSON PLC	8,777	93.120	817,314.240	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	239,689	2.556	612,645.080	
3I GROUP PLC	39,073	12.385	483,919.100	
ASHTEAD GROUP PLC	17,854	40.110	716,123.940	

	SAGE GROUP PLC/THE	40,114	6.536	262,185.100	
	NATIONAL GRID PLC	146,368	11.210	1,640,785.280	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.451	1,286,068.360	
	IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	17.915	683,654.310	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	42.380	179,352.160	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	87,395	35.365	3,090,724.170	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,800	17.050	235,290.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	812,875	5.296	4,304,986.000	
	ANGLO AMERICAN PLC	51,015	38.500	1,964,077.500	
	MONDI PLC	18,800	15.320	288,016.000	
	COMPASS GROUP PLC	71,629	17.690	1,267,117.010	
	PERSIMMON PLC	12,832	21.850	280,379.200	
	BT GROUP PLC	345,300	1.876	647,782.800	
	COCA-COLA HBC AG-DI	7,800	17.030	132,834.000	
	BURBERRY GROUP PLC	16,061	17.015	273,277.910	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,136	48.410	345,453.760	
	INTERTEK GROUP PLC	6,481	45.580	295,403.980	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,211	71.440	943,793.840	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	16.730	110,418.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,500	22.010	165,075.000	
	ANTOFAGASTA PLC	15,300	14.950	228,735.000	
	ABRDN PLC	84,362	1.927	162,607.750	
	EXPERIAN PLC	37,016	25.680	950,570.880	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 74,113,349.270 (12,102,709,936)	
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	51,498	19.000	978,462.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,650	244.500	403,425.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,541	160.500	728,830.500	
	ICL GROUP LTD	28,100	36.320	1,020,592.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,100	682.000	750,200.000	
	BANK HAPOALIM BM	52,858	30.830	1,629,612.140	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	60,486	32.820	1,985,150.520	
	NICE LTD	2,628	661.800	1,739,210.400	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,407	116.600	747,056.200	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 9,982,538.760 (391,960,392)	
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	
	THE LOTTERY CORPORATION LTD	84,950	4.430	376,328.500	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	3.190	335,249.860	
	BHP GROUP LTD	192,410	46.760	8,997,091.600	
	SOUTH32 LTD	177,077	5.080	899,551.160	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,702	31.800	2,280,123.600	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,370	21.460	1,381,380.200	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,782	31.280	3,840,620.960	
	WESTPAC BANKING CORP	134,848	24.000	3,236,352.000	
	SANTOS LTD	122,304	8.400	1,027,353.600	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	106,511	25.020	2,664,905.220	
	RIO TINTO LTD	14,134	116.030	1,639,968.020	
	ORIGIN ENERGY LTD	64,700	6.160	398,552.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	67,600	4.170	281,892.000	
	XERO LTD	5,135	85.630	439,710.050	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	25.440	200,976.000	
	COLES GROUP LTD	50,794	17.730	900,577.620	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,400	42.940	231,876.000	
	IDP EDUCATION LTD	7,900	24.590	194,261.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	44,584	8.790	391,893.360	
	EVOLUTION MINING LTD	65,600	3.780	247,968.000	
	REECE LTD	10,500	15.300	160,650.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	51,260	7.180	368,046.800	
	SEEK LTD	12,845	24.090	309,436.050	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,529	11.790	324,566.910	
	NEWCREST MINING LTD	34,097	24.640	840,150.080	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	64,787	105.200	6,815,592.400	
	AMPOL LTD	8,800	35.190	309,672.000	
	ORICA LTD	14,900	16.720	249,128.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	56,269	12.030	676,916.070	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	45,992	34.640	1,593,162.880	
	CROWN RESORTS LTD	13,400	12.850	172,190.000	

	QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	5.490	194,724.810	
	TELSTRA CORP LTD	156,394	3.920	613,064.480	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	16,400	34.250	561,700.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	13,928	184.040	2,563,309.120	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,909	33.960	777,989.640	
	CSL LTD	18,315	269.000	4,926,735.000	
	WESFARMERS LTD	43,107	47.150	2,032,495.050	
	COCHLEAR LTD	2,510	218.960	549,589.600	
	BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	18.610	331,258.000	
	SUNCORP GROUP LTD	48,015	11.090	532,486.350	
	ASX LTD	7,365	81.200	598,038.000	
	COMPUTERSHARE LTD	20,689	23.330	482,674.370	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	90,636	4.260	386,109.360	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,328	35.640	617,569.920	
	BRAMBLES LTD	52,700	10.900	574,430.000	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,200	60.350	374,170.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,973	76.960	536,642.080	
	REA GROUP LTD	2,023	112.410	227,405.430	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	66.510	146,322.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 58,812,855.150 (5,543,699,727)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	33,500	57.700	1,932,950.000	
	IMPERIAL OIL LTD	9,100	69.690	634,179.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	1,910.280	1,528,224.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	11,687	65.570	766,316.590	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,900	53.310	954,249.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,050	184.670	1,301,923.500	
	BCE INC	4,930	68.570	338,050.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,600	180.980	1,375,448.000	
	SUNCOR ENERGY INC	56,730	51.420	2,917,056.600	
	METRO INC/CN	9,600	71.610	687,456.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	13,400	97.310	1,303,954.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	48,200	85.210	4,107,122.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,700	70.340	2,511,138.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	72,200	95.630	6,904,486.000	

GREAT-WEST LIFECO INC	10,700	33.000	353,100.000	
ROYAL BANK OF CANADA	56,150	131.950	7,408,992.500	
TOURMALINE OIL CORP	12,500	76.710	958,875.000	
TC ENERGY CORP	38,950	73.870	2,877,236.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	21,829	52.230	1,140,128.670	
BARRICK GOLD CORP	70,500	26.040	1,835,820.000	
CAE INC	12,600	33.910	427,266.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	125.730	856,472.760	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	41.210	267,865.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	118.710	415,485.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,850	60.800	355,680.000	
HYDRO ONE LTD	13,100	35.400	463,740.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,560	117.630	771,652.800	
NORTHLAND POWER INC	8,700	38.540	335,298.000	
WSP GLOBAL INC	4,700	146.670	689,349.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	111.010	366,333.000	
PARKLAND CORP	5,800	37.770	219,066.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	27.430	164,580.000	
EMERA INC	10,400	63.180	657,072.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	106.090	350,097.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	39.660	190,368.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,000	63.940	895,160.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	90.150	144,240.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	10.270	231,075.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,117	68.250	1,236,485.250	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	18.420	491,814.000	
AIR CANADA	6,500	21.290	138,385.000	
KINROSS GOLD CORP	46,500	5.720	265,980.000	
BANK OF MONTREAL	25,700	136.950	3,519,615.000	
POWER CORP OF CANADA	22,200	36.210	803,862.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,500	445.130	2,003,085.000	
NUTRIEN LTD	22,019	117.750	2,592,737.250	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,700	46.050	216,435.000	
CAMECO CORP	15,800	31.470	497,226.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	157.000	235,500.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	39.730	282,083.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,300	34.310	181,843.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	63.090	164,034.000	

	TELUS CORP	10,800	31.560	340,848.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	18,800	55.300	1,039,640.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	172.410	379,302.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	85.190	3,969,854.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	670.400	670,400.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	80.520	909,876.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	2,937	154.070	452,503.590	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	29.680	231,504.000	
	BLACKBERRY LTD	19,400	7.340	142,396.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,200	62.420	1,448,144.000	
	ENBRIDGE INC	80,300	58.930	4,732,079.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	55,925	63.280	3,538,934.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	77,000	23.280	1,792,560.000	
	BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	11.460	129,498.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	36,820	94.690	3,486,485.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,100	64.760	265,516.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	39.510	296,325.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,150	147.660	4,008,969.000	
	CGI INC - CLASS A	8,700	106.200	923,940.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	74.680	216,572.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,000	35.710	678,490.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	38.010	117,831.000	
	TMX GROUP LTD	2,100	138.090	289,989.000	
	OPEN TEXT CORP	10,400	51.170	532,168.000	
	SAPUTO INC	9,500	25.400	241,300.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	23,300	38.000	885,400.000	
	FORTIS INC	18,700	62.810	1,174,547.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	76.710	337,524.000	
	LUNDIN MINING CORP	24,600	11.130	273,798.000	
	CENOVUS ENERGY INC	55,500	30.230	1,677,765.000	
	DOLLARAMA INC	11,200	70.120	785,344.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	29.890	331,779.000	
	KEYERA CORP	8,800	34.570	304,216.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	19.900	569,140.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 99,441,226.910 (10,336,915,537)	

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	107,400	3.890	417,786.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,100	28.920	1,419,972.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	75,400	31.000	2,337,400.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,975	5.470	295,243.250	
	KEPPEL CORP LTD	59,300	6.840	405,612.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	7.380	126,198.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.220	132,342.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	141,000	11.860	1,672,260.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.780	185,640.000	
	VENTURE CORP LTD	11,200	17.840	199,808.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	343,850	2.580	887,133.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	62,700	4.130	258,951.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,700	9.730	347,361.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,000	4.190	335,200.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 9,020,906.250 (858,068,603)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	VIFOR N . LINIE AG	1,800	168.050	302,490.000	
	UBS GROUP AG-REG	138,062	18.070	2,494,780.340	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	370.000	436,600.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	811.000	227,080.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,360	37.080	235,828.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,580	320.700	8,844,906.000	
	SIKA AG-REG	5,717	267.400	1,528,725.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	98,300.000	393,200.000	
	ABB LTD-REG	64,447	30.320	1,954,033.040	
	SWISS RE AG	11,842	78.640	931,254.880	
	NESTLE SA-REG	110,493	114.900	12,695,645.700	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	1,002.000	901,800.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,601	192.350	307,952.350	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,049	6.598	686,515.300	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	49.700	432,787.600	
	SGS SA-REG	252	2,323.000	585,396.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	188.400	175,965.600	

	TEMENOS AG - REG	2,500	90.020	225,050.000	
	VAT GROUP AG	1,050	278.400	292,320.000	
	ALCON INC	19,611	72.220	1,416,306.420	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,090	250.400	272,936.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,905	435.700	2,572,808.500	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	160.800	289,440.000	
	CLARIANT AG-REG	7,700	18.650	143,605.000	
	NOVARTIS AG-REG	86,001	85.830	7,381,465.830	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	2,114.000	298,074.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	74.800	93,500.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	20,490	110.150	2,256,973.500	
	SWISSCOM AG-REG	1,000	570.200	570,200.000	
	GEBERIT AG-REG	1,400	526.800	737,520.000	
	GIVAUDAN-REG	360	3,493.000	1,257,480.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,389	117.950	517,682.550	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,110	335.500	707,905.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,600	58.180	383,988.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,925	563.200	1,647,360.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	47.580	90,402.000	
	HOLCIM LTD	21,829	47.940	1,046,482.260	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,237	544.000	672,928.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,135	250.700	535,244.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,025	93.800	283,745.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	9,590.000	402,780.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 57,231,157.970 (7,778,286,679)	
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	7,924	246.700	1,954,850.800	
	INVESTOR CLASS A	20,000	203.700	4,074,000.000	
	VOLVO CAR CLASS B	24,808	82.340	2,042,690.720	
	ERICSSON LM-B SHS	121,513	80.820	9,820,680.660	
	VOLVO AB-B SHS	62,823	179.000	11,245,317.000	
	SKF AB-B SHARES	15,400	180.600	2,781,240.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	152.320	1,309,952.000	
	SWEDISH MATCH AB	65,778	101.050	6,646,866.900	
	TELE2 AB-B SHS	20,200	121.700	2,458,340.000	
	GETINGE AB-B SHS	9,200	281.400	2,588,880.000	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	67,756	109.200	7,398,955.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,723	96.940	5,886,487.620	
	SWEDBANK AB - A SHARES	37,702	148.000	5,579,896.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	29,300	135.800	3,978,940.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	24,400	177.450	4,329,780.000	
	SKANSKA AB-B SHS	13,650	171.000	2,334,150.000	
	SANDVIK AB	45,700	207.800	9,496,460.000	
	INVESTOR AB-B SHS	75,850	183.440	13,913,924.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,824	112.000	12,524,288.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	187.400	1,499,200.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,906	498.300	1,946,359.800	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	101.000	1,206,950.000	
	TELIA CO AB	110,667	40.370	4,467,626.790	
	ALFA LAVAL AB	12,700	267.300	3,394,710.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	64,981	97.740	6,351,242.940	
	ASSA ABLOY AB-B	41,727	243.700	10,168,869.900	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	258.300	1,354,266.900	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	66.160	1,737,890.880	
	INDUTRADE AB	11,371	228.400	2,597,136.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,032	218.200	1,534,382.400	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	464.000	1,392,000.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	239.300	1,364,010.000	
	LIFCO AB-B SHS	9,500	192.450	1,828,275.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,092	86.280	5,443,577.760	
	LUNDIN ENERGY AB	8,050	474.900	3,822,945.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	25,354	258.400	6,551,473.600	
	EMBRACER GROUP AB	26,594	87.820	2,335,485.080	
	BOLIDEN AB	11,387	414.700	4,722,188.900	
	EPIROC AB-A	27,436	196.350	5,387,058.600	
	EPIROC AB-B	15,700	170.050	2,669,785.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	17,050	92.040	1,569,282.000	
	NORDEA BANK ABP	137,760	98.010	13,501,857.600	
	EQT AB	12,318	275.900	3,398,536.200	
	EVOLUTION AB	7,612	1,006.600	7,662,239.200	
	SINCH AB	21,300	44.575	949,447.500	
	KINNEVIK AB - B	9,300	194.600	1,809,780.000	
	HEXAGON AB-B SHS	81,032	120.300	9,748,149.600	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	255.500	1,584,100.000	

スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 222,364,525.950 (2,975,237,357)	
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	70,105	779.200	54,625,816.000	
	DANSKE BANK A/S	27,900	113.750	3,173,625.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	131	21,200.000	2,777,200.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	42,042	174.500	7,336,329.000	
	GN STORE NORD A/S	5,465	265.700	1,452,050.500	
	CARLSBERG AS-B	4,180	862.200	3,603,996.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,300	437.700	3,632,910.000	
	COLOPLAST-B	4,850	810.000	3,928,500.000	
	DSV PANALPINA A/S	8,280	1,115.500	9,236,340.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,936.500	716,505.000	
	DEMANT A/S	4,275	305.700	1,306,867.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	21,320.000	4,903,600.000	
	TRYG A/S	14,990	161.000	2,413,390.000	
	PANDORA A/S	4,000	555.000	2,220,000.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,300	509.000	2,188,700.000	
	GENMAB A/S	2,737	2,101.000	5,750,437.000	
	ORSTED A/S	7,875	763.000	6,008,625.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 115,274,891.000 (2,172,931,695)	
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	52,500	4.785	251,212.500	
	MERCURY NZ LTD	30,000	5.740	172,200.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	72,789	4.805	349,751.140	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,113	7.740	403,354.620	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,200	20.790	503,118.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 1,679,636.260 (142,953,843)	
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	38,050	190.400	7,244,720.000	
	NORSK HYDRO ASA	54,200	73.580	3,988,036.000	

	ORKLA ASA	30,350	72.400	2,197,340.000	
	TELENOR ASA	29,131	128.050	3,730,224.550	
	EQUINOR ASA	40,687	347.950	14,157,041.650	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	499.400	3,326,004.000	
	MOWI ASA	17,800	235.500	4,191,900.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,050	201.200	1,619,660.000	
	AKER BP ASA	4,900	408.100	1,999,690.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,723	338.200	1,259,118.600	
	SALMAR ASA	2,452	698.000	1,711,496.000	
	ADEVINTA ASA	12,000	71.500	858,000.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 46,283,230.800 (641,022,746)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	27,891	21.295	593,938.840	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,902	29.580	529,541.160	
	DERECHOS TELEFONICA RIGHTS SA	204,487	0.150	30,693.490	
	BAYER AG-REG	38,659	66.120	2,556,133.080	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	25.650	205,200.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,328	10.200	829,545.600	
	COMMERZBANK AG	42,031	8.156	342,804.830	
	VOLKSWAGEN AG	1,200	210.100	252,120.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	7,300	156.680	1,143,764.000	
	SIEMENS AG-REG	29,700	124.020	3,683,394.000	
	E.ON SE	88,344	9.668	854,109.790	
	UNIPER SE	6,650	23.200	154,280.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,027	82.930	1,080,329.110	
	GEA GROUP AG	5,800	37.700	218,660.000	
	CONTINENTAL AG	4,342	71.480	310,366.160	
	BASF SE	36,141	52.020	1,880,054.820	
	ALLIANZ SE-REG	15,900	195.180	3,103,362.000	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,800	62.580	425,544.000	
	RHEINMETALL AG	1,813	208.500	378,010.500	
	RWE AG	25,279	40.520	1,024,305.080	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	6.574	144,299.300	
	BRENNTAG SE	6,090	72.500	441,525.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	16,483	31.200	514,269.600	

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	30.720	117,934.080	
SAP SE	40,592	93.610	3,799,817.120	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,514	225.800	1,245,061.200	
ZALANDO SE	8,783	35.220	309,337.260	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,708	53.600	305,948.800	
KION GROUP AG	2,700	45.130	121,851.000	
COVESTRO AG	7,300	43.800	319,740.000	
RATIONAL AG	190	612.500	116,375.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	370.500	448,305.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,035	77.800	469,523.000	
DELIVERY HERO SE	6,443	36.610	235,878.230	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	126.950	202,104.400	
BECHTLE AG	3,238	41.960	135,866.480	
NEMETSCHEK SE	2,284	67.060	153,165.040	
SCOUT24 AG	3,600	58.120	209,232.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	4.280	162,640.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,097	55.400	614,773.800	
KNORR-BREMSE AG	2,800	66.180	185,304.000	
HELLOFRESH SE	6,516	34.230	223,042.680	
SIEMENS ENERGY AG	17,290	18.285	316,147.650	
BEIERSDORF AG	3,980	95.920	381,761.600	
MERCK KGAA	5,086	173.100	880,386.600	
ADIDAS AG	7,200	187.140	1,347,408.000	
PUMA SE	4,163	70.380	292,991.940	
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	61.200	250,981.200	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	127,596	19.154	2,443,973.780	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,070	53.300	430,131.000	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	32,500	67.350	2,188,875.000	
QIAGEN N.V.	9,105	42.430	386,325.150	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,388	29.000	1,490,252.000	
HANNOVER RUECK SE	2,378	143.300	340,767.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,003	37.760	1,472,753.280	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,478	155.550	1,163,202.900	
MTU AERO ENGINES AG	2,104	184.200	387,556.800	
SYMRISE AG	5,228	103.350	540,313.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	3.000	123,936.000	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,200	74.950	164,890.000	
VONOVIA SE	28,000	35.400	991,200.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,800	92.820	259,896.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,900	23.095	806,015.500	
NN GROUP NV	11,292	45.450	513,221.400	
ARCELORMITTAL	25,700	30.350	779,995.000	
HEINEKEN NV	10,196	92.240	940,479.040	
AEGON NV	67,994	4.865	330,790.810	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,149	25.620	1,054,237.380	
AKZO NOBEL N.V.	7,100	80.660	572,686.000	
KONINKLIJKE DSM NV	6,880	156.650	1,077,752.000	
WOLTERS KLUWER	10,328	89.180	921,051.040	
ING GROEP NV	153,619	10.354	1,590,571.120	
KONINKLIJKE KPN NV	127,800	3.382	432,219.600	
ASML HOLDING NV	15,979	525.500	8,396,964.500	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	10.635	177,604.500	
IMCD NV	2,246	144.400	324,322.400	
ADYEN NV	857	1,444.000	1,237,508.000	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	19.458	140,486.760	
PROSUS NV	35,480	46.235	1,640,417.800	
JDE PEET'S NV	3,700	26.860	99,382.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,800	287.500	517,500.000	
RANDSTAD NV	4,720	52.360	247,139.200	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	73.000	310,250.000	
OCI NV	4,386	34.500	151,317.000	
TOTALENERGIES SE	97,492	54.480	5,311,364.160	
MICHELIN (CGDE)	6,685	121.950	815,235.750	
AIR LIQUIDE SA	18,706	161.800	3,026,630.800	
KERING	2,942	521.000	1,532,782.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,274	129.980	2,765,194.520	
BOUYGUES SA	9,062	31.980	289,802.760	
BNP PARIBAS	43,684	52.560	2,296,031.040	
THALES SA	4,100	114.250	468,425.000	
DANONE	25,708	55.900	1,437,077.200	
CARREFOUR SA	24,454	19.700	481,743.800	
VIVENDI	29,591	11.350	335,857.850	
L'OREAL	9,500	327.900	3,115,050.000	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	19,572	56.790	1,111,493.880	
LEGRAND SA	10,524	79.900	840,867.600	
PERNOD RICARD SA	8,241	182.350	1,502,746.350	
EURAZEO SE	1,724	72.550	125,076.200	
SOCIETE GENERALE SA	30,800	24.980	769,384.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	10,921	609.100	6,651,981.100	
ACCOR SA	6,717	30.110	202,248.870	
CAPGEMINI SE	6,452	179.950	1,161,037.400	
VALEO SA	8,400	19.890	167,076.000	
PUBLICIS GROUPE	8,700	51.060	444,222.000	
BUREAU VERITAS SA	11,605	26.590	308,576.950	
EIFFAGE	3,285	91.980	302,154.300	
SODEXO SA	3,491	69.200	241,577.200	
IPSEN	1,400	94.200	131,880.000	
AMUNDI SA	2,250	53.350	120,037.500	
TELEPERFORMANCE	2,315	306.200	708,853.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	46.960	169,056.000	
EURONEXT NV	3,300	78.100	257,730.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,296	85.180	451,113.280	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,100	319.700	351,670.000	
SEB SA	997	99.900	99,600.300	
ESSILORLUXOTTICA	11,317	152.400	1,724,710.800	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	163.500	163,500.000	
WORLDLINE SA	9,114	38.430	350,251.020	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	34.070	141,833.410	
AXA SA	76,206	23.505	1,791,222.030	
EDENRED	9,500	45.380	431,110.000	
RENAULT SA	7,050	25.770	181,678.500	
HERMES INTERNATIONAL	1,246	1,119.000	1,394,274.000	
STMICROELECTRONICS NV	26,892	36.895	992,180.340	
REMY COINTREAU	900	179.400	161,460.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	26,247	38.820	1,018,908.540	
WENDEL	930	94.850	88,210.500	
ORANGE	78,504	11.556	907,192.220	
ALSTOM	12,525	26.570	332,789.250	
SANOFI	44,747	100.060	4,477,384.820	
VINCI SA	20,983	90.140	1,891,407.620	
AIRBUS SE	23,199	108.680	2,521,267.320	

VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,179	26.560	695,314.240	
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	10.010	491,771.280	
BIOMERIEUX	1,520	94.700	143,944.000	
ENGIE	71,869	12.474	896,493.900	
EDF	22,120	8.374	185,232.880	
SAFRAN SA	13,449	96.190	1,293,659.310	
ARKEMA	2,220	116.350	258,297.000	
ADP	1,110	137.050	152,125.500	
GETLINK SE	17,345	17.775	308,307.370	
BOLLORE	32,400	4.938	159,991.200	
UCB SA	4,976	81.200	404,051.200	
KBC GROUP NV	9,843	57.720	568,137.960	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	86.100	361,620.000	
SOLVAY SA	2,800	93.320	261,296.000	
UMICORE	8,269	40.930	338,450.170	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,179	51.870	1,772,864.730	
AGEAS	6,290	43.160	271,476.400	
D'IETEREN GROUP	1,036	158.100	163,791.600	
PROXIMUS	6,035	15.780	95,232.300	
ELIA GROUP SA/NV	1,200	151.900	182,280.000	
SOFINA	600	216.000	129,600.000	
ARGENX SE	1,912	295.100	564,231.200	
PRYSMIAN SPA	10,040	29.170	292,866.800	
ASSICURAZIONI GENERALI	43,547	16.715	727,888.100	
MEDIOBANCA SPA	22,365	9.500	212,467.500	
TENARIS SA	18,608	15.730	292,703.840	
UNICREDIT SPA	83,217	10.596	881,767.330	
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.287	108,748.310	
INTESA SANPAOLO	649,877	1.973	1,282,207.320	
ATLANTIA SPA	19,531	22.580	441,009.980	
POSTE ITALIANE SPA	19,200	9.920	190,464.000	
MONCLER SPA	7,800	45.890	357,942.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,850	39.540	152,229.000	
ENI SPA	99,314	14.258	1,416,019.010	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	9.896	192,972.000	
DIASORIN SPA	1,000	120.400	120,400.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	10.390	132,992.000	
NEXI SPA	19,900	9.190	182,881.000	

AMPLIFON SPA	4,700	31.070	146,029.000	
ENEL SPA	320,036	5.905	1,889,812.580	
SNAM SPA	79,350	5.372	426,268.200	
TERNA SPA	55,464	7.770	430,955.280	
EXOR NV	4,273	67.120	286,803.760	
CNH INDUSTRIAL NV	40,265	14.070	566,528.550	
FINECOBANK SPA	23,200	12.630	293,016.000	
STELLANTIS NV	86,643	13.792	1,194,980.250	
FERRARI NV	4,960	177.700	881,392.000	
TELEFONICA SA	204,487	4.664	953,727.360	
ENDESA SA	12,100	20.430	247,203.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	262,374	4.957	1,300,719.100	
IBERDROLA SA	227,905	10.810	2,463,653.050	
REPSOL SA	57,201	15.160	867,167.160	
GRIFOLS SA	11,830	18.675	220,925.250	
BANCO SANTANDER SA	682,335	2.963	2,022,099.770	
AMADEUS IT GROUP SA	17,728	56.560	1,002,695.680	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	28.120	289,636.000	
CAIXABANK SA	174,927	3.380	591,253.260	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.530	235,480.280	
AENA SME SA	2,900	140.650	407,885.000	
CELLNEX TELECOM SA	21,460	41.080	881,576.800	
ACCIONA SA	1,028	188.500	193,778.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	42,920	22.070	947,244.400	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	18.025	169,687.350	
ENAGAS SA	9,884	21.580	213,296.720	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	19.075	299,477.500	
FERROVIAL SA	19,018	24.500	465,941.000	
UPM-KYMMENE OYJ	21,001	33.110	695,343.110	
NOKIA OYJ	212,980	4.688	998,556.730	
WARTSILA OYJ ABP	17,000	7.974	135,558.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	17.460	373,644.000	
ELISA OYJ	5,400	53.420	288,468.000	
SAMPO OYJ-A SHS	19,622	41.680	817,844.960	
FORTUM OYJ	16,900	17.075	288,567.500	
KESKO OYJ-B SHS	10,400	23.300	242,320.000	

	KONE OYJ-B	13,375	47.750	638,656.250	
	NESTE OYJ	16,646	44.190	735,586.740	
	ORION OYJ-CLASS B	4,000	37.530	150,120.000	
	VERBUND AG	2,600	96.600	251,160.000	
	OMV AG	5,650	54.500	307,925.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	13,546	30.070	407,328.220	
	VOESTALPINE AG	4,250	28.100	119,425.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,400	37.680	354,192.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,076	75.880	461,046.880	
	JERONIMO MARTINS	10,500	18.940	198,870.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	109,400	4.665	510,351.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	18,750	12.150	227,812.500	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,000	22.800	250,800.000	
	KERRY GROUP PLC-A	6,272	94.380	591,951.360	
	CRH PLC	30,126	38.535	1,160,905.410	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,569	106.750	701,240.750	
ユーロ　小計				ユーロ 172,231,399.920 (24,150,286,897)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	58,000	52.500	3,045,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	88,000	41.300	3,634,400.000	
	MTR CORP	62,000	42.200	2,616,400.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,500	96.100	5,814,050.000	
	SINO LAND CO	142,000	11.140	1,581,880.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,669	55.550	6,203,212.950	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	48.450	896,325.000	
	CLP HOLDINGS LTD	67,000	77.700	5,205,900.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	59,507	32.450	1,931,002.150	
	HONG KONG & CHINA GAS	453,475	8.850	4,013,253.750	
	HANG SENG BANK LTD	31,000	139.200	4,315,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	29.100	1,847,850.000	
	WH GROUP LTD	361,000	6.130	2,212,930.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	50,100	342.000	17,134,200.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	13.820	1,077,960.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	69,000	20.350	1,404,150.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	19.900	895,500.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	52.650	4,800,047.850	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	52.500	1,391,250.000	
	AIA GROUP LTD	503,600	80.000	40,288,000.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	29.800	1,609,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	67,000	37.050	2,482,350.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	21.700	1,473,430.000	
	ESR CAYMAN LTD	80,000	22.900	1,832,000.000	
	SANDS CHINA LTD	92,800	14.720	1,366,016.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	13.360	1,095,520.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	57,500	99.600	5,727,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	154,000	30.200	4,650,800.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 130,544,827.700 (2,177,487,726)	
合計				258,776,639,198 [258,776,639,198]	

(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	5,737	1,176,199.740	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,307	1,463,104.650	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,000	638,520.000	
		VORNADO REALTY TRUST	6,297	208,682.580	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,400	1,450,064.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	14,500	1,103,015.000	
		EQUINIX INC	3,708	2,515,655.520	
		AMERICAN TOWER CORP	18,500	4,934,505.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	29,043	597,124.080	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,000	486,590.000	
		KIMCO REALTY CORP	25,000	573,750.000	
		INVITATION HOMES INC	24,700	945,763.000	
		VICI PROPERTIES INC	39,000	1,224,210.000	
		VENTAS INC	16,200	909,954.000	
		WEYERHAEUSER CO	30,314	1,162,238.760	
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,500	3,203,200.000	

	IRON MOUNTAIN INC	11,800	632,126.000	
	SUN COMMUNITIES INC	4,700	779,119.000	
	PROLOGIS INC	30,002	3,827,655.160	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,200	1,012,894.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,000	574,240.000	
	DUKE REALTY CORP	15,500	825,685.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,600	738,244.000	
	WELLTOWER INC	18,100	1,592,800.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,900	628,311.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,700	841,911.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,200	533,592.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	63,400	419,708.000	
	REALTY INCOME CORP	23,995	1,616,303.200	
	PUBLIC STORAGE	6,400	2,116,608.000	
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	420,084.000	
	UDR INC	12,900	616,620.000	
	WP CAREY INC	7,700	638,946.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,500	1,546,635.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,400	962,820.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,200	419,386.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 43,336,263.690 (5,670,116,741)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	217,021.480	
	SEGRO PLC	48,274	523,290.160	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	184,478.740	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 924,790.380 (151,018,270)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	40,978	429,039.660	
	LENDLEASE GROUP	25,300	267,674.000	
	TRANSURBAN GROUP	116,720	1,715,784.000	
	APA GROUP	45,041	510,314.530	
	SCENTRE GROUP	190,722	537,836.040	
	GPT GROUP	73,031	346,897.250	
	MIRVAC GROUP	144,900	320,229.000	

		STOCKLAND	91,123	359,024.620	
		GOODMAN GROUP	63,909	1,293,518.160	
		VICINITY CENTRES	137,273	258,073.240	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 6,038,390.500 (569,178,689)	
	カナダ・ドル			カナダ・ドル	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	166,634.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	130,790.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 297,424.000 (30,917,225)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134,500	375,255.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220,070	486,354.700	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	125,300	207,998.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	87,500	156,625.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 1,226,232.700 (116,639,255)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	292,100.000	
		GECINA SA	1,817	193,510.500	
		KLEPIERRE	8,527	179,322.810	
		COVIVIO	2,000	133,600.000	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	213,624.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 1,012,157.310 (141,924,698)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	87,900	6,267,270.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	818,550.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	152,000	1,644,640.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 8,730,460.000 (145,624,073)	
投資証券　合計				6,825,418,951 [6,825,418,951]	
合計				6,825,418,951 [6,825,418,951]	

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 604銘柄 投資証券 36銘柄	97.1%	2.9%	73.6%
イギリス・ポンド	株式 78銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	4.6%
イスラエル・シュケル	株式 9銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 50銘柄 投資証券 10銘柄	90.7%	9.3%	2.3%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.9%
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資証券 4銘柄	88.0%	12.0%	0.4%
スイス・フラン	株式 41銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式 48銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 5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 224銘柄 投資証券 5銘柄	99.4%	0.6%	9.1%
香港・ドル	株式 28銘柄 投資証券 3銘柄	93.7%	6.3%	0.9%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ネオ・ジャパン債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,235,197,551	5,559,091,492
国債証券	43,055,529,228	48,440,413,356
地方債証券	159,846,516	125,764,066
特殊債券	2,804,004,899	2,369,607,463
社債券	55,503,884,100	63,039,640,000
未収入金	919,170,000	2,915,550
未収利息	295,710,207	334,068,938
前払費用	9,434,063	2,411,556
差入委託証拠金	905,000	195,600
流動資産合計	108,983,681,564	119,874,108,021
資産合計	108,983,681,564	119,874,108,021
負債の部		
流動負債		
プット・オプション（売）	100,000	3,000,000
未払金	400,000,000	1,000,000,000
流動負債合計	400,100,000	1,003,000,000
負債合計	400,100,000	1,003,000,000
純資産の部		
元本等		
元本　※1	97,528,490,449	108,031,335,737
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,055,091,115	10,839,772,284
元本等合計	108,583,581,564	118,871,108,021
純資産合計	108,583,581,564	118,871,108,021
負債純資産合計	108,983,681,564	119,874,108,021

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年6月8日 至　2022年6月6日

1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物オプション取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1．※1　期首	2020年6月6日	2021年6月8日
期首元本額	90,372,360,221円	97,528,490,449円
期中追加設定元本額	11,531,334,407円	10,876,092,873円
期中一部解約元本額	4,375,204,179円	373,247,585円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ネオ・ジャパン債券ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	97,104,722,674円	107,233,045,428円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	422,867,403円	797,393,945円
ジャパン・アクティブ・ボンド・オープン	900,372円	896,364円
計	97,528,490,449円	108,031,335,737円
2．期末日における受益権の総数	97,528,490,449口	108,031,335,737口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2021年6月8日 至　2022年6月6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、金利変動等）、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）における債券先物オプション取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年6月6日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△659,670,948	△2,195,050,069
地方債証券	△577,881	△857,240
特殊債券	△7,777,418	△29,201,435
社債券	803,076,400	△818,813,700
合計	135,050,153	△3,043,922,444

（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6月16日から2021年6月7日まで、及び2021年6月16日から2022年6月6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

債券関連

種　類	2021年6月7日 現在				2022年6月6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								
債券先物								
オプション取引								
売　建								
プット	100,000	－	100,000	0	3,000,000	－	3,000,000	0
合計	100,000	－	100,000	0	3,000,000	－	3,000,000	0

（注）　1．時価の算定方法

債券先物オプション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．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1134円 (11,134円)	1.1003円 (11,003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	６　４０年国債	412,000,000	505,824,760	
	７　４０年国債	412,000,000	485,064,080	
	１０　４０年国債	200,000,000	191,138,000	
	１２　４０年国債	900,000,000	747,810,000	
	１３　４０年国債	200,000,000	165,322,000	
	１４　４０年国債	1,000,000,000	882,850,000	
	３６６　１０年国債	800,000,000	796,936,000	
	２９　３０年国債	321,000,000	410,382,450	
	３１　３０年国債	428,000,000	535,676,240	
	３３　３０年国債	512,000,000	625,484,800	
	３４　３０年国債	513,000,000	645,025,680	
	３６　３０年国債	435,000,000	534,193,050	
	３７　３０年国債	500,000,000	604,975,000	
	３８　３０年国債	526,000,000	626,997,260	
	４１　３０年国債	216,000,000	253,342,080	
	４２　３０年国債	310,000,000	363,778,800	
	４５　３０年国債	514,000,000	582,140,980	
	４６　３０年国債	413,000,000	467,809,230	
	４７　３０年国債	312,000,000	359,848,320	
	４８　３０年国債	215,000,000	238,914,450	
	５０　３０年国債	315,000,000	309,131,550	
	５１　３０年国債	513,000,000	447,310,350	
	５４　３０年国債	506,000,000	492,747,860	
	５６　３０年国債	500,000,000	484,705,000	
	５８　３０年国債	500,000,000	482,465,000	
	５９　３０年国債	600,000,000	563,976,000	
	６１　３０年国債	800,000,000	747,312,000	
	６２　３０年国債	600,000,000	531,012,000	

	６３　３０年国債	1,700,000,000	1,461,150,000	
	６４　３０年国債	500,000,000	428,790,000	
	６７　３０年国債	1,700,000,000	1,532,635,000	
	６８　３０年国債	400,000,000	359,956,000	
	１３０　２０年国債	530,000,000	606,765,200	
	１３７　２０年国債	632,000,000	722,066,320	
	１４０　２０年国債	1,300,000,000	1,488,305,000	
	１４１　２０年国債	738,000,000	845,688,960	
	１４４　２０年国債	1,800,000,000	2,027,736,000	
	１４６　２０年国債	400,000,000	460,384,000	
	１４８　２０年国債	780,000,000	882,008,400	
	１４９　２０年国債	200,000,000	226,300,000	
	１５０　２０年国債	1,268,000,000	1,420,667,200	
	１５１　２０年国債	434,000,000	476,015,540	
	１５２　２０年国債	1,535,000,000	1,683,311,700	
	１５３　２０年国債	527,000,000	584,674,880	
	１５４　２０年国債	524,000,000	574,712,720	
	１５６　２０年国債	1,900,000,000	1,881,551,000	
	１５７　２０年国債	337,000,000	323,951,360	
	１５８　２０年国債	534,000,000	534,352,440	
	１５９　２０年国債	100,000,000	101,286,000	
	１６０　２０年国債	1,231,000,000	1,262,279,710	
	１６１　２０年国債	600,000,000	605,844,000	
	１６３　２０年国債	1,300,000,000	1,307,423,000	
	１６４　２０年国債	1,200,000,000	1,186,968,000	
	１６５　２０年国債	400,000,000	394,724,000	
	１６７　２０年国債	800,000,000	785,600,000	
	１６８　２０年国債	1,800,000,000	1,734,516,000	
	１７３　２０年国債	900,000,000	855,387,000	
	１７５　２０年国債	600,000,000	577,464,000	
	１７６　２０年国債	1,000,000,000	959,620,000	
	１７７　２０年国債	1,100,000,000	1,034,143,000	
	２４　物価連動国債	1,000,000,000	1,083,642,300	
	２６　物価連動国債	1,300,000,000	1,417,545,246	
	２７　物価連動国債	1,000,000,000	1,087,141,440	
	２８　メキシコ国債	500,000,000	443,271,000	
	２５　インドネシア共和国	1,000,000,000	1,000,364,000	
国債証券　合計			48,440,413,356	
地方債証券	２６－１７　愛知県公債	44,200,000	44,671,746	

	２７－１５　愛知県公債	80,000,000	81,092,320	
地方債証券　合計			125,764,066	
特殊債券	３７　政保政策投資Ｃ	22,000,000	22,055,044	
	２２２　政保道路機構	51,000,000	51,677,280	
	６９　地方公共団体	50,000,000	50,559,150	
	９０政保地方公共団	45,000,000	44,953,290	
	９２政保地方公共団	37,000,000	37,139,490	
	Ｓ４　住宅機構ＲＭＢＳ	11,619,000	11,857,189	
	Ｓ６　住宅機構ＲＭＢＳ	11,501,000	11,716,068	
	Ｓ７　住宅機構ＲＭＢＳ	60,455,000	61,627,827	
	Ｓ８　住宅機構ＲＭＢＳ	11,929,000	12,168,772	
	２８　住宅金融ＲＭＢＳ	33,084,000	33,471,082	
	２９　住宅金融ＲＭＢＳ	9,976,000	10,023,884	
	３７　住宅金融ＲＭＢＳ	88,776,000	90,409,478	
	４０　住宅金融ＲＭＢＳ	24,340,000	24,970,406	
	５　住宅機構ＲＭＢＳ	10,168,000	10,230,024	
	８　住宅機構ＲＭＢＳ	11,079,000	11,227,458	
	９　住宅機構ＲＭＢＳ	11,850,000	12,102,405	
	１２　住宅機構ＲＭＢＳ	12,173,000	12,420,111	
	２４　住宅機構ＲＭＢＳ	32,138,000	33,857,383	
	３１　住宅機構ＲＭＢＳ	22,275,000	23,636,002	
	３９　住宅機構ＲＭＢＳ	22,739,000	23,771,350	
	５０　住宅機構ＲＭＢＳ	169,856,000	177,635,404	
	５１　住宅機構ＲＭＢＳ	200,799,000	210,256,632	
	６０　住宅機構ＲＭＢＳ	64,376,000	67,047,604	
	７１　住宅機構ＲＭＢＳ	268,584,000	276,748,953	
	８２　住宅機構ＲＭＢＳ	160,140,000	164,720,004	
	９５　住宅機構ＲＭＢＳ	60,922,000	62,024,688	
	９８　住宅機構ＲＭＢＳ	178,620,000	182,799,708	
	１１１　住宅機構ＲＭＢＳ	73,345,000	71,716,741	
	１１２　住宅機構ＲＭＢＳ	75,095,000	74,126,274	
	１７９　住宅機構ＲＭＢＳ	498,995,000	492,657,762	
特殊債券　合計			2,369,607,463	
社債券	７　ＢＰＣＥ　Ｓ．Ａ．劣後	100,000,000	101,226,700	
	９　ＢＰＣＥ　ＳＡ　劣後ＦＲ	1,000,000,000	980,762,000	
	２　ソシエテ　ジエネラル	200,000,000	192,630,200	
	1.488% Aflac Inc 20331018	1,000,000,000	1,027,240,000	
	1.039% Aflac Inc 20360415	300,000,000	285,333,000	
	２　プレミアムウオーターＨＤ	200,000,000	201,238,000	

2　野村不動産劣ＦＲ	100,000,000	101,789,700	
1　オープンハウス	300,000,000	299,804,400	
2　東急不動産劣ＦＲ	500,000,000	498,872,000	
1　大日本住友劣ＦＲ	800,000,000	810,976,800	
2　大日本住友劣ＦＲ	500,000,000	507,230,000	
１９　ＺＨＤ	400,000,000	397,889,200	
１６　楽天グループ	1,500,000,000	1,483,330,500	
２０　楽天グループ	900,000,000	849,921,300	
1　楽天　劣後ＦＲ	100,000,000	101,742,000	
4　楽天　劣後ＦＲ	1,500,000,000	1,505,590,500	
5　楽天　劣後ＦＲ	200,000,000	202,581,600	
6　楽天　劣後ＦＲ	900,000,000	923,258,700	
1　ＥＮＥＯＳ　ＨＤ　劣ＦＲ	900,000,000	897,620,400	
4　DMG森精機劣ＦＲ	1,100,000,000	1,085,473,400	
1　ツバキ・ナカシマ劣ＦＲ	700,000,000	660,566,900	
1　ＮＴＮ　劣後ＦＲ	1,200,000,000	1,234,761,600	
2　かんぽ生命劣ＦＲ	1,000,000,000	995,659,000	
1　日本生命２劣ローン	2,400,000,000	2,402,678,400	
1　ニプロ　劣後　ＦＲ	400,000,000	404,574,800	
7　イオン　劣後ＦＲ	2,600,000,000	2,650,806,600	
8　イオン　劣後ＦＲ	300,000,000	291,028,800	
9　イオン　劣後ＦＲ	800,000,000	779,240,800	
5　三井住友トラ劣ＦＲ	100,000,000	101,756,300	
6　三井住友トラ劣ＦＲ	600,000,000	614,267,400	
7　みずほＦＧ劣後ＦＲ	1,000,000,000	1,014,950,000	
8　みずほＦＧ劣後ＦＲ	500,000,000	501,148,500	
１０みずほＦＧ劣後ＦＲ	1,000,000,000	1,010,096,000	
５５　日産フイナンシヤル	2,000,000,000	1,954,944,000	
2　東京センチユリー劣ＦＲ	3,500,000,000	3,546,203,500	
1　東京センチユリー劣ＦＲ	700,000,000	702,172,800	
3　オリツクス　劣後ＦＲ	1,500,000,000	1,499,121,000	
1　三菱ＨＣ　劣後ＦＲ	800,000,000	791,455,200	
2　野村ＨＤ劣後ＦＲ	400,000,000	408,402,400	
3　野村ＨＤ劣後ＦＲ	5,000,000,000	5,025,745,000	
1　第一生命劣後ＦＲ	1,000,000,000	1,007,772,000	
2　第一生命劣後ＦＲ	1,000,000,000	992,504,000	
3　第一生命劣後ＦＲ	500,000,000	499,401,000	
2　東京建物劣ＦＲ	800,000,000	849,374,400	
3　東京建物劣ＦＲ	500,000,000	492,907,000	

	1　商船三井劣後ＦＲ	1,000,000,000	1,021,588,000	
	1　日本航空劣後ＦＲ	3,500,000,000	3,490,259,500	
	３７　光通信	600,000,000	580,278,000	
	３９　光通信	300,000,000	299,680,200	
	3　関西電力劣後ＦＲ	2,100,000,000	2,110,296,300	
	7　ＪＥＲＡ	800,000,000	796,117,600	
	4　ソフトバンクＧ劣後ＦＲ	5,000,000,000	4,982,555,000	
	３Ａ明治安田劣後ＦＲ	1,600,000,000	1,608,633,600	
	1　アフラツク生命	1,600,000,000	1,603,201,600	
	４Ａ明治安田劣後ＦＲ	1,000,000,000	981,191,000	
	５Ａ富国生命劣後ＦＲ	1,100,000,000	1,092,113,000	
	1　大樹生命劣後ＦＲ	800,000,000	792,690,400	
	1　朝日生命劣後ＦＲ	800,000,000	794,988,000	
社債券　合計			63,039,640,000	
合計			113,975,424,885	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	395,844,187	5,696,408,831
コール・ローン	861,235,429	1,304,305,964
国債証券	222,038,899,679	234,504,938,294
派生商品評価勘定	－	21,748,461
未収入金	160,203	15,749,407
未収利息	1,204,487,740	1,315,513,379
前払費用	29,102,452	43,054,119
流動資産合計	224,529,729,690	242,901,718,455

資産合計	224,529,729,690	242,901,718,455
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,740,056	－
未払金	63,767	4,935,132,601
未払解約金	167,320,850	145,405,730
流動負債合計	170,124,673	5,080,538,331
負債合計	170,124,673	5,080,538,331
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	72,171,959,824	75,518,465,344
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	152,187,645,193	162,302,714,780
元本等合計	224,359,605,017	237,821,180,124
純資産合計	224,359,605,017	237,821,180,124
負債純資産合計	224,529,729,690	242,901,718,455

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年6月8日 至　2022年6月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1．※1　期首	2020年6月6日	2021年6月8日
期首元本額	65,630,254,690円	72,171,959,824円
期中追加設定元本額	14,128,279,151円	9,393,523,151円
期中一部解約元本額	7,586,574,017円	6,047,017,631円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	523,830,915円	468,789,568円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	10,805,026円	9,719,452円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	93,234,451円	60,069,032円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	26,042,029円	21,864,771円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	319,990,353円	273,677,757円

外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	147,412,708円	262,828,185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）	494,252,758円	582,097,301円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,104,774,269円	2,435,159,714円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	801,683,813円	637,283,512円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	946,948円	946,025円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	3,569,968円	11,046,385円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,262,673,100円	1,957,942,756円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,231,075,720円	1,635,638,497円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	151,520,118円	281,749,418円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	49,249,685,981円	49,873,381,777円
ダイワ・ライフ・バランス３０	888,433,073円	1,015,192,007円
ダイワ・ライフ・バランス５０	528,928,478円	638,155,597円
ダイワ・ライフ・バランス７０	333,789,552円	416,524,630円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	532,794,484円	613,659,406円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	398,386,255円	475,082,867円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	142,012,313円	179,008,193円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	24,115,938円	31,677,555円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	7,428,392円	12,390,426円

	ダイワつみたてインデックス外国債券	307,504,770円	1,091,284,840円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,543,248円	3,766,018円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,159,154円	1,373,889円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	1,225,356円	2,265,840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	8,553,439円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	171,725,827円	126,818,187円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	138,299,284円	101,559,044円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,148,853,363円	3,578,350,089円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	245,616,231円	218,536,659円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,966,306円	147,279,804円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	36,510,395円	46,689,867円
	ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	1,781,831,534円	2,584,864,644円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,798,708,777円	5,608,313,372円
	ダイワライフスタイル２５	33,300,268円	29,864,070円
	ダイワライフスタイル５０	63,771,059円	59,547,724円
	ダイワライフスタイル７５	17,557,610円	15,513,027円
計		72,171,959,824円	75,518,465,344円
2.	期末日における受益権の総数	72,171,959,824口	75,518,465,344口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2021年6月8日 至　2022年6月6日

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年6月6日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2021年6月7日現在	2022年6月6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	△9,726,709,346	△30,035,105,080
合計	△9,726,709,346	△30,035,105,080

（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2021年6月7日まで、及び2021年12月1日から2022年6月6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	2021年6月7日 現在				2022年6月6日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	778,958,665	－	776,218,609	△2,740,056	1,117,565,949	－	1,139,314,410	21,748,461
アメリカ・ドル	293,596,666	－	292,813,785	△782,881	584,094,960	－	595,870,248	11,775,288
オーストラリア・ドル	20,163,888	－	20,090,490	△73,398	－	－	－	－
オフショア・人民元	－	－	－	－	171,335,360	－	175,005,048	3,669,688
スウェーデン・クローナ	22,289,608	－	22,243,200	△46,408	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	6,502,158	－	6,472,730	△29,428	－	－	－	－
ユーロ	436,406,345	－	434,598,404	△1,807,941	362,135,629	－	368,439,114	6,303,485
合計	778,958,665	－	776,218,609	△2,740,056	1,117,565,949	－	1,139,314,410	21,748,461

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年6月7日現在	2022年6月6日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1087円 (31,087円)	3.1492円 (31,492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	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,578,323.680	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,039,025.390	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,246,517.150	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,901,242.720	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	684,803.400	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	946,775.700	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	819,334.580	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	835,261.020	

		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	879,776.520	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,830,346.250	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,392,172.320	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,052,261.980	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	640,601.040	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	614,444.100	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,101,775.190	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,287,569.390	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,254,107.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,407,375.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,210,737.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,948,829.200	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,186,026.100	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,670,811.220	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,518,907.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,573,476.450	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,608,126.190	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,406,717.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,572,654.540	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,283,334.030	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,025,324.110	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,476,926.700	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,526,080.700	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,121,605.520	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,337,771.140	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,202,759.310	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,432,533.720	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,322,575.090	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,112,888.860	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,849,120.110	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,843,257.270	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,577,587.820	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,616,883.720	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,200,771.210	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,663,615.880	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	2,662,008.300	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,580,530.530	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,721,680.330	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,710,877.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	620,072.870	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,640,947.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,703,345.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,353,988.920	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,422,246.920	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,484,750.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,971,050.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,089,068.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,267,646.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,746,417.600	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,372,040.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,472,109.350	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,083,442.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,472,450.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	922,100.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,478,521.100	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,490,425.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,524,539.200	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,468,567.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	2,214,735.250	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,283,463.000	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,513,190.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,222,464.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,890,000.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,966,130.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,234,969.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,368,104.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,691,612.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,965,050.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,950,000.000	2,665,826.500	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,962,340.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,465,225.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,297,160.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,261,700.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,457,335.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,149,472.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,760,828.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,270,625.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,577,250.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,692,170.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,854,200.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,882,078.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,710,320.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,453,265.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,899,544.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,548,047.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,512,100.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,508,675.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,986,860.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	3,868,018.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,647,606.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	4,030,100.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,497,650.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,616,848.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,581,424.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,507,025.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,018,750.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,508,200.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,024,680.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,724,568.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	4,635,079.200	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,996,460.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,011,480.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,463,880.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,506,825.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,451,500.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,996,840.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,472,050.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	4,515,995.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,460,925.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,290,430.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,438,650.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	4,371,000.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,750,396.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,476,620.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,741,592.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,905,770.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,435,985.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,686,012.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,393,190.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,394,725.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,296,599.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,804,660.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,623,012.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,873,400.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,364,450.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,916,300.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	970,700.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,833,350.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	5,388,844.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,828,510.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,888,420.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,906,460.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,371,475.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,433,375.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,636,641.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,504,850.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,087,640.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	4,214,106.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	275,718.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,966,364.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,404,135.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,432,864.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,686,500.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,512,458.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,131,296.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,585,736.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,516,000.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,100,755.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,774,760.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,388,680.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,998,265.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,094,210.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	976,170.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,129,564.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,364,645.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	8,314,800.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,385,500.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	4,437,142.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	4,195,740.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,081,085.000	

		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,943,580.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	5,955,625.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,494,040.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,213,700.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,074,000.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,464,149.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,293,936.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,655,600.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,505,920.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,815,760.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,718,206.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,668,846.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,403,500.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,894,520.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,392,950.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	913,820.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,850,440.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,187,300.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	4,454,913.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,215,375.000	

		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,801,750.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,558,200.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,509,150.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,736,829.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,741,700.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,919,680.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,627,800.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,683,120.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,878,590.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,795,635.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,870,500.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,137,165.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,434,680.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	5,449,984.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,206,820.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	979,410.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,619,360.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,036,296.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,904,840.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,465,890.000	

		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,514,800.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,602,300.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,241,500.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,852,550.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,894,153.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	5,372,271.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,851,294.000	
		0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,437,775.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,456,700.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,440,600.000	
		0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,919,840.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,467,150.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,560,150.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,109,700.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	7,000,000.000	6,293,420.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,204,110.000	
		0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,458,390.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,902,960.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	2,000,000.000	1,903,740.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,830,630.000	

		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	5,600,000.000	4,234,104.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	3,222,480.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,887,480.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,430,420.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	4,000,000.000	3,695,920.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,712,480.000	
		0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,855,850.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,104,064.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,104,080.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,432,600.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,617,960.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,708,120.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	957,180.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,919,120.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,400,000.000	6,725,564.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,569,612.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,980,166.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	3,236,376.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,500,000.000	1,288,005.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,664,800.000	

		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,929,040.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	952,500.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,850,750.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,884,080.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,898,200.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,987,640.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,986,640.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	3,000,000.000	2,979,600.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,990,430.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,000,000.000	1,907,800.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,482,060.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,488,390.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,977,380.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,970,930.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,485,645.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 900,345,127.090 (117,801,156,429)	
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	929,408.730	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	1,690,066.420	

		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,453,836.700	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,454,710.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,329,157.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,559,532.200	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,377,006.000	
		0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,300,000.000	2,279,231.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,484,700.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	858,821.600	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,778,958.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	1,053,885.800	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	708,330.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	743,632.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,842,544.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	973,039.200	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,017,675.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,000,000.000	543,910.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,419,075.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,456,720.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	704,473.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,366,001.000	

		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,267,344.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,300,000.000	1,100,268.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	360,510.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	470,605.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	228,165.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	95,996.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	493,548.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	637,847.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	260,409.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	243,111.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	100,000.000	89,843.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	420,000.000	284,915.400	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,190,359.170	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,664,905.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,599,975.680	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,032,426.560	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,792,827.690	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,456,975.080	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,820,044.740	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,389,634.400	

	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,818,427.360	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,945,856.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,833,275.580	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,819,545.180	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,926,802.800	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,676,601.140	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,003,121.170	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,004,904.640	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	2,115,185.640	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,593,453.680	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,878,653.700	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,116,275.160	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	2,035,561.280	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 74,272,087.200 (12,128,631,840)	
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	2,089,764.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,118,208.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,067,000.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,266,558.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,767,456.000	

	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,519,376.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,774,350.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,500,285.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,128,752.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,525,904.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,371,849.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	1,971,460.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	187,138.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	864,387.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	263,199.000	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 24,415,686.000 (958,672,145)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,128,468.680	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	574,449.690	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,345,239.620	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,812,635.720	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,371,182.260	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,820,209.880	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,121,570.100	

		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,190,441.740	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	743,299.920	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,631,019.280	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,111,878.860	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,087,775.160	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,740,006.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,820,618.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,687,726.300	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,195,177.600	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,410,506.800	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,383,103.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,253,984.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,500,000.000	2,050,075.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	899,570.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,452,752.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,005,575.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,072,908.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	932,338.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,235,793.000	
	オーストラリア・ドル　小計			**オーストラリア・ドル** 39,078,303.610	

			(3,683,520,899)	
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	5,335,564.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,164,600.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,178,500.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,143,000.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,295,560.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,000,000.000	5,109,450.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	6,000,000.000	6,065,100.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,425,185.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	27,000,000.000	27,266,490.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,500,000.000	6,748,105.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,138,110.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	7,925,099.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,078,250.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	3,000,000.000	3,213,360.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,876,386.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,524,705.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,037,050.000	
	3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,299,970.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,784,185.000	

		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,503,850.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,308,050.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	10,000,000.000	10,395,400.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,735,935.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	3,100,000.000	3,499,125.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	3,300,000.000	3,601,521.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,466,180.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	6,500,000.000	6,527,820.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,554,560.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,637,445.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	4,000,000.000	4,018,000.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	5,000,000.000	4,959,350.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,165,656.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	5,000,000.000	5,006,550.000	
オフショア・人民元　小計				**オフショア・人民元** 231,988,111.000 (4,562,347,787)	
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	568,058.700	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,151,240.450	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,389,726.720	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,242,068.080	

		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,033,379.050	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,035,919.560	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,237,788.580	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,394,813.750	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,279,014.310	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,134,637.120	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	917,788.350	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,128,201.600	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	614,841.500	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,287,520.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,013,336.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,161,647.400	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,188,024.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,358,070.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,008,917.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	669,620.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,674,550.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,616,500.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,902,348.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,144,908.000	

		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	276,846.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,981,868.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	97,158.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	952,010.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,450,000.000	1,093,836.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	968,250.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	184,880.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,897,970.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,700,000.000	1,482,247.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	192,216.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	389,664.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	908,220.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	94,958.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	395,032.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	199,208.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 46,267,282.870 (4,809,484,055)	
	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	802,926.320	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	936,937.300	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	813,854.000	

		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	387,024.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	676,032.500	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	593,844.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	630,937.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	523,528.400	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	669,424.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	443,250.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	689,602.500	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	549,890.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	488,784.800	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	323,400.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	583,620.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	702,000.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	543,192.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	165,646.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	189,240.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 10,713,133.320 (1,019,033,242)	
	スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	5,786,909.800	
		1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,049,797.250	

	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,788,900.350	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,979,175.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,786,895.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,484,569.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	6,921,146.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,358,350.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 48,155,742.800 (644,323,839)	
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	19,169,835.300	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	4,920,967.620	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,149,254.580	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,100,000.000	6,781,565.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	8,002,701.700	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,241,995.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	429,705.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	978,940.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 48,674,964.200 (917,523,075)	
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	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,142,461.050	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,274,799.400	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,165,401.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,263,812.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,361,330.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,591,819.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	6,100,756.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,068,800.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,598,170.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 35,567,349.250 (492,607,787)	
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	3,692,874.900	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,574,991.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,663,704.400	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,753,662.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,082,610.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,697,100.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	1,996,350.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,661,880.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	870,870.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	900,000.000	594,045.000	

	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	434,900.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	792,266.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,125,000.000	2,055,937.500	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	2,953,945.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,136,031.900	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 32,961,167.700 (1,008,064,576)	
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	2,336,408.340	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,221,067.680	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,553,636.520	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,296,932.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	733,565.810	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,359,417.280	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,861,255.680	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,304,784.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,075,899.160	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,758,156.660	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,181,777.400	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,318,457.280	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	907,094.100	

	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,560,137.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,575,621.500	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,192,023.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	1,987,791.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,213,524.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,221,396.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	615,216.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	655,076.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,610,000.000	2,570,693.400	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,200,768.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	401,064.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,218,087.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,545,740.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,950,000.000	1,693,906.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,594,548.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	473,560.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	400,812.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	511,255.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 39,539,670.810 (1,178,693,402)	
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	33,439,061.700	

	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,446,900.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,258,550.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,053,600.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	899,390.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	29,520,637.020	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	24,360,066.360	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,434,514.560	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,790,772.940	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,133,929.280	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,438,087.780	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	30,627,504.250	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,430,134.200	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,376,798.400	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 278,209,946.490 (1,864,062,283)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	336,725.480	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	277,630.110	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	791,511.670	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	697,683.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	318,038.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	768,240.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	614,718.300	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	471,760.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	464,990.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	196,702.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	241,331.900	

		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	291,716.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	436,645.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	231,376.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	518,196.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	189,942.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	250,000.000	182,425.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,385,315.810	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,106,936.820	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	705,686.240	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	177,535.200	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	897,579.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,236,236.800	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	590,000.000	521,495.100	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,160,400.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	917,280.000	
		Austria Government Bond 20240715	1,300,000.000	1,283,217.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	865,291.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	500,864.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	274,232.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	159,075.000	

		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,035,648.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	467,601.600	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	469,338.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	166,014.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	272,886.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	459,335.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	286,332.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,691,728.280	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,670,629.020	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,018,515.440	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	1,855,808.820	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,055,160.800	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	672,327.000	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	938,298.600	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,076,603.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,043,112.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	551,469.800	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	546,624.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,443,571.600	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	615,355.000	

		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,442,490.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	595,385.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,083,506.400	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	623,345.200	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,121,196.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,356,992.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	255,147.300	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	344,364.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	600,000.000	461,100.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,065,419.640	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,482,766.860	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,702,154.080	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,157,594.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,676,752.490	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	4,124,645.040	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,186,570.300	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	4,778,997.880	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,881,023.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,638,949.890	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,274,000.000	2,975,460.780	

		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,365,331.840	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,634,353.890	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,595,794.690	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	3,263,664.960	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,623,281.780	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,073,689.280	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,182,108.520	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,156,188.720	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,338,707.840	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,330,798.800	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,064,802.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,239,993.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,640,530.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,842,031.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	2,947,604.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,081,112.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,769,120.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,250,000.000	1,482,615.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,604,470.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,749,342.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,891,380.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,638,036.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,094,052.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	811,971.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,146,236.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,866,320.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	728,255.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,216,888.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	626,633.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,500,000.000	1,326,945.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	998,680.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	99,696.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,000,000.000	635,490.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,182,108.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	99,166.000	
		0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	99,121.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,894,699.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,902,144.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,673,140.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,351,232.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,240,108.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	97,579.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,128,214.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,247,935.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	95,240.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,530,296.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,208,014.590	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,437,125.000	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,510,358.620	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,404,949.400	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,007,478.160	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,266,138.420	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,664,000.000	4,955,889.760	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	2,395,730.100	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,984,057.120	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	6,136,797.180	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	3,057,463.200	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,245,395.240	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,464,353.660	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,015,449.230	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,450,375.360	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,096,868.190	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,620,000.000	5,555,651.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,282,808.750	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,772,945.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,155,884.190	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,884,719.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,455,429.400	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,360,492.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,413,677.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,249,256.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,659,754.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,752,396.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,366,680.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	3,150,000.000	2,637,715.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	4,077,951.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,224,044.900	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,753,330.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,834,127.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,882,580.000	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,654,422.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,487,480.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	446,194.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	99,227.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	1,052,790.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,908,712.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,925,284.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,300,000.000	841,516.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,600,000.000	1,339,024.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	100,000.000	97,542.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	177,014.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	289,818.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,403,361.900	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,254,543.200	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,277,300.480	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,597,286.760	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,408,268.000	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,320,548.420	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,556,210.320	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,755,323.280	

		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,896,313.620	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,154,614.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,389,458.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,309,918.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,110,900.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	722,385.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,250,116.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	759,144.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,150,000.000	686,366.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,139,437.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	680,328.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	823,500.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	96,363.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	300,000.000	270,144.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,007,336.100	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,342,223.100	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,874,346.800	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,846,652.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,425,899.370	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,454,867.960	

		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,782,425.400	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,879,985.290	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,377,628.700	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,326,707.900	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,996,408.960	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,017,451.560	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,545,226.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	786,877.520	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,366,095.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,489,660.300	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,310,517.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	1,793,538.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,634,579.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,586,656.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,202,526.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,032,548.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,280,123.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,553,876.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,244,550.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,569,406.000	

		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,250,048.300	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,701,315.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,909,633.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,208,206.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,082,213.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,164,675.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,675,344.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,250,639.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,189,730.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,221,818.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,165,395.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,002,140.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,286,683.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,686,200.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,862,889.000	
		0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,293,695.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,026,266.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,599,921.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,126,170.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,562,427.000	

		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,078,660.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	785,976.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	495,390.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,652,696.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,300,000.000	1,814,930.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	474,859.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,008,359.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,461,300.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	307,132.800	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	699,568.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,536,074.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	965,720.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,176,600.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,100,000.000	997,975.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,352,860.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	766,989.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	286,332.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	600,000.000	431,130.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231129	200,000.000	196,610.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	280,533.000	

		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	485,780.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	790,536.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	300,000.000	274,266.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	287,142.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,775,843.980	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,474,127.580	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,187,064.350	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,660,601.420	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,889,165.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,411,879.120	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,356,414.330	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,298,072.360	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,660,601.740	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,246,736.600	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,685,920.900	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,127,029.730	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,318,004.880	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,304,711.120	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,406,223.080	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,112,778.640	

		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,543,724.960	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,069,753.480	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,132,321.190	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	935,422.800	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,365,295.200	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,049,931.210	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,564,056.200	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	829,229.760	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,161,060.650	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	637,829.530	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,026,261.510	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	894,569.970	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,072,560.070	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	527,142.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	780,456.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	708,502.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	733,102.500	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	928,729.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	585,074.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	286,860.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	761,824.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	710,760.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	678,880.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	299,736.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,975.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,033,403.250	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,759,938.860	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,003,038.750	

		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	486,466.500	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	875,285.490	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	977,969.020	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	815,401.890	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	953,240.280	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	729,231.100	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	420,349.510	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	442,917.750	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	542,955.020	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,337,754.160	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,064,795.600	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,024,503.200	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,249,561.920	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,777,602.560	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,943,704.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,593,989.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,599,623.500	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,881,665.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,728,580.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,014,453.000	

		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,340,912.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,500,000.000	1,427,355.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,401,464.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,820,714.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,547,440.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	1,689,901.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,263,476.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,528,484.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,204,552.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,421,175.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	867,356.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,287,416.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,229,720.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	994,175.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	473,345.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,818,938.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	294,714.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	363,649.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	450,855.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	686,871.000	

		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,604,854.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	432,336.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	830,700.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,782,648.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	455,310.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	95,991.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	91,765.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,846,296.960	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	2,679,667.900	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	2,828,727.980	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,793,634.340	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,537,258.270	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,073,589.560	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,310,564.900	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,002,190.230	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,113,273.800	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,793,074.650	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,079,315.300	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,182,054.320	
	ユーロ　小計			ユーロ 595,042,197.510 (83,436,816,935)	

国債証券　合計		234,504,938,294 [234,504,938,294]	
合計		234,504,938,294 [234,504,938,294]	

（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	263銘柄	100%	50.2%
イギリス・ポンド	国債証券	55銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シュケル	国債証券	15銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券	33銘柄	100%	1.9%
カナダ・ドル	国債証券	39銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	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	15銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	31銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	358銘柄	100%	35.6%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月7日から2022年12月6日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ｉＦｒｅｅ 年金バランス

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2022年12月6日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,270,879
親投資信託受益証券	4,324,022,677
流動資産合計	4,373,293,556
資産合計	4,373,293,556
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,593,995
未払受託者報酬	443,738
未払委託者報酬	3,084,203
その他未払費用	166,325
流動負債合計	5,288,261
負債合計	5,288,261
純資産の部	
元本等	
元本	※1 3,495,355,982
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	872,649,313
（分配準備積立金）	221,089,410
元本等合計	4,368,005,295
純資産合計	4,368,005,295
負債純資産合計	4,373,293,556

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
営業収益	
受取利息	3
有価証券売買等損益	20,355,866
営業収益合計	20,355,869
営業費用	
支払利息	9,040
受託者報酬	443,738
委託者報酬	3,084,203
その他費用	166,325
営業費用合計	3,703,306
営業利益	16,652,563
経常利益	16,652,563
中間純利益	16,652,563
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	519,999
期首剰余金又は期首欠損金（△）	714,261,745
剰余金増加額又は欠損金減少額	175,126,883
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	175,126,883
剰余金減少額又は欠損金増加額	32,871,879
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	32,871,879
中間剰余金又は中間欠損金（△）	872,649,313

(3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	当中間計算期間末 2022年12月6日現在
1．※1　期首元本額	2,913,625,771円
期中追加設定元本額	716,112,153円
期中一部解約元本額	134,381,942円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	3,495,355,982口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	当中間計算期間末 2022年12月6日現在
1．金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月6日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月6日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2497円 (12,497円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2022年12月6日現在
		金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		13,353,607,977
株式	※2※3	199,054,953,980
未収入金		40,674,900
未収配当金		448,810,986

未収利息		800,818
その他未収収益	※4	7,080,247
流動資産合計		212,905,928,908
資産合計		212,905,928,908
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		7,363,200
前受金		24,800,000
未払金		3,359,179,380
未払解約金		90,489,790
受入担保金		7,754,847,177
流動負債合計		11,236,679,547
負債合計		11,236,679,547
純資産の部		
元本等		
元本	※1	147,781,550,540
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		53,887,698,821
元本等合計		201,669,249,361
純資産合計		201,669,249,361
負債純資産合計		212,905,928,908

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年12月6日現在
1．※1　期首	2022年6月7日
期首元本額	144,218,034,186円
期中追加設定元本額	10,169,953,264円
期中一部解約元本額	6,606,436,910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	2,867,620,826円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,779,531,783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	917,689円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,001,280円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	268,219,414円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	20,586,631円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	569,064,100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）	470,899,018円

Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	29,461,595円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	219,346,077円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	6,312,421,987円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,259,741,459円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	788,284,819円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	69,183,972,487円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,301,755,691円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,749,379,043円
ダイワ・ライフ・バランス７０	4,666,929,163円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,702,922,990円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	57,494,927円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	70,614,624円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,709,909,622円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,751,428円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	10,397,873円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	26,190,775円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	2,032,092,860円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	77,693,100円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	34,293,201円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,041,330,410円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	454,758,876円

	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	62,260,889円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	104,389,988円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	202,346,274円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	11,464,646,925円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	2,005,730,301円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,199,482,022円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,201,732,926円
	ダイワライフスタイル２５	135,153,967円
	ダイワライフスタイル５０	551,919,670円
	ダイワライフスタイル７５	420,696,675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）	8,693,607,155円
計		147,781,550,540円
2.	期末日における受益権の総数	147,781,550,540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 7,376,408,900円
4. ※3	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 887,410,000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5,988,736円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年12月6日現在

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2022年12月6日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買　建	2,415,375,000	－	2,408,080,000	△7,295,000
合計	2,415,375,000	－	2,408,080,000	△7,295,000

（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）

	2022年12月6日現在
1口当たり純資産額	1.3646円

（1万口当たり純資産額）	(13,646円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月6日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	569,935,170
コール・ローン	8,978,904,002
株式	277,010,013,789
投資証券	6,725,074,231
派生商品評価勘定	542,638,994
未収入金	619,907
未収配当金	401,466,358
差入委託証拠金	4,655,962,870
流動資産合計	298,884,615,321
資産合計	298,884,615,321
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,776,389
未払金	784,225,710
未払解約金	294,521,500
流動負債合計	1,112,523,599
負債合計	1,112,523,599
純資産の部	
元本等	
元本　※1	69,214,590,472
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	228,557,501,250
元本等合計	297,772,091,722
純資産合計	297,772,091,722
負債純資産合計	298,884,615,321

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年12月6日現在
1．※1　期首	2022年6月7日
期首元本額	65,219,352,126円
期中追加設定元本額	6,822,313,085円
期中一部解約元本額	2,827,074,739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	308,036,729円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,459,588円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	36,926,372円

ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	180,430,894円
外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	69,302,834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）	503,540,395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）	2,950,686,221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）	638,387,425円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	18,393,304円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	47,101,791円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	5,923,177,518円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,357,777,337円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	250,968,222円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	43,856,142,460円
ダイワ・ライフ・バランス３０	521,630,147円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,000,988,398円
ダイワ・ライフ・バランス７０	822,320,687円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,892,448,923円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,165,937円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,260,597円

	ダイワつみたてインデックス外国株式	1,387,611,128円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,875,196円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,214,762円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	4,618,088円
	ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	4,346,432円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	72,721,941円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	53,797,340円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,206,119,997円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	62,419,910円
	ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	173,081,567円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,149,957,791円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	428,134,905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）	1,283,241,198円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,884,831,059円
	ダイワライフスタイル２５	10,487,092円
	ダイワライフスタイル５０	43,392,019円
	ダイワライフスタイル７５	33,119,707円
計		69,214,590,472円
2.	期末日における受益権の総数	69,214,590,472口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年12月6日現在

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	2022年12月6日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
株価指数先物取引				
買　建	13,415,335,370	－	13,948,399,525	533,064,155
合計	13,415,335,370	－	13,948,399,525	533,064,155

（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

	2022年12月6日 現在

種　類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	7,815,996,170	－	7,791,794,620	△24,201,550
アメリカ・ドル	4,839,999,000	－	4,823,729,350	△16,269,650
イギリス・ポンド	478,707,930	－	481,640,410	2,932,480
オーストラリア・ドル	278,643,000	－	273,864,300	△4,778,700
カナダ・ドル	538,993,040	－	530,319,590	△8,673,450
スイス・フラン	581,294,400	－	579,615,600	△1,678,800
ユーロ	1,098,358,800	－	1,102,625,370	4,266,570
合計	7,815,996,170	－	7,791,794,620	△24,201,550

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年12月6日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.3022円 (43,022円)

「ネオ・ジャパン債券マザーファンド」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

	2022年12月6日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,547,842,140
国債証券	46,542,057,723
地方債証券	125,353,027
特殊債券	1,753,316,773
社債券	67,568,270,700
未収入金	1,663,214,200
未収利息	371,881,714
前払費用	10,193,552
差入委託証拠金	85,350,000
流動資産合計	125,667,479,829
資産合計	125,667,479,829
負債の部	
流動負債	
プット・オプション（売）	20,000,000
未払解約金	6,170,000,000
流動負債合計	6,190,000,000
負債合計	6,190,000,000
純資産の部	
元本等	
元本　※1	111,815,510,905
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,661,968,924
元本等合計	119,477,479,829
純資産合計	119,477,479,829
負債純資産合計	125,667,479,829

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物オプション取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年12月6日現在
1．※1　期首	2022年6月7日
期首元本額	108,031,335,737円
期中追加設定元本額	9,613,632,658円
期中一部解約元本額	5,829,457,490円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ネオ・ジャパン債券ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	110,799,820,648円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,014,793,893円
ジャパン・アクティブ・ボンド・オープン	896,364円
計	111,815,510,905円
2．　期末日における受益権の総数	111,815,510,905口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年12月6日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

債券関連

種　類	2022年12月6日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
債券先物				
オプション取引				
売　建				
プット	12,000,000	－	20,000,000	△8,000,000
合計	12,000,000	－	20,000,000	△8,000,000

（注）　1．時価の算定方法

債券先物オプション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．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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）

	2022年12月6日現在
1口当たり純資産額	1.0685円
（1万口当たり純資産額）	(10,685円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月6日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,893,593,406
コール・ローン	1,042,435,481
国債証券	237,555,735,211
派生商品評価勘定	205,375
未収利息	1,409,512,379
前払費用	57,021,400
流動資産合計	244,958,503,252
資産合計	244,958,503,252
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,725,631
未払金	3,795,235,599
未払解約金	188,625,695
流動負債合計	3,992,586,925
負債合計	3,992,586,925
純資産の部	
元本等	
元本　※1	76,350,011,470
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	164,615,904,857
元本等合計	240,965,916,327
純資産合計	240,965,916,327

負債純資産合計	244,958,503,252

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年6月7日 至　2022年12月6日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年12月6日現在
1．※1　期首	2022年6月7日
期首元本額	75,518,465,344円
期中追加設定元本額	4,558,467,989円
期中一部解約元本額	3,726,921,863円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	446,318,132円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	50,770,453円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	244,298,068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）	356,097,659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）	584,338,037円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,662,838,986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）	611,768,122円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,001,377円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	12,877,429円

ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,023,431,346円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,856,483,514円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	343,558,967円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,591,393,083円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,063,306,436円
ダイワ・ライフ・バランス５０	679,068,050円
ダイワ・ライフ・バランス７０	451,133,774円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	638,338,066円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	502,501,927円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	193,344,355円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	32,171,543円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	14,100,828円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,386,760,511円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,528,422円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,575,760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）	168,437,067円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	115,798,326円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	36,264,152円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,289,533,522円

ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	199,701,529円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	150,810,133円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	49,120,702円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	1,746,349,407円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,709,290,749円
ダイワライフスタイル２５	28,448,488円
ダイワライフスタイル５０	58,536,147円
ダイワライフスタイル７５	14,977,183円
計	76,350,011,470円
2. 期末日における受益権の総数	76,350,011,470口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年12月6日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2022年12月6日 現在			
	契約額等		時価	評価損益
	（円）	うち	（円）	（円）

		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	791,315,942	－	782,795,686	△8,520,256
アメリカ・ドル	119,937,024	－	117,415,612	△2,521,412
オフショア・人民元	95,757,698	－	95,270,985	△486,713
カナダ・ドル	88,626,862	－	86,562,539	△2,064,323
シンガポール・ドル	55,212,696	－	54,652,436	△560,260
メキシコ・ペソ	67,791,720	－	65,149,605	△2,642,115
ユーロ	363,989,942	－	363,744,509	△245,433
合計	791,315,942	－	782,795,686	△8,520,256

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年12月6日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1561円 (31,561円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年12月30日

Ⅰ	資産総額	4,328,926,144円
Ⅱ	負債総額	17,824,456円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,311,101,688円
Ⅳ	発行済数量	3,584,452,236口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2027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

2022年12月30日

Ⅰ	資産総額	206,374,712,532円
Ⅱ	負債総額	8,178,681,255円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	198,196,031,277円
Ⅳ	発行済数量	149,463,238,773口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3261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

2022年12月30日

Ⅰ	資産総額	285,932,714,963円
Ⅱ	負債総額	769,801,616円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	285,162,913,347円
Ⅳ	発行済数量	70,393,364,422口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0510円

(参考) ネオ・ジャパン債券マザーファンド

純資産額計算書

2022年12月30日

Ⅰ	資産総額	111,935,411,926円
Ⅱ	負債総額	117,568,700円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	111,817,843,226円
Ⅳ	発行済数量	106,506,242,963口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0499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

2022年12月30日

Ⅰ	資産総額	231,867,949,856円
Ⅱ	負債総額	609,729,171円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	231,258,220,685円
Ⅳ	発行済数量	76,913,876,366口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0067円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2022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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2022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	85	292,873
追加型株式投資信託	773	20,246,853
株式投資信託　　合計	858	20,539,726
単位型公社債投資信託	80	156,936
追加型公社債投資信託	14	1,410,738
公社債投資信託　合計	94	1,567,674
総合計	952	22,107,399

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。

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63期事業年度（2021年４月１日から2022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64期事業年度に係る中間会計期間（2022年４月１日から2022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 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,860		3,168
有価証券		333		486
前払費用		237		332
未収委託者報酬		13,150		13,811
未収収益		49		52
関係会社短期貸付金		18,700		24,900
その他		207		45
流動資産計		37,539		42,799
固定資産				
有形固定資産	※1	224	※1	203
建物		6		4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

（単位:百万円）

	前事業年度 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		68		65
未払金		8,405		9,856
未払収益分配金		13		26
未払償還金		39		12
未払手数料		4,734		4,917
その他未払金	※2	3,617	※2	4,900
未払費用		3,777		4,246
未払法人税等		804		980
未払消費税等		631		1,016
賞与引当金		950		866
その他		88		2
流動負債計		14,725		17,033
固定負債				
退職給付引当金		2,452		2,399
役員退職慰労引当金		74		13
その他		3		1
固定負債計		2,530		2,415
負債合計		17,256		19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

（単位:百万円）

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	△109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自　2021年４月１日 至　2022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	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	－	－	－	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 9,388
当期純利益	－	－	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

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．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。

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

５．その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 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、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年８月12日）を適用する予定であります。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

※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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
未払金	3,473百万円	4,694百万円

３ 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2022年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

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

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

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

① 剰余金の配当の総額　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日
⑤ 効力発生日　2021年６月23日

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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
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

（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

2022年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額	12,737百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,883円
④ 基準日	2022年３月31日
⑤ 効力発生日	2022年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ⅰ）為替変動リスクの管理

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

（ⅱ）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価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。

前事業年度（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）2019年適用指針第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、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（2022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）	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

（※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486百万円、投資有価証券10,022百万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、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	1,677	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（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。

当事業年度（2022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（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。

当事業年度（2022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	66	55	11
（２）その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

（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　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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,574　百万円	2,452　百万円
勤務費用	155	152
退職給付の支払額	△ 378	△ 303
その他	101	98
退職給付債務の期末残高	2,452	2,399

(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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,452百万円	2,399百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399
退職給付引当金	2,452	2,399
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
勤務費用	155　百万円	152　百万円
その他	108	67
確定給付制度に係る退職給付費用	263	219

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186百万円、当事業年度189百万円であります。

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	750	734
賞与引当金	243	227

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	△254	△ 356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
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	△453	△ 562
繰延税金負債合計	△612	△ 722
繰延税金資産の純額	973	885

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（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。

当事業年度（2022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。

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が74,402百万円、その他545百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３） 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

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　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。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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）	1,900	－	－

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　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。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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3）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	1,065	未払費用	91

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)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４)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。

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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
１株当たり純資産額　14,784.79円	１株当たり純資産額　16,078.50円
１株当たり当期純利益　3,599.54円	１株当たり当期純利益　4,883.43円

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
当期純利益（百万円）	9,389	12,738
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 （2022年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	※１	196
無形固定資産		
ソフトウエア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （2022年９月30日）
負債の部	
流動負債	
未払金	5,646

未払費用		4,193
未払法人税等		1,623
賞与引当金		486
その他	※２	655
流動負債合計		12,605
固定負債		
退職給付引当金		2,344
役員退職慰労引当金		33
その他		1
固定負債合計		2,379
負債合計		14,984
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		6,692
利益剰余金合計		7,067
株主資本合計		33,737
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		394
評価・換算差額等合計		394
純資産合計		34,131
負債・純資産合計		49,116

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	※１	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	※２	579
営業外費用	※３	274
経常利益		8,686
特別利益		―
特別損失	※４	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2022年４月１日 至　2022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	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,737	△12,737	△12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
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	-	-	-	△7,232	△7,232	△7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	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	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△576	△576	△576
当中間期変動額合計	△576	△576	△7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産
定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。
建物　10～18年
器具備品　４～20年

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

３．引当金の計上基準
（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

（会計方針の変更）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

（追加情報）

（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、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年８月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(１)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2022年９月30日現在）
有形固定資産	326百万円

※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（2022年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万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　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却損	244百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022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
2022年６月23日定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年３月31日	2022年６月24日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2022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。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
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	－	7,364
資産合計	57	7,306	－	7,364

（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

有価証券及び投資有価証券

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。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。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	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022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　1,454百万円）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	57	55	2
（２）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
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	2,692	3,171	△478
小計	2,692	3,171	△478
合計	7,364	6,797	567

（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）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３） 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日　至　2022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

内国籍証券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　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,084.78円
１株当たり中間純利益	2,110.46円

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
普通株主に帰属しない金額(百万円)	－
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

・監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2022年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	（注1）	
	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	（注1）	
	岡三証券株式会社	5,000百万円	（注1）	
	松井証券株式会社	11,945百万円	（注1）	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	（注1）	
	山和証券株式会社	585百万円	（注1）	
	楽天証券株式会社	17,495百万円	（注1）	
	株式会社SBI新生銀行	512,204百万円	（注3）	
	株式会社愛媛銀行	21,367百万円	（注3）	
	PayPay銀行株式会社	37,250百万円	（注3）	
	株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958百万円	（注3）	
	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279百万円	（注6）	

（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。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

２【関係業務の概要】

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

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
・使用開始日を記載することがあります。
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
・次の事項を記載することがあります。
①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
・ファンドの形態等を記載することがあります。
・図案を採用することがあります。
・ファンドの管理番号等を記載することがあります。
・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

・「iFreeのポイント」を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2022年５月23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

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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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7月22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ｉＦｒｅｅ 年金バランスの2021年6月8日から2022年6月6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、ｉＦｒｅｅ 年金バランスの2022年6月6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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

2022年11月28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2022年４月１日から2023年３月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年４月１日から2022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2022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（2022年４月１日から2022年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年2月3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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているｉＦｒｅｅ 年金バランスの2022年6月7日から2022年12月6日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ｉＦｒｅｅ 年金バランスの2022年12月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月7日から2022年12月6日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注) 1．　上記の中間監査報告書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。