

## 【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<br>連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【電話番号】                           | 03-5555-3431                    |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | ダイワ・ライフ・バランス 5 0                |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】        | 5,000億円を上限とします。                 |
| 【縦覧に供する場所】                       | 該当ありません。                        |

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ダイワ・ライフ・バランス50

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

### (6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

### (7)【申込期間】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

##### 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 補足分類    |
|-------------|--------|---------------|---------|
| 単位型投信       | 国内     | 株式            | インデックス型 |
| 追加型投信       | 海外     | 債券            |         |
|             | 内外     | 不動産投信         | 特殊型     |
|             |        | その他資産<br>( )  |         |
|             |        | 資産複合          |         |

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

|            |                  |  |   |
|------------|------------------|--|---|
| 投資対象<br>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<br>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<br>分変更型 | 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの |   |
| 決算頻度       | 年1回              | 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの   |   |
|            | 年2回              | 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの   |   |
|            | 年4回              | 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの   |   |
|            | 年6回（隔月）          | 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの   |   |
|            | 年12回（毎月）         | 目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの  |   |
|            | 日々               | 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの  |   |
|            | その他              | 上記属性にあてはまらないすべてのもの   |   |

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

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

#### < 信託金の限度額 >

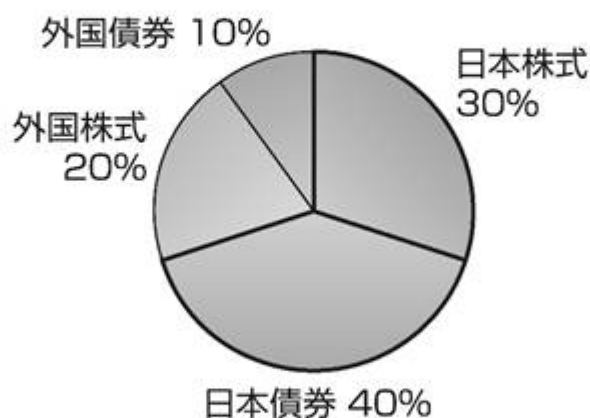
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

## 1 内外の株式および債券に投資します。

- 各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

### 標準組入比率(基準ポートフォリオ)について



|    | 国内  | 海外  | 合計   |
|----|-----|-----|------|
| 株式 | 30% | 20% | 50%  |
| 債券 | 40% | 10% | 50%  |
| 合計 | 70% | 30% | 100% |

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。



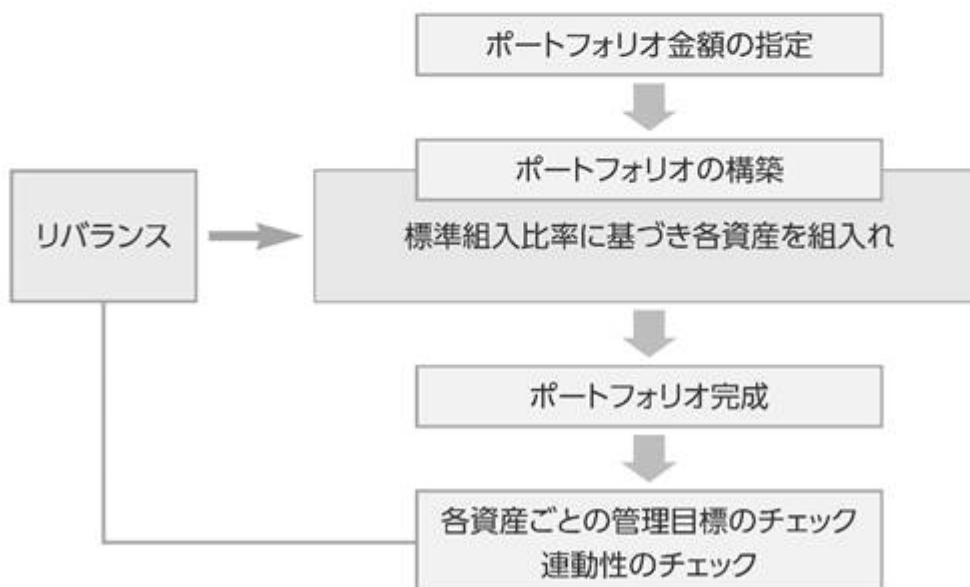
## 2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

### 各資産ごとのベンチマーク

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

### 運用プロセス



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

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

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

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

## 3

毎年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。

## 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
  - ②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
- ※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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産総額の75%以下とします。

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

## 各マザーファンドの運用プロセス

## 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

## 東証株価指数（TOPIX）とは

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

東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P X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、J P X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J P Xは責任を負いません。

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

### NOMURA-BPI総合指数とは

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

NOMURA-BPIの知的財産権およびその他一切の権利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に帰属します。なお、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は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等ならびに当ファンドおよび同指数に関連して行なわれる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

## 3. 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

### MSCIコクサイ指数とは

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

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>]

## 4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

### FTSE世界国債インデックスとは

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2005年6月6日

信託契約締結、当初設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

|                          |  |   |
|--------------------------|--|---|
| 受益者                      | お申込者   |   |
| 収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ） |  |   |
| お取扱窓口                    | 販売会社   | <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い<br/>一部解約請求に関する事務<br/>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>  |
| 1                        | 収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）  |   |
| 委託会社                     | 大和アセットマネジメント株式会社   | <p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行<br/>信託財産の運用指図<br/>信託財産の計算<br/>運用報告書の作成 など</p>   |
| 運用指図                     | 2  | 損益 信託金（ 3 ）   |
| 受託会社                     | <p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社：<br/>株式会社日本カストディ銀行</p>  | <p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br/>信託財産の計算 など</p> |
|                          |  | 損益 投資   |
| 投資対象                     | <p>東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）、内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）、外国の株式（預託証券を含みます。）、外国の公社債 など（ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）</p> |   |

（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收受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

主要投資対象

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

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

#### 1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

（東証株価指数）

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券

（NOMURA - BPI総合指数）

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

（MSCIコクサイ指数（円ベース））

4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

投資態度

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

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

< 標準組入比率 >

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の30%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）受益証券：信託財産の純資産総額の40%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

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

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

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

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

ヘ. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。

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

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

## (2) 【投資対象】

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)、および に定めるものに限ります。)

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から4.までに掲げる親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券、ならびに次の5.から24.までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の受益証券

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5. 株券または新株引受権証券

6. 国債証券

7. 地方債証券

8. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

14. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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



19. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
20. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
23. 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
24. 外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの

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

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

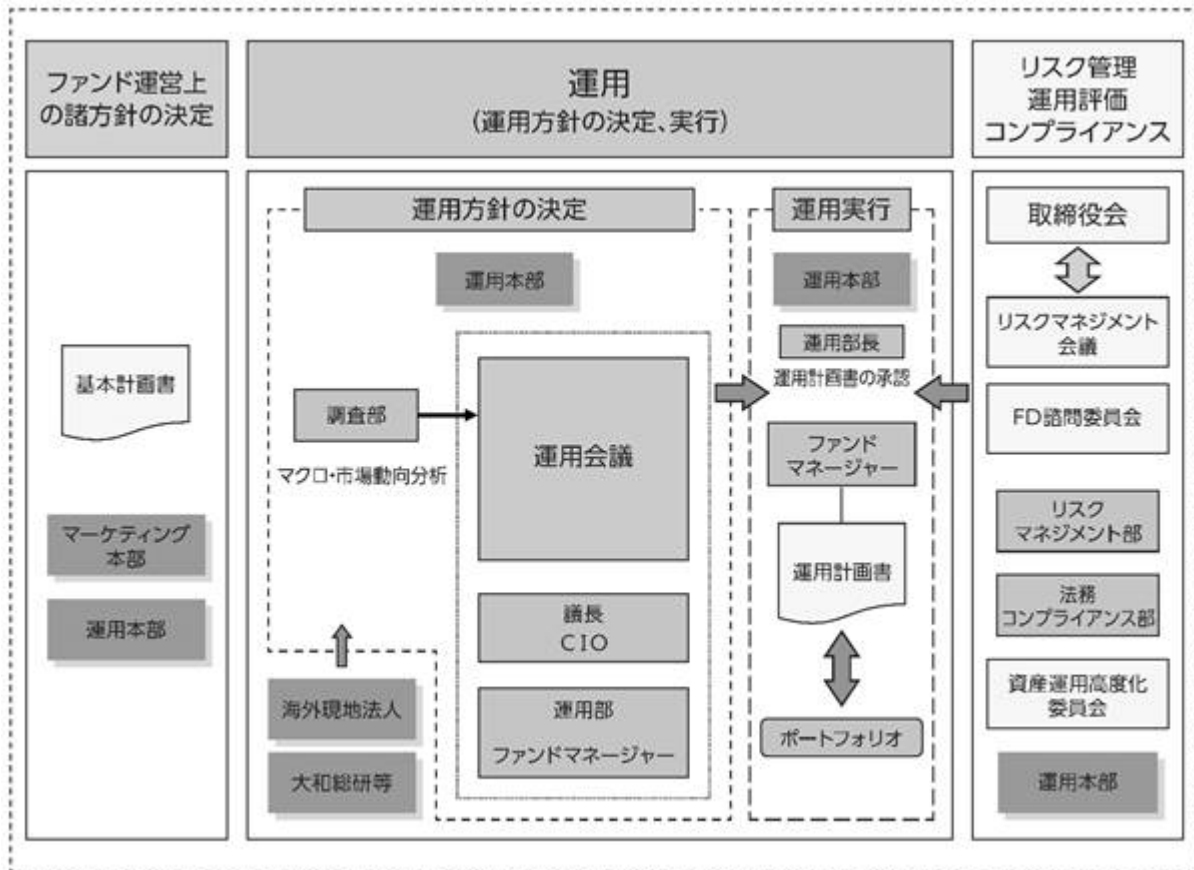
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

### (3)【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (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。

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。

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】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

## (5)【投資制限】

株式（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、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株式、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70以上となる投資の指図をしません。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式、新株引受権証券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。

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。

#### 投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。

#### 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、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、

#### 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。

#### 信用取引（信託約款）

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

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、

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

先物取引等（信託約款）

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取

引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

#### 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(以下本八.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．前八.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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 金利先渡取引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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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。

#### 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### 有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

#### 外貨建資産（信託約款）

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

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

#### 外国為替予約取引（信託約款）

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

#### 信用リスク集中回避（信託約款）



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

#### 資金の借入れ（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### < 参 考 > マザーファンドの概要

##### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

##### 基本的な投資態度

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

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

- イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
- ロ．ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
- ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### (2) 投資対象

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

### 3．外国株式インデックスマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

外国の株式(預託証券を含みます。)を主要投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

#### (2) 投資対象

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの  
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することを指図することができます。
  1. 預金
  2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 4. 外国債券インデックスマザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

###### 投資態度

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

##### (2) 投資対象

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

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

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの  
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
  1. 預金
  2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 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、よろしくお願い申し上げます。



基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### 外国証券への投資に伴うリスク

##### イ．為替リスク

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

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

##### ロ．カントリー・リスク

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

#### その他

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

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

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

### (3)その他の留意点

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

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

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

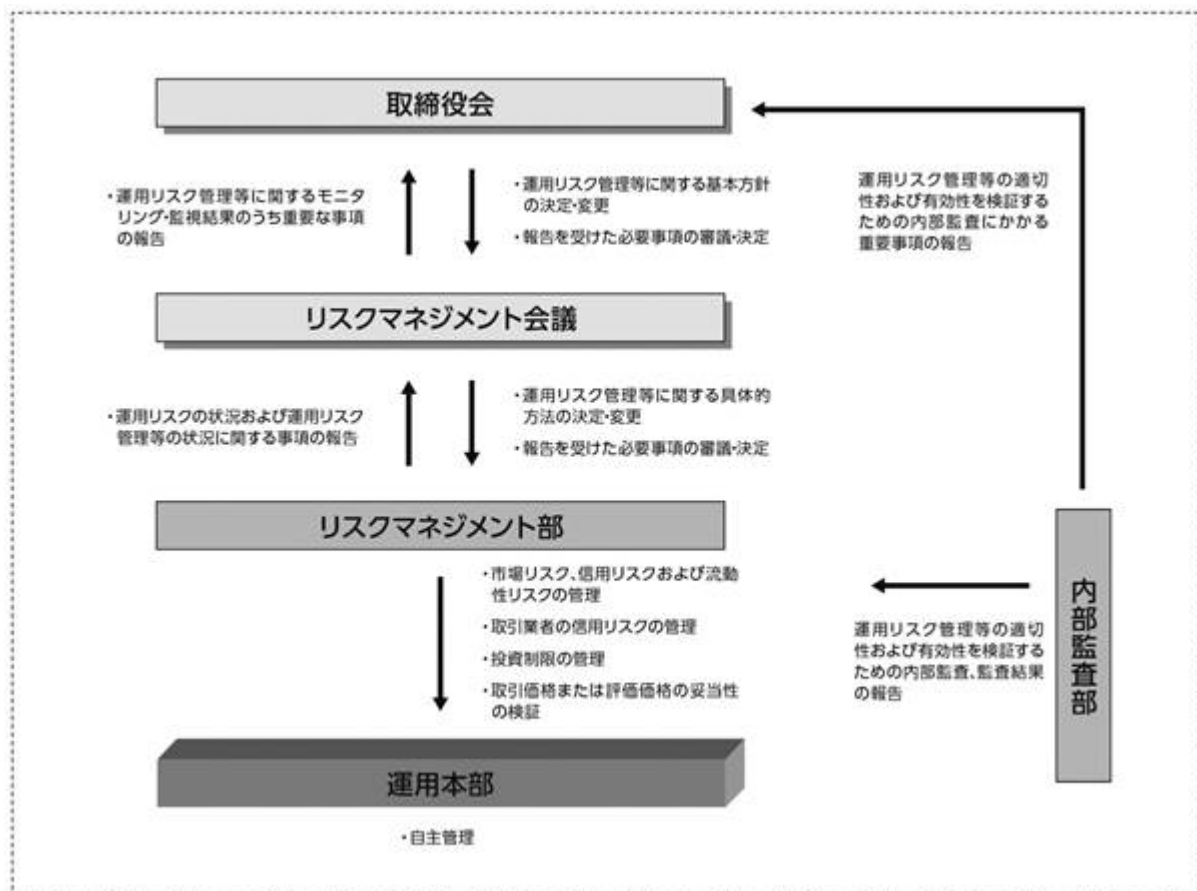
#### 流動性リスクに関する事項

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け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。



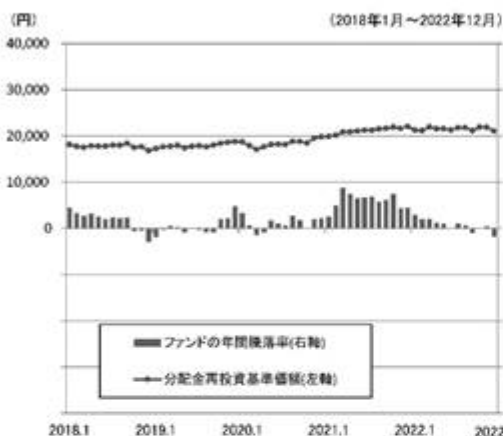
#### 流動性リスクに対する管理体制

- ・ 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・検証などを行いません。
- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

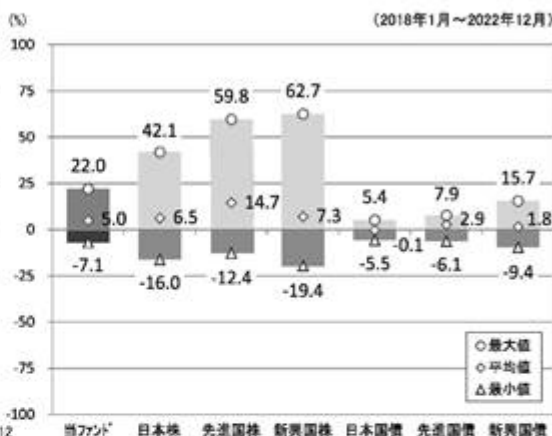
## 参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

●東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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準または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X 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ありません。ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「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】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.22%（税抜0.2%）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。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.08%<br>(税抜) | 年率0.09%<br>(税抜) | 年率0.03%<br>(税抜) |

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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（配当控除の適用があります。）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。

#### 「つみたてNISA」をご利用の場合

販売会社によっては「つみたてNISA」の適用対象となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

毎年、一定額の範囲で販売会社との契約に基づいて定期かつ継続的な方法で購入することにより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。

なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年においてその両方を併用した投資は行なえません。

#### 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。

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

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が

普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- （ ）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- （ ）上記は、2022年12月末日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- （ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】（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             | 21,117,111,490 | 99.60   |
| 内 日本                  | 21,117,111,490 | 99.60   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 84,777,914     | 0.40    |
| 純資産総額                 | 21,201,889,404 | 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）

## 【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<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------------------|----|-----------|----------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1 | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 日本 | 親投資信託受益証券 | 6,969,371,177        | 1.2631<br>8,803,420,938 | 1.2223<br>8,518,662,389 | 40.18           |
| 2 | トピックス・インデックス・マザーファンド      | 日本 | 親投資信託受益証券 | 4,756,979,474        | 1.3388<br>6,368,698,201 | 1.3261<br>6,308,230,480 | 29.75           |
| 3 | 外国株式インデックスマザーファンド         | 日本 | 親投資信託受益証券 | 1,036,915,997        | 4.2031<br>4,358,299,573 | 4.0510<br>4,200,546,703 | 19.81           |
| 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 | 695,005,128          | 3.1499<br>2,189,221,853 | 3.0067<br>2,089,671,918 | 9.86            |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.60% |
| 合計        | 99.60% |

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



## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第8計算期間末<br>(2013年6月5日)  | 3,768,631,160         | 3,768,631,160         | 1.2662                     | 1.2662                     |
| 第9計算期間末<br>(2014年6月5日)  | 4,783,424,672         | 4,783,424,672         | 1.4020                     | 1.4020                     |
| 第10計算期間末<br>(2015年6月5日) | 6,170,909,855         | 6,170,909,855         | 1.6552                     | 1.6552                     |
| 第11計算期間末<br>(2016年6月6日) | 6,343,341,340         | 6,343,341,340         | 1.5313                     | 1.5313                     |
| 第12計算期間末<br>(2017年6月5日) | 7,577,368,811         | 7,577,368,811         | 1.6888                     | 1.6888                     |
| 第13計算期間末<br>(2018年6月5日) | 9,369,920,286         | 9,369,920,286         | 1.7946                     | 1.7946                     |
| 第14計算期間末<br>(2019年6月5日) | 10,459,930,523        | 10,459,930,523        | 1.7485                     | 1.7485                     |
| 第15計算期間末<br>(2020年6月5日) | 12,623,652,425        | 12,623,652,425        | 1.8516                     | 1.8516                     |
| 第16計算期間末<br>(2021年6月7日) | 16,693,918,915        | 16,693,918,915        | 2.1207                     | 2.1207                     |
| 2021年12月末日              | 19,606,522,639        | -                     | 2.2042                     | -                          |
| 2022年1月末日               | 19,145,237,420        | -                     | 2.1311                     | -                          |
| 2月末日                    | 19,154,193,730        | -                     | 2.1170                     | -                          |
| 3月末日                    | 20,128,059,844        | -                     | 2.1937                     | -                          |
| 4月末日                    | 19,885,767,152        | -                     | 2.1564                     | -                          |

|                         |                |                |        |        |
|-------------------------|----------------|----------------|--------|--------|
| 5月末日                    | 20,126,993,455 | -              | 2.1575 | -      |
| 第17計算期間末<br>(2022年6月6日) | 20,305,181,077 | 20,305,181,077 | 2.1707 | 2.1707 |
| 6月末日                    | 20,122,236,881 | -              | 2.1310 | -      |
| 7月末日                    | 20,718,986,856 | -              | 2.1781 | -      |
| 8月末日                    | 21,096,252,003 | -              | 2.1843 | -      |
| 9月末日                    | 20,672,833,435 | -              | 2.1157 | -      |
| 10月末日                   | 21,563,343,002 | -              | 2.1921 | -      |
| 11月末日                   | 21,754,412,549 | -              | 2.1869 | -      |
| 12月末日                   | 21,201,889,404 | -              | 2.1077 | -      |

## 【分配の推移】

|                          | 1口当たり分配金(円) |
|--------------------------|-------------|
| 第8計算期間                   | 0.0000      |
| 第9計算期間                   | 0.0000      |
| 第10計算期間                  | 0.0000      |
| 第11計算期間                  | 0.0000      |
| 第12計算期間                  | 0.0000      |
| 第13計算期間                  | 0.0000      |
| 第14計算期間                  | 0.0000      |
| 第15計算期間                  | 0.0000      |
| 第16計算期間                  | 0.0000      |
| 第17計算期間                  | 0.0000      |
| 2022年6月7日～<br>2022年12月6日 | -           |

## 【収益率の推移】

|         | 収益率(%) |
|---------|--------|
| 第8計算期間  | 32.2   |
| 第9計算期間  | 10.7   |
| 第10計算期間 | 18.1   |
| 第11計算期間 | 7.5    |
| 第12計算期間 | 10.3   |
| 第13計算期間 | 6.3    |
| 第14計算期間 | 2.6    |
| 第15計算期間 | 5.9    |
| 第16計算期間 | 14.5   |
| 第17計算期間 | 2.4    |

|                          |     |
|--------------------------|-----|
| 2022年6月7日～<br>2022年12月6日 | 0.1 |
|--------------------------|-----|

## (4) 【設定及び解約の実績】

|                          | 設定数量(口)       | 解約数量(口)     |
|--------------------------|---------------|-------------|
| 第8計算期間                   | 630,210,873   | 277,971,974 |
| 第9計算期間                   | 766,679,623   | 331,047,078 |
| 第10計算期間                  | 648,385,457   | 332,037,184 |
| 第11計算期間                  | 781,918,053   | 367,727,208 |
| 第12計算期間                  | 742,279,216   | 397,980,945 |
| 第13計算期間                  | 1,197,236,585 | 462,712,216 |
| 第14計算期間                  | 1,546,801,950 | 785,943,884 |
| 第15計算期間                  | 1,585,505,363 | 749,921,598 |
| 第16計算期間                  | 1,834,830,742 | 780,489,950 |
| 第17計算期間                  | 2,284,315,140 | 801,938,510 |
| 2022年6月7日～<br>2022年12月6日 | 1,002,489,675 | 399,564,515 |

## (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）

## 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<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)          | 評価単価<br>時価<br>(円)          | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------------|----|----|--------|----------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | トヨタ自動車        | 日本 | 株式 | 輸送用機器  | 3,886,700            | 2,044.19<br>7,945,187,504  | 1,812.50<br>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<br>5,180,512,871 | 10,035.00<br>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<br>3,251,393,806    | 889.00<br>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<br>3,628,811,492 | 51,420.00<br>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<br>3,562,770,419  | 3,762.00<br>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<br>2,217,330,630  | 5,296.00<br>2,697,782,400  | 1.36            |
| 7  | 第一三共          | 日本 | 株式 | 医薬品    | 618,400              | 4,226.50<br>2,613,670,615  | 4,250.00<br>2,628,200,000  | 1.33            |
| 8  | 武田薬品          | 日本 | 株式 | 医薬品    | 628,100              | 3,841.33<br>2,412,743,827  | 4,111.00<br>2,582,119,100  | 1.30            |
| 9  | 任天堂           | 日本 | 株式 | その他製品  | 446,900              | 6,170.60<br>2,757,642,207  | 5,532.00<br>2,472,250,800  | 1.25            |
| 10 | 日立            | 日本 | 株式 | 電気機器   | 358,900              | 6,726.92<br>2,414,292,813  | 6,691.00<br>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<br>2,265,065,990  | 5,644.00<br>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<br>2,369,575,350  | 4,177.00<br>2,250,567,600  | 1.14            |
| 13 | KDDI          | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 548,600              | 4,362.91<br>2,393,495,037  | 3,982.00<br>2,184,525,200  | 1.10            |
| 14 | 三井物産          | 日本 | 株式 | 卸売業    | 548,000              | 3,325.82<br>1,822,553,353  | 3,853.00<br>2,111,444,000  | 1.07            |
| 15 | 三菱商事          | 日本 | 株式 | 卸売業    | 468,300              | 4,367.04<br>2,045,086,631  | 4,283.00<br>2,005,728,900  | 1.01            |
| 16 | 東京海上HD        | 日本 | 株式 | 保険業    | 702,000              | 2,634.82<br>1,849,643,657  | 2,827.50<br>1,984,905,000  | 1.00            |

|    |              |    |    |        |           |                            |                            |      |
|----|--------------|----|----|--------|-----------|----------------------------|----------------------------|------|
| 17 | 信越化学         | 日本 | 株式 | 化学     | 121,300   | 15,884.38<br>1,926,776,470 | 16,225.00<br>1,968,092,500 | 0.99 |
| 18 | HOYA         | 日本 | 株式 | 精密機器   | 152,900   | 14,472.95<br>2,212,915,556 | 12,705.00<br>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<br>2,050,246,090 | 38,880.00<br>1,940,112,000 | 0.98 |
| 20 | 伊藤忠          | 日本 | 株式 | 卸売業    | 461,600   | 3,807.27<br>1,757,438,596  | 4,146.00<br>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<br>1,677,693,872  | 1,856.00<br>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<br>2,034,808,024  | 3,032.00<br>1,744,612,800  | 0.88 |
| 23 | ダイキン工業       | 日本 | 株式 | 機械     | 85,400    | 24,044.59<br>2,053,408,300 | 20,200.00<br>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<br>1,712,440,730  | 1,488.00<br>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<br>1,562,624,174 | 19,160.00<br>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<br>1,542,593,012  | 5,660.00<br>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<br>1,586,146,848  | 6,588.00<br>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<br>1,509,159,452 | 19,835.00<br>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<br>1,346,620,890  | 2,006.50<br>1,364,821,300  | 0.69 |
| 30 | S M C        | 日本 | 株式 | 機械     | 23,100    | 63,076.11<br>1,457,058,258 | 55,580.00<br>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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域 | 資産名               | 買建/<br>売建 | 数量  | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------------|----|-------------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | 日本 | TOPIX先物 050<br>3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。

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

## (1) 投資状況（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                  | 38,351,508,130 | 91.28   |
| 内 日本                  | 38,351,508,130 | 91.28   |
| 地方債証券                 | 1,430,184,200  | 3.40    |
| 内 日本                  | 1,430,184,200  | 3.40    |
| 特殊債券                  | 718,287,100    | 1.71    |
| 内 日本                  | 718,287,100    | 1.71    |
| 社債券                   | 1,276,156,600  | 3.04    |
| 内 日本                  | 1,276,156,600  | 3.04    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 236,820,925    | 0.56    |
| 純資産総額                 | 42,012,956,955 | 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）

## 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<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)     | 評価単価<br>時価<br>(円)     | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|----------|----|------|----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | 145 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 710,000,000          | 100.30<br>712,186,800 | 100.12<br>710,859,100 | 0.100000<br>2025/09/20   | 1.69            |

|    |           |    |      |             |                       |                       |                        |      |
|----|-----------|----|------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 2  | 139 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 640,000,000 | 100.20<br>641,324,800 | 100.10<br>640,691,200 | 0.100000<br>2024/03/20 | 1.52 |
| 3  | 143 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 630,000,000 | 100.26<br>631,671,200 | 100.12<br>630,762,300 | 0.100000<br>2025/03/20 | 1.50 |
| 4  | 141 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 620,000,000 | 100.24<br>621,506,600 | 100.11<br>620,737,800 | 0.100000<br>2024/09/20 | 1.48 |
| 5  | 144 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 580,000,000 | 100.29<br>581,703,900 | 100.12<br>580,707,600 | 0.100000<br>2025/06/20 | 1.38 |
| 6  | 147 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 580,000,000 | 100.00<br>580,000,000 | 99.80<br>578,886,400  | 0.005000<br>2026/03/20 | 1.38 |
| 7  | 148 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 500,000,000 | 99.96<br>499,820,000  | 99.70<br>498,535,000  | 0.005000<br>2026/06/20 | 1.19 |
| 8  | 352 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 500,000,000 | 99.74<br>498,705,000  | 98.76<br>493,830,000  | 0.100000<br>2028/09/20 | 1.18 |
| 9  | 350 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 480,000,000 | 99.84<br>479,241,600  | 99.10<br>475,684,800  | 0.100000<br>2028/03/20 | 1.13 |
| 10 | 140 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 470,000,000 | 100.22<br>471,057,500 | 100.10<br>470,512,300 | 0.100000<br>2024/06/20 | 1.12 |
| 11 | 358 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 480,000,000 | 99.06<br>475,516,800  | 97.52<br>468,110,400  | 0.100000<br>2030/03/20 | 1.11 |
| 12 | 351 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 470,000,000 | 99.74<br>468,778,900  | 98.92<br>464,952,200  | 0.100000<br>2028/06/20 | 1.11 |
| 13 | 149 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 450,000,000 | 99.90<br>449,572,500  | 99.55<br>448,002,000  | 0.005000<br>2026/09/20 | 1.07 |
| 14 | 360 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 460,000,000 | 98.73<br>454,194,800  | 97.10<br>446,669,200  | 0.100000<br>2030/09/20 | 1.06 |
| 15 | 151 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 450,000,000 | 99.72<br>448,744,500  | 99.24<br>446,616,000  | 0.005000<br>2027/03/20 | 1.06 |
| 16 | 361 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 460,000,000 | 98.62<br>453,656,600  | 96.90<br>445,744,600  | 0.100000<br>2030/12/20 | 1.06 |
| 17 | 154 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 440,000,000 | 99.95<br>439,788,800  | 99.39<br>437,333,600  | 0.100000<br>2027/09/20 | 1.04 |
| 18 | 362 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 450,000,000 | 98.50<br>443,250,000  | 96.77<br>435,465,000  | 0.100000<br>2031/03/20 | 1.04 |
| 19 | 353 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 440,000,000 | 99.67<br>438,548,000  | 98.59<br>433,831,200  | 0.100000<br>2028/12/20 | 1.03 |
| 20 | 348 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 430,000,000 | 99.95<br>429,793,600  | 99.39<br>427,394,200  | 0.100000<br>2027/09/20 | 1.02 |
| 21 | 345 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 410,000,000 | 100.20<br>410,828,200 | 99.78<br>409,110,300  | 0.100000<br>2026/12/20 | 0.97 |



|    |           |    |      |             |                       |                      |                        |      |
|----|-----------|----|------|-------------|-----------------------|----------------------|------------------------|------|
| 22 | 354 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 410,000,000 | 99.59<br>408,335,400  | 98.42<br>403,526,100 | 0.100000<br>2029/03/20 | 0.96 |
| 23 | 347 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 400,000,000 | 100.04<br>400,180,000 | 99.51<br>398,056,000 | 0.100000<br>2027/06/20 | 0.95 |
| 24 | 368 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 400,000,000 | 99.52<br>398,084,000  | 98.03<br>392,156,000 | 0.200000<br>2032/09/20 | 0.93 |
| 25 | 439 2年国債  | 日本 | 国債証券 | 390,000,000 | 100.07<br>390,292,500 | 99.96<br>389,844,000 | 0.005000<br>2024/08/01 | 0.93 |
| 26 | 364 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 400,000,000 | 98.32<br>393,297,600  | 96.62<br>386,484,000 | 0.100000<br>2031/09/20 | 0.92 |
| 27 | 366 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 390,000,000 | 100.13<br>390,534,300 | 98.09<br>382,562,700 | 0.200000<br>2032/03/20 | 0.91 |
| 28 | 356 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 390,000,000 | 99.36<br>387,511,800  | 98.00<br>382,227,300 | 0.100000<br>2029/09/20 | 0.91 |
| 29 | 359 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 390,000,000 | 98.88<br>385,663,200  | 97.29<br>379,466,100 | 0.100000<br>2030/06/20 | 0.90 |
| 30 | 349 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 380,000,000 | 99.87<br>379,521,200  | 99.26<br>377,207,000 | 0.100000<br>2027/12/20 | 0.90 |

(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      | 91.28% |
| 地方債証券     | 3.40%  |
| 特殊債券      | 1.71%  |
| 社債券       | 3.04%  |
| 合計        | 99.44% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国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)

## 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<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)           | 評価単価<br>時価<br>(円)           | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|------------------------|------|----|----------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|
| 1 | APPLE INC              | アメリカ | 株式 | 情報技術                       | 692,000              | 18,762.18<br>12,983,471,506 | 17,199.24<br>11,901,878,924 | 4.17            |
| 2 | MICROSOFT CORP         | アメリカ | 株式 | 情報技術                       | 305,000              | 31,961.98<br>9,748,432,348  | 31,982.02<br>9,754,518,235  | 3.42            |
| 3 | AMAZON.COM INC         | アメリカ | 株式 | 一般消費<br>財・サービス             | 394,800              | 12,286.29<br>4,850,648,919  | 11,170.68<br>4,410,186,833  | 1.55            |
| 4 | ALPHABET INC-CL A      | アメリカ | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サービ<br>ス | 258,100              | 12,659.44<br>3,267,415,304  | 11,737.31<br>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<br>2,825,196,668  | 70,315.07<br>2,831,306,850  | 0.99            |

|    |                                |      |    |                            |         |                            |                            |      |
|----|--------------------------------|------|----|----------------------------|---------|----------------------------|----------------------------|------|
| 6  | ALPHABET INC-CL C              | アメリカ | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サービ<br>ス | 238,540 | 12,682.27<br>3,025,236,424 | 11,803.66<br>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<br>2,646,256,159 | 23,562.21<br>2,667,242,398 | 0.94 |
| 8  | EXXON MOBIL CORP               | アメリカ | 株式 | エネル<br>ギー                  | 179,305 | 14,671.71<br>2,630,711,906 | 14,490.84<br>2,598,280,066 | 0.91 |
| 9  | BERKSHIRE HATHAWAY<br>INC-CL B | アメリカ | 株式 | 金融                         | 56,150  | 41,841.50<br>2,349,405,927 | 41,012.26<br>2,302,838,511 | 0.81 |
| 10 | JPMORGAN CHASE & CO            | アメリカ | 株式 | 金融                         | 126,270 | 18,129.60<br>2,289,241,565 | 17,678.29<br>2,232,238,183 | 0.78 |
| 11 | PROCTER & GAMBLE<br>CO/THE     | アメリカ | 株式 | 生活必需<br>品                  | 102,667 | 19,321.38<br>1,983,671,412 | 20,248.69<br>2,078,872,564 | 0.73 |
| 12 | NVIDIA CORP                    | アメリカ | 株式 | 情報技術                       | 107,180 | 20,810.14<br>2,230,440,205 | 19,378.18<br>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<br>1,956,868,777 | 27,609.56<br>1,945,093,643 | 0.68 |
| 14 | CHEVRON CORP                   | アメリカ | 株式 | エネル<br>ギー                  | 80,018  | 24,033.29<br>1,923,097,761 | 23,663.06<br>1,893,471,055 | 0.66 |
| 15 | HOME DEPOT INC                 | アメリカ | 株式 | 一般消費<br>財・サービ<br>ス         | 44,150  | 41,966.50<br>1,852,823,485 | 42,518.40<br>1,877,187,669 | 0.66 |
| 16 | TESLA INC                      | アメリカ | 株式 | 一般消費<br>財・サービ<br>ス         | 114,850 | 24,087.43<br>2,766,455,487 | 16,165.51<br>1,856,609,283 | 0.65 |
| 17 | NESTLE SA-REG                  | スイス  | 株式 | 生活必需<br>品                  | 113,134 | 15,993.37<br>1,809,409,117 | 15,561.29<br>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<br>1,691,402,029 | 46,207.46<br>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<br>1,681,308,569 | 48,703.55<br>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<br>1,587,570,034  | 6,811.49<br>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<br>1,598,180,465 | 21,571.71<br>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<br>1,576,812,347 | 14,705.81<br>1,604,713,129 | 0.56 |

|    |                                 |       |    |                            |         |                            |                            |      |
|----|---------------------------------|-------|----|----------------------------|---------|----------------------------|----------------------------|------|
| 23 | META PLATFORMS INC<br>CLASS A   | アメリカ  | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サービ<br>ス | 98,200  | 14,565.01<br>1,430,291,291 | 15,958.50<br>1,567,124,896 | 0.55 |
| 24 | COCA-COLA CO/THE                | アメリカ  | 株式 | 生活必需<br>品                  | 176,950 | 8,296.53<br>1,468,092,744  | 8,486.16<br>1,501,626,897  | 0.53 |
| 25 | PEPSICO INC                     | アメリカ  | 株式 | 生活必需<br>品                  | 59,400  | 24,244.02<br>1,440,099,148 | 24,148.74<br>1,434,435,512 | 0.50 |
| 26 | BANK OF AMERICA CORP            | アメリカ  | 株式 | 金融                         | 311,301 | 4,914.01<br>1,529,757,771  | 4,397.67<br>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<br>1,240,531,005 | 17,895.91<br>1,326,177,003 | 0.47 |
| 28 | BROADCOM INC                    | アメリカ  | 株式 | 情報技術                       | 17,412  | 69,346.49<br>1,207,463,532 | 74,021.38<br>1,288,860,390 | 0.45 |
| 29 | THERMO FISHER<br>SCIENTIFIC INC | アメリカ  | 株式 | ヘルスケア                      | 16,900  | 71,737.35<br>1,212,361,930 | 73,915.22<br>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<br>1,340,181,847 | 73,097.54<br>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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域          | 資産名                        | 買建/<br>売建 | 数量         | 簿価             | 時価             | 投資<br>比率 |
|--------------|-------------|----------------------------|-----------|------------|----------------|----------------|----------|
| 株価指数先物<br>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<br>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<br>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<br>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<br>月        | 買建        | 5,200,000  | 478,773,020    | 465,200,320    | 0.16%    |
|              |             | 英ポンド買/円売 2023年<br>1月       | 買建        | 4,700,000  | 773,597,780    | 750,872,000    | 0.26%    |
|              |             | スイス・フラン買/円売<br>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<br>月        | 買建        | 11,300,000 | 1,614,960,540  | 1,597,167,990  | 0.56%    |
|              |             | カナダ・ドル買/円売<br>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。

## 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）

## 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<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)      | 評価単価<br>時価<br>(円)      | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------------------|------|------|----------------------|------------------------|------------------------|--------------------------|-----------------|
| 1  | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 12,000,000           | 81.94<br>1,304,966,699 | 81.75<br>1,301,787,000 | 1.375000<br>2031/11/15   | 0.56            |
| 2  | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,400,000           | 85.43<br>1,179,043,746 | 85.14<br>1,175,082,916 | 1.875000<br>2032/02/15   | 0.51            |
| 3  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 10,700,000           | 82.21<br>1,167,348,364 | 81.87<br>1,162,549,136 | 1.125000<br>2031/02/15   | 0.50            |
| 4  | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 9,300,000            | 92.98<br>1,147,524,842 | 92.53<br>1,141,934,324 | 2.875000<br>2032/05/15   | 0.49            |
| 5  | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,300,000           | 81.65<br>1,116,082,373 | 81.44<br>1,113,253,076 | 1.250000<br>2031/08/15   | 0.48            |
| 6  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 9,800,000            | 80.69<br>1,049,458,215 | 80.28<br>1,044,100,320 | 0.875000<br>2030/11/15   | 0.45            |
| 7  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 8,700,000            | 84.81<br>979,146,058   | 84.50<br>975,647,954   | 1.625000<br>2031/05/15   | 0.42            |
| 8  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 7,729,000            | 91.87<br>942,335,957   | 92.18<br>945,464,154   | 1.625000<br>2026/05/15   | 0.41            |
| 9  | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,500,000            | 92.85<br>924,179,197   | 93.27<br>928,299,532   | 0.375000<br>2024/09/15   | 0.40            |
| 10 | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,500,000            | 91.84<br>914,067,457   | 91.40<br>909,718,215   | 2.750000<br>2032/08/15   | 0.39            |
| 11 | FRENCH GOVERNMENT<br>BOND           | ユーロ  | 国債証券 | 6,086,000            | 100.09<br>861,830,186  | 99.42<br>856,009,918   | 2.250000<br>2024/05/25   | 0.37            |
| 12 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,700,000            | 94.46<br>839,834,414   | 94.46<br>839,887,759   | 2.875000<br>2028/08/15   | 0.36            |
| 13 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 8,000,000            | 79.30<br>841,848,800   | 78.98<br>838,536,608   | 0.625000<br>2030/08/15   | 0.36            |
| 14 | FRENCH GOVERNMENT<br>BOND           | ユーロ  | 国債証券 | 5,899,000            | 102.76<br>857,631,362  | 100.05<br>835,023,903  | 2.750000<br>2027/10/25   | 0.36            |
| 15 | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,000,000            | 89.29<br>829,470,544   | 89.61<br>832,452,313   | 1.125000<br>2026/10/31   | 0.36            |
| 16 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,500,000            | 94.65<br>816,420,826   | 94.70<br>816,843,475   | 2.875000<br>2028/05/15   | 0.35            |
| 17 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,600,000            | 92.84<br>813,137,562   | 92.77<br>812,506,972   | 2.625000<br>2029/02/15   | 0.35            |
| 18 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,350,000            | 94.24<br>794,125,500   | 94.27<br>794,403,573   | 2.750000<br>2028/02/15   | 0.34            |



|    |                                     |      |      |           |                      |                      |                        |      |
|----|-------------------------------------|------|------|-----------|----------------------|----------------------|------------------------|------|
| 19 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,400,000 | 93.27<br>792,148,934 | 93.43<br>793,541,753 | 2.375000<br>2027/05/15 | 0.34 |
| 20 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 7,000,000 | 85.09<br>790,447,455 | 85.28<br>792,212,365 | 0.750000<br>2028/01/31 | 0.34 |
| 21 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,162,000 | 96.29<br>787,377,180 | 96.60<br>789,936,573 | 2.375000<br>2024/08/15 | 0.34 |
| 22 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,500,000 | 90.33<br>779,184,542 | 90.71<br>782,453,607 | 0.250000<br>2025/06/30 | 0.34 |
| 23 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,500,000 | 90.21<br>778,175,359 | 90.46<br>780,331,734 | 1.500000<br>2027/01/31 | 0.34 |
| 24 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,921,000 | 95.78<br>752,630,169 | 96.14<br>755,419,464 | 2.250000<br>2024/11/15 | 0.33 |
| 25 | UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 6,000,000 | 93.37<br>743,419,902 | 93.23<br>742,297,260 | 2.750000<br>2029/05/31 | 0.32 |
| 26 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,840,000 | 94.50<br>732,344,760 | 94.79<br>734,607,666 | 2.250000<br>2025/11/15 | 0.32 |
| 27 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,788,000 | 94.82<br>728,312,421 | 95.12<br>730,624,304 | 2.125000<br>2025/05/15 | 0.32 |
| 28 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,743,000 | 94.92<br>723,450,206 | 95.23<br>725,805,083 | 2.000000<br>2025/02/15 | 0.31 |
| 29 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,900,000 | 92.58<br>724,875,740 | 92.70<br>725,799,597 | 2.250000<br>2027/08/15 | 0.31 |
| 30 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,743,000 | 94.17<br>717,704,002 | 94.45<br>719,822,629 | 2.000000<br>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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類     | 地域 | 資産名                          | 買建/<br>売建 | 数量         | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|--------|----|------------------------------|-----------|------------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | オフショア人民元買/円<br>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<br>月          | 買建        | 3,688,000  | 497,156,435 | 488,599,147 | 0.21%    |
|        |    | 英ポンド買/円売 2023年<br>1月         | 買建        | 120,000    | 19,350,840  | 19,173,600  | 0.01%    |
|        |    | シンガポール・ドル買/<br>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<br>月          | 買建        | 3,513,000  | 501,826,865 | 496,572,733 | 0.21%    |
|        |    | カナダ・ドル買/円売<br>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<br>2023年1月       | 買建        | 9,528,000  | 67,791,720  | 64,639,857  | 0.03%    |
|        |    | マレーシア・リングgit<br>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

## ●ダイワ・ライフ・バランス50

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  | 21,077円 |
| 純資産総額 | 212億円   |



| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1か月間     | -3.6%  |
| 3か月間     | -0.4%  |
| 6か月間     | -1.1%  |
| 1年間      | -4.4%  |
| 3年間      | 12.1%  |
| 5年間      | 16.5%  |
| 設定来      | 110.8% |

※上記の「基準価額の騰落率」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6期   | 第7期   | 第8期   | 第9期   | 第10期  | 第11期  | 第12期  | 第13期  | 第14期  | 第15期  | 第16期  | 第17期  |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
|     | 11年6月 | 12年6月 | 13年6月 | 14年6月 | 15年6月 | 16年6月 | 17年6月 | 18年6月 | 19年6月 | 20年6月 | 21年6月 | 22年6月 |
| 分配金 | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率    | 通貨別構成       | 比率     | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位銘柄(除く債券)        | 国・地域名 | 比率   |
|-------------|-------|-------|-------------|--------|--------------|---------------------|-------|------|
| 国内債券        | 288   | 40.0% | 日本円         | 70.3%  | 直接利回り(%)     | トヨタ自動車              | 日本    | 1.1% |
| 国内株式・先物     | 2,148 | 29.7% | 米ドル         | 19.4%  | 最終利回り(%)     | S&P500 EMINI MAR 23 | アメリカ  | 0.8% |
| 外国株式・先物     | 1,214 | 19.4% | ユーロ         | 5.3%   | 修正デュレーション    | APPLE INC           | アメリカ  | 0.8% |
| 外国債券        | 927   | 9.7%  | 英ポンド        | 1.4%   | 残存年数         | TOPIX先物 0503月       | 日本    | 0.8% |
| 外国リート       | 58    | 0.4%  | カナダ・ドル      | 0.9%   | 債券格付別構成      | ソニーグループ             | 日本    | 0.8% |
| 外国投資証券      | 5     | 0.0%  | 豪ドル         | 0.6%   | AAA          | MICROSOFT CORP      | アメリカ  | 0.7% |
|             |       |       | スイス・フラン     | 0.6%   | AA           | 三菱UFJフィナンシャルG       | 日本    | 0.6% |
|             |       |       | オフショア人民元    | 0.4%   | A            | キーエンス               | 日本    | 0.5% |
|             |       |       | スウェーデン・クローネ | 0.2%   | BBB          | 日本電信電話              | 日本    | 0.5% |
| コール・ローン、その他 | 2.9%  |       | その他         | 0.9%   | BB以下・無格付     | 三井住友フィナンシャルG        | 日本    | 0.4% |
| 合計          | 4,640 | -     | 合計          | 100.0% | 合計           | 合計                  |       | 7.0% |

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.7%保有しております。

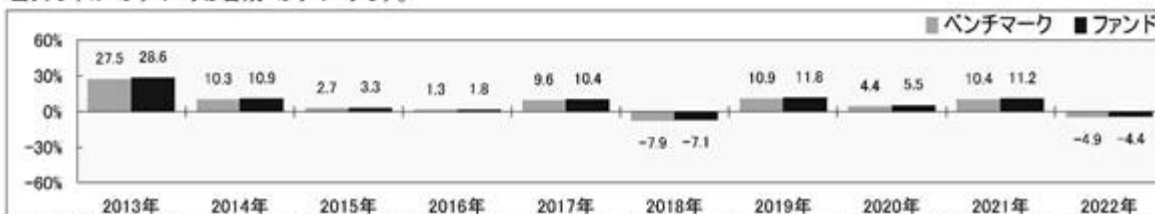
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

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

#### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（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うる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)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。

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

## (5)【その他】

信託の終了

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

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 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られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金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てします。)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てします。)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17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】

ダイワ・ライフ・バランス50

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第16期<br>2021年6月7日現在 | 第17期<br>2022年6月6日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 97,391,841          | 122,846,278         |
| 親投資信託受益証券       | 16,627,989,510      | 20,224,720,968      |
| 未収入金            | 40,212,000          | 5,590,000           |
| 流動資産合計          | 16,765,593,351      | 20,353,157,246      |
| 資産合計            | 16,765,593,351      | 20,353,157,246      |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 53,960,896          | 25,871,969          |
| 未払受託者報酬         | 2,560,047           | 3,195,762           |
| 未払委託者報酬         | 14,507,061          | 18,109,580          |
| その他未払費用         | 646,432             | 798,858             |
| 流動負債合計          | 71,674,436          | 47,976,169          |
| 負債合計            | 71,674,436          | 47,976,169          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 17,872,025,398      | 19,354,402,028      |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 8,821,893,517       | 10,950,779,049      |
| （分配準備積立金）       | 3,751,499,916       | 3,797,658,625       |
| 元本等合計           | 16,693,918,915      | 20,305,181,077      |
| 純資産合計           | 16,693,918,915      | 20,305,181,077      |
| 負債純資産合計         | 16,765,593,351      | 20,353,157,246      |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第16期<br>自 2020年6月6日<br>至 2021年6月7日 | 第17期<br>自 2021年6月8日<br>至 2022年6月6日 |
|-------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 営業収益                    |                                    |                                    |
| 受取利息                    | 201                                | 12                                 |
| 有価証券売買等損益               | 2,034,018,177                      | 447,501,458                        |
| その他収益                   | -                                  | 194                                |
| 営業収益合計                  | 2,034,018,378                      | 447,501,664                        |
| 営業費用                    |                                    |                                    |
| 支払利息                    | 20,985                             | 21,987                             |
| 受託者報酬                   | 4,771,456                          | 6,122,367                          |
| 委託者報酬                   | 27,038,618                         | 34,693,963                         |
| その他費用                   | 1,193,061                          | 1,530,428                          |
| 営業費用合計                  | 33,024,120                         | 42,368,745                         |
| 営業利益                    | 2,000,994,258                      | 405,132,919                        |
| 経常利益                    | 2,000,994,258                      | 405,132,919                        |
| 当期純利益                   | 2,000,994,258                      | 405,132,919                        |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      | 85,511,101                         | 24,610,569                         |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         | 5,805,967,819                      | 8,821,893,517                      |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          | 1,770,512,722                      | 2,650,945,256                      |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,770,512,722                      | 2,650,945,256                      |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          | 670,070,181                        | 902,582,074                        |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 670,070,181                        | 902,582,074                        |
| 分配金                     | 1 -                                | 1 -                                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         | 8,821,893,517                      | 10,950,779,049                     |

## (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17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<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br><br>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16期           | 第17期           |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2021年6月7日現在    | 2022年6月6日現在    |
| 1. 1 期首元本額          | 6,817,684,606円 | 7,872,025,398円 |
| 期中追加設定元本額           | 1,834,830,742円 | 2,284,315,140円 |
| 期中一部解約元本額           | 780,489,950円   | 801,938,510円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 7,872,025,398口 | 9,354,402,028口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第16期                       | 第17期                       |
|-----|----------------------------|----------------------------|
|     | 自 2020年6月6日<br>至 2021年6月7日 | 自 2021年6月8日<br>至 2022年6月6日 |

|                   |   |   |
|-------------------|---|---|
| <p>1 分配金の計算過程</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,915,479,622円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,955,337,713円)及び分配準備積立金(1,836,020,294円)より分配可能額は10,706,837,629円(1万口当たり13,601.12円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(380,525,168円)、投資信託約款に規定される収益調整金(9,305,886,361円)及び分配準備積立金(3,417,133,457円)より分配可能額は13,103,544,986円(1万口当たり14,007.89円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。</p> |
|-------------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 第17期<br>自 2021年6月8日<br>至 2022年6月6日  |
|-------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | <p>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。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分             | 第17期<br>2022年6月6日現在   |
|-----------------|---|
|                 | 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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16期<br>2021年6月7日現在      | 第17期<br>2022年6月6日現在      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 1,984,124,034            | 425,874,691              |
| 合計        | 1,984,124,034            | 425,874,691              |

## (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16期<br>2021年6月7日現在 | 第17期<br>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17期<br>自 2021年6月8日<br>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16期<br>2021年6月7日現在  | 第17期<br>2022年6月6日現在  |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 2,1207円<br>(21,207円) | 2,1707円<br>(21,707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<br>(円)     | 備考 |
|--------------|-------------------------------|---------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | トピックス・インデックス・マザーファンド          | 4,563,690,746 | 6,114,432,861  |    |
|              | 外国株式インデックスマザーファンド             | 988,869,306   | 4,163,930,873  |    |
|              | 外国債券インデックスマザーファンド             | 638,155,597   | 2,009,679,606  |    |
|              | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I ) | 6,276,037,979 | 7,936,677,628  |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                               |               | 20,224,720,968 |    |
| 合計           |                               |               | 20,224,720,968 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況



以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

|                 | 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<br>至 2022年6月6日   |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>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。<br/>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>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。<br/>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>  |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | <p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>  |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分       | 2021年6月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<br>ファンド                     | 3,020,415,388円  | 2,962,705,495円  |
| ダイワ・トピックス・イン<br>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<br>ワ・トピックスインデックス<br>ファンドVA2 | 927,435円        | 920,931円        |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)     | 25,923,401円     | 23,273,435円     |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)     | 521,906,795円    | 330,149,007円    |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)     | 26,728,376円     | 21,795,176円     |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)     | 761,667,628円    | 647,820,107円    |
| 日本株式インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用) | 170,445,291円    | 348,599,985円    |
| D-I's TOPIXイン<br>デックス                    | 31,727,729円     | 32,296,608円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                   | 78,025,372円     | 196,172,434円    |
| iFree TOPIXイン<br>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<br>クス                      | 65,387,758,940円 | 68,666,878,875円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                       | 2,833,165,324円  | 3,242,640,964円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                       | 3,784,745,264円  | 4,563,690,746円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                       | 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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 2021年6月8日<br>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。<br>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。<br>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。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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) |
| 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<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|              | (円)           | うち<br>1年超 |               |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引         |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 株価指数<br>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  |       |          |
| ピ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GP | 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 |       |          |
| 飛鳥建設          | 5,900   | 1,009.00 | 5,953,100   |       |          |
| 長谷工コーポレーション   | 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     |
| 銭高組           | 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 |
| 浅沼組        | 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 ネットズエスアイ | 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   |              |
| 大気社          | 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  |              |
| ニッポン         | 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・ケイホールディング | 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  |               |
| 総合警備保障        | 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  |
| プラス           | 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D Y H L D G S    | 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<br>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  |               |
| W D B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    |
| C D G               | 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<br>ン   | 160,400 | 4,442.00 | 712,496,800 | 貸付株式数 63,600株 |
| キリンH D              | 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J<br>H D | 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H D         | 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<br>(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・ヴィ・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             |
| J P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             |
| 東京エレクトロニクスデバイス | 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<br>(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 - ス     | 2,800   | 1,827.00 | 5,115,600   | 貸付株式数 | 1,100株             |
| キューピー          | 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<br>(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<br>(100株) |
| ジンスホールディングス    | 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          |
| D C M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             |
| D D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           |
| Z O Z O        | 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<br>(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<br>1,900株<br>(1,500株) |
| すかいらーくHD           | 91,000  | 1,607.00  | 146,237,000 | 貸付株式数<br>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<br>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<br>1,400株             |
| 日本毛織               | 19,300  | 959.00    | 18,508,700  | 貸付株式数<br>8,000株             |
| ダイトウボウ             | 10,000  | 92.00     | 920,000     | 貸付株式数<br>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<br>500株               |
| ダイドーリミテッド          | 7,700   | 139.00    | 1,070,300   | 貸付株式数<br>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<br>500株               |
| ユナイテッド・スーパー<br>マーケ | 21,100  | 1,067.00  | 22,513,700  | 貸付株式数<br>8,200株             |
| 三栄建築設計             | 2,900   | 1,657.00  | 4,805,300   |                             |
| 野村不動産HLDS          | 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<br>5,300株             |
| サムティ               | 10,400  | 2,036.00  | 21,174,400  | 貸付株式数<br>3,700株             |
| 地主                 | 4,600   | 2,140.00  | 9,844,000   | 貸付株式数<br>1,800株             |
| プレサンスコーポレーショ<br>ン  | 8,600   | 1,504.00  | 12,934,400  | 貸付株式数<br>900株               |
| フィル・カンパニー          | 1,300   | 1,203.00  | 1,563,900   | 貸付株式数<br>400株               |
| ハウスコム              | 900     | 1,070.00  | 963,000     | 貸付株式数<br>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<br>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<br>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<br>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<br>1,500株             |
| ミタチ産業              | 1,700   | 929.00    | 1,579,300   | 貸付株式数<br>600株               |
| B E E N O S        | 3,700   | 1,904.00  | 7,044,800   | 貸付株式数<br>1,400株             |
| あさひ                | 6,400   | 1,316.00  | 8,422,400   | 貸付株式数<br>2,200株             |
| 日本調剤               | 4,500   | 1,282.00  | 5,769,000   | 貸付株式数<br>200株               |
| コスモス薬品             | 7,400   | 12,000.00 | 88,800,000  | 貸付株式数<br>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<br>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<br>15,900株<br>(1,600株) |
| 明治電機工業           | 3,000   | 1,113.00 | 3,339,000     | 貸付株式数<br>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<br>4,900株              |
| デリカフーズHLDGS      | 3,000   | 528.00   | 1,584,000     | 貸付株式数<br>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<br>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<br>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<br>6,800株<br>(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<br>2,700株              |
| 稲葉製作所            | 3,800   | 1,325.00 | 5,035,000     | 貸付株式数<br>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<br>1,000株              |
| SUMCO            | 118,900 | 2,124.00 | 252,543,600   | 貸付株式数<br>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<br>200株<br>(200株)      |
| AND DOホールディングス   | 3,600   | 925.00   | 3,330,000     | 貸付株式数<br>1,400株              |
| シーアールイー          | 2,500   | 1,654.00 | 4,135,000     | 貸付株式数<br>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<br>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<br>400株                |
| ジェイ・エス・ビー        | 1,500   | 3,530.00 | 5,295,000     | 貸付株式数<br>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   |
| グローバルリンクマネジメン<br>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   |
| 日本フェルト               | 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<br>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   |
| パロックジャパン             | 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 CO<br>MPAN | 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ベパボ              | 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   |       |                    |
| ポルトゥウィンホール<br>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<br>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<br>(100株)   |
| エンカレッジ・テクノロジー       | 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 HOLDING<br>GS | 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<br>(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<br>(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             |

|                     |        |          |            |       |        |
|---------------------|--------|----------|------------|-------|--------|
| g u m i             | 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  |       |        |
| P C I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   |
| アイピーシー              | 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   |
| P R T I M E S       | 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   |
| U B I C O M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   |
| 東亜合成         | 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 - 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 - カライジング | 32,600  | 916.00    | 29,861,600    |       |        |
| 高压ガス         | 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 |               |
| J S R           | 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H L D G S | 464,600 | 783.60   | 364,060,560 |               |
| K H 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 - 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  |               |
| U B E           | 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  |
| C L 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   |                           |
| T A C           | 2,300  | 228.00   | 524,400     |                           |
| C E 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                |
| びあ              | 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<br>(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<br>(700株)      |
| ラクスル            | 8,500  | 2,141.00 | 18,198,500  | 貸付株式数 3,100株              |
| I P S           | 2,000  | 2,417.00 | 4,834,000   | 貸付株式数 700株                |
| F I G           | 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              |
| A D E K A       | 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   |
| ギフトィ            | 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    |                        |
| J C R 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    |                        |
| D I C           | 27,800  | 2,538.00  | 70,556,400    | 貸付株式数 11,000株          |
| サカティンクス         | 14,300  | 937.00    | 13,399,100    | 貸付株式数 5,300株           |
| 東洋インキSCホールディングン | 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<br>(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ン  | 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ションズ | 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グループ | 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     |
| 電通国際情報サービス     | 9,600     | 4,170.00  | 40,032,000  | 貸付株式数 | 3,800株   |

|                    |         |           |             |       |                |
|--------------------|---------|-----------|-------------|-------|----------------|
| A C C E S S        | 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           |
| C I J              | 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<br>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<br>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<br>(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    |              |
| J C U             | 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   |
| O A T 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     |              |
| M O R E S C O     | 2,600     | 1,271.00 | 3,304,600     |              |
| 出光興産              | 78,200    | 3,800.00 | 297,160,000   |              |
| E N E O S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    |              |
| T O Y O T I R E   | 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   |
| A G C             | 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<br>(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             |
| 日本ヒュ-ム       | 6,000   | 696.00    | 4,176,000   |       |                  |
| 日本コンクリ-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   |
| 日本鑄鉄管        | 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   |
| U A C J      | 10,500  | 2,311.00 | 24,265,500  |       |        |
| C K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 -     | 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 -     | 1,600   | 640.00   | 1,024,000   |       |        |
| LIXIL        | 116,100 | 2,474.00 | 287,231,400 |       |        |
| 日本ファイルコン     | 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    |       |                    |
| K e e P e r 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               |
| G u n o s y      | 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<br>(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             |
| I B J            | 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             |
| E R I 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<br>(300株)     |
| シグマクシス・ホールディング   | 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   |                          |
| F U J I       | 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  |                          |
| D M G 森精機     | 41,400  | 1,928.00  | 79,819,200  |                          |
| ソデイツク         | 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   |                          |
| 富士ダイス         | 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<br>(1,800株) |
| S M N         | 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             |
| O K K         | 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    |                        |
| N C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     |                        |
| フリーー           | 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<br>(900株) |
| タツモ            | 3,300   | 1,272.00  | 4,197,600     | 貸付株式数 100株             |
| ナプテスコ          | 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             |
| S M C          | 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           |
| 日精エーエスピー       | 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             |
| T O W A        | 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    |
| 西島製作所        | 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 - ヨ - 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  |
| C K D        | 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   |               |
| NTN           | 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    |               |
| THK           | 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-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 HOLDINGS | 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<br>(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 - P E X       | 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             |
| I D E C         | 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ック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           |
| E I Z O         | 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 ホールディング      | 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 .<br>ジー . | 4,300   | 3,425.00  | 14,727,500    | 貸付株式数 700株    |
| フオスタ - 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<br>(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    |                      |
| K O A               | 10,600  | 1,772.00  | 18,783,200    | 貸付株式数 500株<br>(500株) |
| 三井E & S H D         | 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   |                      |
| I H I               | 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<br>(100株) |
| A N D F A C T O R Y | 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               |
| 日本車輛             | 2,300     | 2,079.00 | 4,781,700     |       |                    |
| 三菱ロジスネクスト        | 9,800     | 870.00   | 8,526,000     |       |                    |
| 近畿車輛             | 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               |
| F P G            | 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<br>(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<br>(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             |
| C a s a          | 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     |       |          |
| G M B        | 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     |       |          |
| K Y B        | 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 ッ 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   |       |          |
| S U B A R U  | 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   |       |          |
| T B K        | 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           |
| ダイレクトマーケティングミクス | 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<br>(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  |                        |
| 佐島電機            | 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<br>(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              |
| ユニテッドアローズ        | 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<br>(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<br>(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              |

|                          |         |           |               |                        |
|--------------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| S C R E E Nホールディング<br>ガス | 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           |
| H O Y A                  | 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<br>ガス    | 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<br>(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           |
| 前田工織                     | 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           |
| S H O E I                | 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<br>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<br>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           |
| N I S S H A      | 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   |       |                |
| ビジョン             | 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<br>(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    |               |
| 立川プラインド       | 2,900   | 1,090.00  | 3,161,000     | 貸付株式数 1,000株  |
| グロープライド       | 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   |       |         |
| B I P R O G Y      | 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J<br>PN | 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  |
| G S I 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-ルドウイン            | 12,400  | 8,260.00 | 102,424,000   |       |         |
| ユニ・チャ-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-ナショナル       | 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  |              |
| 立花エレクトック         | 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 |
| S R S 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 |
| Mr Max HD        | 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 |
| A O K I 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<br>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     |
| フォーバル               | 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<br>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<br>(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<br>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<br>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<br>(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ユニテッド海運         | 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 DRUG STORES | 3,200   | 3,390.00  | 10,848,000  | 貸付株式数 | 1,200株  |
| コア商事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   |
| キュ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HLD S      | 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J S A T H D | 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йдママーケティングコ<br>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<br>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<br>(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  |       |        |
| メイテック            | 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グ      | 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HLD S    | 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 |
| JBC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 |
| パ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      |       |        |
| サクスパーホールディング | 7,100   | 592.00    | 4,203,200       | 貸付株式数 | 2,400株 |
| ゲ            |         |           |                 |       |        |
| 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 |
| ペルーナ         | 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せん。

|              |         |               |          |
|--------------|---------|---------------|----------|
| 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。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

|         | 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 | 136,508,839    | 177,904,644    |
| 国債証券    | 27,289,808,440 | 35,229,597,110 |
| 地方債証券   | 1,656,998,200  | 1,551,709,500  |
| 特殊債証券   | 729,845,600    | 728,556,800    |
| 社債証券    | 927,264,900    | 1,309,558,300  |
| 未収利息    | 60,543,882     | 71,218,476     |
| 前払費用    | 3,091,011      | 2,314,767      |
| 流動資産合計  | 30,804,060,872 | 39,070,859,597 |
| 資産合計    | 30,804,060,872 | 39,070,859,597 |
| 負債の部    |                |                |
| 流動負債    |                |                |
| 未払解約金   | 610,663        | 6,213,295      |

|                 |   |                |                |
|-----------------|---|----------------|----------------|
| 流動負債合計          |   | 610,663        | 6,213,295      |
| 負債合計            |   | 610,663        | 6,213,295      |
| 純資産の部           |   |                |                |
| 元本等             |   |                |                |
| 元本              | 1 | 23,909,728,537 | 30,891,408,853 |
| 剰余金             |   |                |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） |   | 6,893,721,672  | 8,173,237,449  |
| 元本等合計           |   | 30,803,450,209 | 39,064,646,302 |
| 純資産合計           |   | 30,803,450,209 | 39,064,646,302 |
| 負債純資産合計         |   | 30,804,060,872 | 39,070,859,597 |

## 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<br>至 2022年6月6日   |
|-----------------|--|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分       | 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     | 15,964,638,245円 | 23,909,728,537円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,335,559,013円  | 7,623,028,057円  |
| 期中一部解約元本額 | 390,468,721円    | 641,347,741円    |
| 期末元本額の内訳  |                 |                 |
| ファンド名     |                 |                 |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| 日本債券インデックスファン<br>ド(F0Fs用)(適格機関投資<br>家専用) | 512,193,102円    | 1,062,564,538円  |
| iFree 日本債券イン<br>デックス                     | 2,400,673,245円  | 3,752,378,284円  |
| iFree 8資産バランス<br>ダイワ・ライフ・バランス3<br>0      | 2,951,095,002円  | 4,043,649,325円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                       | 7,777,518,506円  | 9,160,967,844円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                       | 5,043,351,856円  | 6,276,037,979円  |
| DCダイワ・ワールドアセッ<br>ト(六つの羽/安定コース)           | 1,599,441,219円  | 2,047,426,696円  |
| DCダイワ・ワールドアセッ<br>ト(六つの羽/6分散コー<br>ス)      | 1,276,401,478円  | 1,508,957,237円  |
| DCダイワ・ワールドアセッ<br>ト(六つの羽/成長コース)           | 956,403,243円    | 439,742,656円    |
| ダイワつみたてインデックス<br>日本債券                    | 341,020,878円    | 996,737,189円    |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス30                  | 507,219,192円    | 33,857,772円     |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス50                  | 31,180,661円     | 13,464,116円     |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス70                  | 11,093,047円     | 11,216,859円     |
| ダイワ世界バランスファンド<br>40VA                    | 5,910,207円      | 224,519,255円    |
| ダイワ世界バランスファンド<br>60VA                    | 295,990,826円    | 151,592,380円    |
| 計  | 200,236,075円    | 30,891,408,853円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                         | 23,909,728,537口 | 23,909,728,537口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 2021年6月8日<br>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。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 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<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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  | 143,651,070        | 890,726,460        |
| 地方債証券 | 4,295,300          | 16,542,500         |
| 特殊債券  | 2,437,900          | 6,764,900          |
| 社債券   | 1,511,800          | 16,865,000         |
| 合計    | 151,896,070        | 930,898,860        |

(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

| 2021年6月7日現在 | 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。 |

（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    | 1,2883円     | 1,2646円     |
| （1万口当たり純資産額） | （12,883円）   | （12,646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<br>（円） | 評価額<br>（円）  | 備考 |
|------|------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券 | 4 2 6 2年国債 | 60,000,000  | 60,060,600  |    |
|      | 4 2 7 2年国債 | 90,000,000  | 90,098,100  |    |
|      | 4 2 8 2年国債 | 200,000,000 | 200,234,000 |    |
|      | 4 2 9 2年国債 | 180,000,000 | 180,212,400 |    |
|      | 4 3 0 2年国債 | 250,000,000 | 250,315,000 |    |
|      | 4 3 1 2年国債 | 150,000,000 | 150,199,500 |    |
|      | 4 3 3 2年国債 | 250,000,000 | 250,350,000 |    |
|      | 4 3 5 2年国債 | 30,000,000  | 30,046,200  |    |
|      | 4 3 6 2年国債 | 200,000,000 | 200,304,000 |    |
|      | 1 3 7 5年国債 | 590,000,000 | 591,404,200 |    |
|      | 1 3 8 5年国債 | 560,000,000 | 561,545,600 |    |
|      | 1 3 9 5年国債 | 640,000,000 | 641,996,800 |    |
|      | 1 4 0 5年国債 | 470,000,000 | 471,626,200 |    |
|      | 1 4 1 5年国債 | 550,000,000 | 552,079,000 |    |
|      | 1 4 2 5年国債 | 320,000,000 | 321,340,800 |    |
|      | 1 4 3 5年国債 | 550,000,000 | 552,453,000 |    |
|      | 1 4 4 5年国債 | 530,000,000 | 532,496,300 |    |
|      | 1 4 5 5年国債 | 560,000,000 | 562,760,800 |    |
|      | 1 4 6 5年国債 | 260,000,000 | 261,333,800 |    |
|      | 1 4 7 5年国債 | 406,000,000 | 406,613,060 |    |

|     |       |             |             |
|-----|-------|-------------|-------------|
| 148 | 5年国債  | 380,000,000 | 380,535,800 |
| 149 | 5年国債  | 450,000,000 | 450,576,000 |
| 150 | 5年国債  | 200,000,000 | 200,226,000 |
| 151 | 5年国債  | 360,000,000 | 360,169,200 |
| 1   | 40年国債 | 30,000,000  | 39,876,000  |
| 2   | 40年国債 | 48,000,000  | 61,599,360  |
| 3   | 40年国債 | 19,000,000  | 24,571,560  |
| 4   | 40年国債 | 54,000,000  | 69,968,340  |
| 5   | 40年国債 | 61,000,000  | 76,222,550  |
| 6   | 40年国債 | 40,000,000  | 49,109,200  |
| 7   | 40年国債 | 41,000,000  | 48,270,940  |
| 8   | 40年国債 | 40,000,000  | 43,896,000  |
| 9   | 40年国債 | 40,000,000  | 32,621,200  |
| 10  | 40年国債 | 91,000,000  | 86,967,790  |
| 11  | 40年国債 | 85,000,000  | 78,552,750  |
| 12  | 40年国債 | 99,000,000  | 82,259,100  |
| 13  | 40年国債 | 252,000,000 | 208,305,720 |
| 14  | 40年国債 | 273,000,000 | 241,018,050 |
| 330 | 10年国債 | 81,000,000  | 81,923,400  |
| 331 | 10年国債 | 40,000,000  | 40,353,200  |
| 332 | 10年国債 | 65,000,000  | 65,679,900  |
| 333 | 10年国債 | 83,000,000  | 84,000,150  |
| 334 | 10年国債 | 320,000,000 | 324,368,000 |
| 335 | 10年国債 | 210,000,000 | 212,717,400 |
| 337 | 10年国債 | 300,000,000 | 302,781,000 |
| 338 | 10年国債 | 80,000,000  | 81,025,600  |
| 339 | 10年国債 | 135,000,000 | 136,867,050 |
| 340 | 10年国債 | 190,000,000 | 192,813,900 |
| 341 | 10年国債 | 15,000,000  | 15,183,300  |
| 342 | 10年国債 | 140,000,000 | 140,715,400 |
| 343 | 10年国債 | 270,000,000 | 271,417,500 |
| 344 | 10年国債 | 90,000,000  | 90,482,400  |
| 345 | 10年国債 | 410,000,000 | 412,230,400 |
| 346 | 10年国債 | 250,000,000 | 251,255,000 |
| 347 | 10年国債 | 400,000,000 | 401,808,000 |
| 348 | 10年国債 | 360,000,000 | 361,519,200 |
| 349 | 10年国債 | 380,000,000 | 381,466,800 |
| 350 | 10年国債 | 400,000,000 | 401,268,000 |
| 351 | 10年国債 | 410,000,000 | 410,984,000 |

|     |       |             |             |
|-----|-------|-------------|-------------|
| 352 | 10年国債 | 440,000,000 | 440,686,400 |
| 353 | 10年国債 | 390,000,000 | 390,249,600 |
| 354 | 10年国債 | 350,000,000 | 349,881,000 |
| 355 | 10年国債 | 320,000,000 | 319,440,000 |
| 356 | 10年国債 | 300,000,000 | 299,133,000 |
| 357 | 10年国債 | 320,000,000 | 318,688,000 |
| 358 | 10年国債 | 360,000,000 | 358,063,200 |
| 359 | 10年国債 | 340,000,000 | 337,844,400 |
| 360 | 10年国債 | 350,000,000 | 347,427,500 |
| 361 | 10年国債 | 460,000,000 | 456,136,000 |
| 362 | 10年国債 | 340,000,000 | 336,773,400 |
| 363 | 10年国債 | 330,000,000 | 326,488,800 |
| 364 | 10年国債 | 355,000,000 | 350,960,100 |
| 365 | 10年国債 | 300,000,000 | 296,358,000 |
| 366 | 10年国債 | 340,000,000 | 338,697,800 |
| 2   | 30年国債 | 9,000,000   | 10,538,730  |
| 3   | 30年国債 | 4,000,000   | 4,670,160   |
| 4   | 30年国債 | 8,000,000   | 9,812,160   |
| 5   | 30年国債 | 8,000,000   | 9,406,880   |
| 6   | 30年国債 | 9,000,000   | 10,827,180  |
| 7   | 30年国債 | 12,000,000  | 14,409,360  |
| 10  | 30年国債 | 25,000,000  | 27,103,250  |
| 11  | 30年国債 | 9,000,000   | 10,345,860  |
| 12  | 30年国債 | 11,000,000  | 13,147,310  |
| 13  | 30年国債 | 11,000,000  | 13,048,860  |
| 14  | 30年国債 | 22,000,000  | 27,149,760  |
| 15  | 30年国債 | 21,000,000  | 26,229,420  |
| 16  | 30年国債 | 26,000,000  | 32,547,060  |
| 17  | 30年国債 | 17,000,000  | 21,134,570  |
| 18  | 30年国債 | 20,000,000  | 24,666,400  |
| 19  | 30年国債 | 15,000,000  | 18,542,400  |
| 20  | 30年国債 | 16,000,000  | 20,226,560  |
| 21  | 30年国債 | 16,000,000  | 19,852,800  |
| 22  | 30年国債 | 17,000,000  | 21,593,060  |
| 23  | 30年国債 | 16,000,000  | 20,370,400  |
| 24  | 30年国債 | 15,000,000  | 19,140,750  |
| 25  | 30年国債 | 17,000,000  | 21,262,070  |
| 26  | 30年国債 | 32,000,000  | 40,536,960  |
| 27  | 30年国債 | 32,000,000  | 41,147,520  |



|    |       |             |             |
|----|-------|-------------|-------------|
| 28 | 30年国債 | 34,000,000  | 43,883,460  |
| 29 | 30年国債 | 43,000,000  | 54,973,350  |
| 30 | 30年国債 | 56,000,000  | 70,894,320  |
| 31 | 30年国債 | 76,000,000  | 95,120,080  |
| 32 | 30年国債 | 45,000,000  | 57,200,850  |
| 33 | 30年国債 | 95,000,000  | 116,056,750 |
| 34 | 30年国債 | 110,000,000 | 138,309,600 |
| 35 | 30年国債 | 120,000,000 | 146,883,600 |
| 36 | 30年国債 | 138,000,000 | 169,468,140 |
| 37 | 30年国債 | 155,000,000 | 187,542,250 |
| 38 | 30年国債 | 85,000,000  | 101,320,850 |
| 39 | 30年国債 | 88,000,000  | 106,677,120 |
| 40 | 30年国債 | 70,000,000  | 83,491,800  |
| 41 | 30年国債 | 80,000,000  | 93,830,400  |
| 42 | 30年国債 | 73,000,000  | 85,664,040  |
| 43 | 30年国債 | 95,000,000  | 111,434,050 |
| 44 | 30年国債 | 75,000,000  | 88,017,000  |
| 45 | 30年国債 | 80,000,000  | 90,605,600  |
| 46 | 30年国債 | 90,000,000  | 101,943,900 |
| 47 | 30年国債 | 105,000,000 | 121,102,800 |
| 48 | 30年国債 | 110,000,000 | 122,235,300 |
| 49 | 30年国債 | 120,000,000 | 133,336,800 |
| 50 | 30年国債 | 100,000,000 | 98,137,000  |
| 51 | 30年国債 | 105,000,000 | 91,554,750  |
| 52 | 30年国債 | 102,000,000 | 93,033,180  |
| 53 | 30年国債 | 95,000,000  | 88,559,000  |
| 54 | 30年国債 | 100,000,000 | 97,381,000  |
| 55 | 30年国債 | 96,000,000  | 93,275,520  |
| 56 | 30年国債 | 100,000,000 | 96,941,000  |
| 57 | 30年国債 | 105,000,000 | 101,553,900 |
| 58 | 30年国債 | 140,000,000 | 135,090,200 |
| 59 | 30年国債 | 97,000,000  | 91,176,120  |
| 60 | 30年国債 | 80,000,000  | 78,661,600  |
| 61 | 30年国債 | 70,000,000  | 65,389,800  |
| 62 | 30年国債 | 82,000,000  | 72,571,640  |
| 63 | 30年国債 | 110,000,000 | 94,545,000  |
| 64 | 30年国債 | 90,000,000  | 77,182,200  |
| 65 | 30年国債 | 76,000,000  | 65,238,400  |
| 66 | 30年国債 | 115,000,000 | 98,603,300  |

|     |       |             |             |
|-----|-------|-------------|-------------|
| 67  | 30年国債 | 140,000,000 | 126,217,000 |
| 68  | 30年国債 | 96,000,000  | 86,389,440  |
| 69  | 30年国債 | 106,000,000 | 97,960,960  |
| 70  | 30年国債 | 166,000,000 | 153,156,580 |
| 71  | 30年国債 | 66,000,000  | 60,791,940  |
| 72  | 30年国債 | 203,000,000 | 186,875,710 |
| 73  | 30年国債 | 120,000,000 | 110,406,000 |
| 74  | 30年国債 | 155,000,000 | 153,939,800 |
| 64  | 20年国債 | 35,000,000  | 35,895,300  |
| 65  | 20年国債 | 42,000,000  | 43,279,320  |
| 66  | 20年国債 | 30,000,000  | 30,867,900  |
| 67  | 20年国債 | 19,000,000  | 19,670,130  |
| 68  | 20年国債 | 25,000,000  | 26,015,750  |
| 69  | 20年国債 | 12,000,000  | 12,466,080  |
| 70  | 20年国債 | 18,000,000  | 18,906,300  |
| 71  | 20年国債 | 17,000,000  | 17,786,590  |
| 72  | 20年国債 | 53,000,000  | 55,628,800  |
| 75  | 20年国債 | 14,000,000  | 14,843,080  |
| 76  | 20年国債 | 25,000,000  | 26,366,000  |
| 78  | 20年国債 | 17,000,000  | 18,010,480  |
| 79  | 20年国債 | 14,000,000  | 14,874,720  |
| 81  | 20年国債 | 65,000,000  | 69,387,500  |
| 82  | 20年国債 | 28,000,000  | 29,982,400  |
| 85  | 20年国債 | 31,000,000  | 33,507,280  |
| 86  | 20年国債 | 6,000,000   | 6,530,760   |
| 87  | 20年国債 | 35,000,000  | 37,963,450  |
| 88  | 20年国債 | 33,000,000  | 36,106,620  |
| 89  | 20年国債 | 15,000,000  | 16,351,500  |
| 92  | 20年国債 | 60,000,000  | 65,776,200  |
| 93  | 20年国債 | 18,000,000  | 19,726,740  |
| 94  | 20年国債 | 45,000,000  | 49,531,950  |
| 95  | 20年国債 | 30,000,000  | 33,457,500  |
| 96  | 20年国債 | 63,000,000  | 69,626,970  |
| 97  | 20年国債 | 25,000,000  | 27,878,500  |
| 98  | 20年国債 | 64,000,000  | 71,031,040  |
| 99  | 20年国債 | 53,000,000  | 59,064,260  |
| 100 | 20年国債 | 35,000,000  | 39,350,850  |
| 101 | 20年国債 | 18,000,000  | 20,445,120  |
| 102 | 20年国債 | 10,000,000  | 11,410,600  |

|     |       |             |             |  |
|-----|-------|-------------|-------------|--|
| 103 | 20年国債 | 21,000,000  | 23,836,050  |  |
| 104 | 20年国債 | 64,000,000  | 71,872,640  |  |
| 105 | 20年国債 | 38,000,000  | 42,829,040  |  |
| 106 | 20年国債 | 16,000,000  | 18,133,440  |  |
| 107 | 20年国債 | 40,000,000  | 45,239,600  |  |
| 108 | 20年国債 | 68,000,000  | 76,023,320  |  |
| 109 | 20年国債 | 60,000,000  | 67,276,800  |  |
| 110 | 20年国債 | 27,000,000  | 30,638,250  |  |
| 111 | 20年国債 | 35,000,000  | 40,078,850  |  |
| 112 | 20年国債 | 40,000,000  | 45,525,200  |  |
| 113 | 20年国債 | 70,000,000  | 79,954,700  |  |
| 114 | 20年国債 | 45,000,000  | 51,558,750  |  |
| 115 | 20年国債 | 42,000,000  | 48,434,820  |  |
| 116 | 20年国債 | 27,000,000  | 31,246,290  |  |
| 117 | 20年国債 | 77,000,000  | 88,517,660  |  |
| 118 | 20年国債 | 13,000,000  | 14,885,910  |  |
| 119 | 20年国債 | 23,000,000  | 25,971,830  |  |
| 120 | 20年国債 | 98,000,000  | 109,109,280 |  |
| 123 | 20年国債 | 42,000,000  | 48,759,480  |  |
| 124 | 20年国債 | 100,000,000 | 115,253,000 |  |
| 125 | 20年国債 | 25,000,000  | 29,328,500  |  |
| 126 | 20年国債 | 21,000,000  | 24,273,270  |  |
| 127 | 20年国債 | 110,000,000 | 126,195,300 |  |
| 128 | 20年国債 | 32,000,000  | 36,811,520  |  |
| 129 | 20年国債 | 95,000,000  | 108,441,550 |  |
| 130 | 20年国債 | 28,000,000  | 32,055,520  |  |
| 131 | 20年国債 | 150,000,000 | 170,359,500 |  |
| 132 | 20年国債 | 25,000,000  | 28,456,000  |  |
| 133 | 20年国債 | 150,000,000 | 172,137,000 |  |
| 134 | 20年国債 | 15,000,000  | 17,253,300  |  |
| 135 | 20年国債 | 20,000,000  | 22,813,000  |  |
| 136 | 20年国債 | 180,000,000 | 203,594,400 |  |
| 137 | 20年国債 | 18,000,000  | 20,565,180  |  |
| 139 | 20年国債 | 205,000,000 | 232,205,550 |  |
| 140 | 20年国債 | 65,000,000  | 74,415,250  |  |
| 141 | 20年国債 | 48,000,000  | 55,004,160  |  |
| 142 | 20年国債 | 165,000,000 | 190,766,400 |  |
| 143 | 20年国債 | 100,000,000 | 113,698,000 |  |
| 144 | 20年国債 | 130,000,000 | 146,447,600 |  |

|         |           |             |                |  |
|---------|-----------|-------------|----------------|--|
| 145     | 20年国債     | 190,000,000 | 218,412,600    |  |
| 146     | 20年国債     | 190,000,000 | 218,682,400    |  |
| 147     | 20年国債     | 195,000,000 | 222,522,300    |  |
| 148     | 20年国債     | 175,000,000 | 197,886,500    |  |
| 149     | 20年国債     | 195,000,000 | 220,642,500    |  |
| 150     | 20年国債     | 225,000,000 | 252,090,000    |  |
| 151     | 20年国債     | 230,000,000 | 252,266,300    |  |
| 152     | 20年国債     | 200,000,000 | 219,324,000    |  |
| 153     | 20年国債     | 225,000,000 | 249,624,000    |  |
| 154     | 20年国債     | 205,000,000 | 224,839,900    |  |
| 155     | 20年国債     | 190,000,000 | 203,463,400    |  |
| 156     | 20年国債     | 172,000,000 | 170,329,880    |  |
| 157     | 20年国債     | 196,000,000 | 188,410,880    |  |
| 158     | 20年国債     | 205,000,000 | 205,135,300    |  |
| 159     | 20年国債     | 220,000,000 | 222,829,200    |  |
| 160     | 20年国債     | 170,000,000 | 174,319,700    |  |
| 161     | 20年国債     | 135,000,000 | 136,314,900    |  |
| 162     | 20年国債     | 175,000,000 | 176,358,000    |  |
| 163     | 20年国債     | 160,000,000 | 160,913,600    |  |
| 164     | 20年国債     | 230,000,000 | 227,502,200    |  |
| 165     | 20年国債     | 155,000,000 | 152,955,550    |  |
| 166     | 20年国債     | 200,000,000 | 203,118,000    |  |
| 167     | 20年国債     | 125,000,000 | 122,750,000    |  |
| 168     | 20年国債     | 185,000,000 | 178,269,700    |  |
| 169     | 20年国債     | 135,000,000 | 127,557,450    |  |
| 170     | 20年国債     | 150,000,000 | 141,291,000    |  |
| 171     | 20年国債     | 130,000,000 | 122,067,400    |  |
| 172     | 20年国債     | 215,000,000 | 204,959,500    |  |
| 173     | 20年国債     | 165,000,000 | 156,820,950    |  |
| 174     | 20年国債     | 195,000,000 | 184,766,400    |  |
| 175     | 20年国債     | 145,000,000 | 139,553,800    |  |
| 176     | 20年国債     | 150,000,000 | 143,943,000    |  |
| 177     | 20年国債     | 180,000,000 | 169,223,400    |  |
| 178     | 20年国債     | 170,000,000 | 162,426,500    |  |
| 179     | 20年国債     | 150,000,000 | 143,121,000    |  |
| 180     | 20年国債     | 80,000,000  | 80,619,200     |  |
| 1       | フィリピン共和国  | 100,000,000 | 100,346,800    |  |
| 国債証券 合計 |           |             | 35,229,597,110 |  |
| 地方債証券   | 751 東京都公債 | 100,000,000 | 101,029,900    |  |

|       |                   |             |                |  |
|-------|-------------------|-------------|----------------|--|
|       | 2 7 - 1 5 北海道公債   | 100,000,000 | 100,479,000    |  |
|       | 3 - 5 北海道公債       | 100,000,000 | 98,297,200     |  |
|       | 2 2 2 神奈川県公債      | 100,000,000 | 99,863,700     |  |
|       | 4 0 1 大阪府公債       | 100,000,000 | 101,328,500    |  |
|       | 3 兵庫県公債 1 2 年     | 100,000,000 | 101,377,000    |  |
|       | 1 1 兵庫県公債 2 0 年   | 100,000,000 | 112,191,100    |  |
|       | 2 8 - 1 静岡県公債     | 100,000,000 | 99,973,600     |  |
|       | 9 埼玉県 2 0 年       | 100,000,000 | 114,523,900    |  |
|       | 2 2 - 1 福岡県 1 5 年 | 100,000,000 | 105,503,000    |  |
|       | 2 9 - 6 千葉県公債     | 100,000,000 | 100,514,200    |  |
|       | 1 6 8 共同発行地方      | 100,000,000 | 100,518,200    |  |
|       | 2 7 - 1 滋賀県公債     | 100,000,000 | 101,382,800    |  |
|       | 2 5 - 6 大阪市公債     | 100,000,000 | 100,948,100    |  |
|       | 1 1 名古屋市 2 0 年    | 100,000,000 | 113,779,300    |  |
| 地方債証券 | 合計                |             | 1,551,709,500  |  |
| 特殊債券  | 4 7 日本政策投資 C O    | 100,000,000 | 105,201,700    |  |
|       | 8 1 政保道路機構        | 100,000,000 | 113,405,400    |  |
|       | 2 4 1 政保道路機構      | 100,000,000 | 101,291,900    |  |
|       | 2 6 1 政保道路機構      | 100,000,000 | 101,321,400    |  |
|       | 6 5 地方公共団体        | 100,000,000 | 101,138,100    |  |
|       | 1 2 7 都市再生        | 100,000,000 | 99,850,300     |  |
|       | 8 0 住宅支援機構        | 100,000,000 | 106,348,000    |  |
| 特殊債券  | 合計                |             | 728,556,800    |  |
| 社債券   | 2 0 成田国際空港        | 100,000,000 | 99,926,300     |  |
|       | 2 5 西日本高速道        | 100,000,000 | 101,138,100    |  |
|       | 1 4 セブンアンドアイ      | 100,000,000 | 99,982,400     |  |
|       | 1 8 楽天グループ        | 100,000,000 | 96,542,200     |  |
|       | 1 7 パナソニック        | 100,000,000 | 100,838,200    |  |
|       | 6 楽天カード           | 100,000,000 | 98,592,800     |  |
|       | 5 N T Tファイナンス     | 100,000,000 | 99,203,600     |  |
|       | 7 三井住友海上          | 100,000,000 | 99,618,900     |  |
|       | 8 0 三菱地所          | 100,000,000 | 109,937,500    |  |
|       | 3 2 東日本旅客鉄道       | 100,000,000 | 103,864,300    |  |
|       | 9 ソフトバンク          | 100,000,000 | 99,398,800     |  |
|       | 4 9 7 関西電力        | 100,000,000 | 102,295,300    |  |
|       | 6 5 東京瓦斯          | 100,000,000 | 98,219,900     |  |
| 社債券   | 合計                |             | 1,309,558,300  |  |
| 合計    |                   |             | 38,819,421,710 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

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

|                            |   |
|----------------------------|---|
|                            | <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>  |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | <p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>   |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分              | 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    | 383,529,944円    | 349,068,733円    |
| V A              |                 |                 |
| ダイワ国内重視バランスファ    | 4,549,034円      | 3,751,596円      |
| ンド30 V A (一般投資家私 |                 |                 |
| 募)               |                 |                 |
| ダイワ国内重視バランスファ    | 78,505,468円     | 45,554,421円     |
| ンド50 V A (一般投資家私 |                 |                 |
| 募)               |                 |                 |



|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド30VA(一般投資家私<br>募)                                 | 9,555,264円      | 7,085,384円      |
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド50VA(一般投資家私<br>募)                                 | 269,933,131円    | 205,400,687円    |
| 外国株式インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用)                             | 27,604,939円     | 52,416,335円     |
| ダイワファンドラップ 外国<br>株式インデックス エマー<br>ジ<br>ングプラス(為替ヘッジな<br>し)             | 504,914,542円    | 510,901,757円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>株式インデックス(為替ヘッ<br>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<br>イン 外国株式インデックス<br>エマ<br>ージ<br>ング<br>プラス(為替<br>ヘッジなし) | 494,255,626円    | 636,825,515円    |
| D-I's 外国株式インデッ<br>クス   | 11,991,941円     | 17,598,341円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050   | 18,033,648円     | 42,109,081円     |
| iFree 外国株式イン<br>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<br>クス  | 35,748,871,257円 | 41,251,827,650円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0   | 529,092,010円    | 528,041,544円    |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0   | 938,183,739円    | 988,869,306円    |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0   | 717,717,769円    | 798,656,593円    |
| 大和DC海外株式インデック<br>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<br>ヤー2030   | 11,485,409円     | 12,623,928円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040   | 8,497,384円      | 11,303,219円     |

|    |  |                 |                 |
|----|--|-----------------|-----------------|
|    | ダイワつみたてインデックス<br>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<br>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<br>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<br>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<br>ス(為替ヘッジなし)(投資<br>一任専用)  | - 円             | 246,407円        |
|    | ダイワ世界バランスファンド<br>40VA                    | 123,939,186円    | 81,384,880円     |
|    | ダイワ世界バランスファンド<br>60VA                    | 232,900,284円    | 153,275,360円    |
|    | ダイワ・バランスファンド3<br>5VA                     | 1,760,933,852円  | 1,330,992,536円  |
|    | ダイワ・バランスファンド2<br>5VA(適格機関投資家専<br>用)      | 90,149,674円     | 68,880,810円     |
|    | ダイワバランスファンド<br>2020-07(適格機関投資家専<br>用)    | 251,457,589円    | - 円             |
|    | ダイワバランスファンド<br>2021-02(適格機関投資家専<br>用)    | 234,082,341円    | 188,669,046円    |
|    | ダイワ・インデックスセレク<br>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<br>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<br>(為替ヘッジなし)(ダイワ<br>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<br>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）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 自 2021年6月8日<br>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。<br>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。<br>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。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(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<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>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<br>（円）    | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）      | 評価損益<br>（円） | 契約額等<br>（円）   | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）     | 評価損益<br>（円） |
|              |                |           |                |             |               |           |               |             |
| 市場取引         |                |           |                |             |               |           |               |             |
| 株値指数<br>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

株値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. 株値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<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|                | (円)           | うち<br>1年超 |               |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引以外の<br>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<br>・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。

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

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

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

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

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

## （1口当たり情報）

|                           | 2021年6月7日現在          | 2022年6月6日現在          |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 3.7108円<br>(37,108円) | 4.2108円<br>(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 SOLUTION | 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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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    |  |
| FREEMPORT-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<br>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<br>C  | 6,828  | 40.670    | 277,694.760    |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-<br>C | 7,900  | 62.160    | 491,064.000    |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM<br>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 &<br>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<br>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    |
| SOLAREGE 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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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 |  |
| PELTON 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-<br>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<br>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<br>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<br>INC CLASS | 16,209  | 57.780  | 936,556.020    |  |
| JOHNSON CONTROLS<br>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<br>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<br>A       | 2,200   | 334.770 | 736,494.000    |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE<br>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<br>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<br>WHEN ISS | 13,224  | 65.170  | 861,808.080    |  |
| PULTEGROUP INC                        | 9,850   | 45.060  | 443,841.000    |  |
| WARNER BROS. DISCOVERY INC<br>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<br>GROUP       | 17,013  | 173.300 | 2,948,352.900  |  |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING<br>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<br>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<br>SOFTWARE | 6,600   | 126.970 | 838,002.000    |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO -<br>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<br>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<br>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<br>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<br>1,448,372,654.080<br>(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<br>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   |  |
| ASHTAD 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<br>(THE) PLC | 4,232     | 42.380  | 179,352.160   |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO<br>PLC      | 87,395    | 35.365  | 3,090,724.170 |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS<br>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<br>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<br>74,113,349.270<br>(12,102,709,936) |  |
| イスラエル・<br>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<br>9,982,538.760<br>(391,960,392)   |  |
| オーストラリ<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>58,812,855.150<br>(5,543,699,727) |  |
| カナダ・ドル        |                                       | 株      | カナダ・ドル    | カナダ・ドル  |  |
|               | ALIMENTATION COUCHE TARD<br>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<br>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<br>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<br>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<br>99,441,226.910<br>(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<br>9,020,906.250<br>(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-<br>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<br>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<br>57,231,157.970<br>(7,778,286,679) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ |                                  | 株       | スウェーデン・クロー<br>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-<br>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<br>222,364,525.950<br>(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<br>115,274,891.000<br>(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<br>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<br>1,679,636.260<br>(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<br>46,283,230.800<br>(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   |  |
| BRENTAG 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   |  |
| NEMETSCHKE 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<br>HOLDI  | 41,312  | 3.000   | 123,936.000   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>ENE | 9,414   | 18.025  | 169,687.350   |  |
| ENAGAS SA                       | 9,884   | 21.580  | 213,296.720   |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION<br>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<br>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<br>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<br>INVESTMENT | 67,000  | 37.050  | 2,482,350.000                               |  |
|          | BUDWEISER BREWING CO APAC<br>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<br>GROU | 82,000  | 13.360  | 1,095,520.000                               |  |
|          | TECHTRONIC INDUSTRIES CO<br>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<br>130,544,827.700<br>(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<br>43,336,263.690<br>(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                                  |  |
|            | SEGREO 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<br>924,790.380<br>(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<br>6,038,390.500<br>(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<br>297,424.000<br>(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<br>1,226,232.700<br>(116,639,255) |       |
| ユーロ          | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD   | 4,600   | 292,100.000                                 | ユーロ   |
|              | 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<br>1,012,157.310<br>(141,924,698)       |       |
| 香港・ドル        | LINK REIT                   | 87,900  | 6,267,270.000                               | 香港・ドル |
|              | 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<br>8,730,460.000<br>(145,624,073)     |       |
| 投資証券 合計      |                             |         | 6,825,418,951<br>[6,825,418,951]            |       |
| 合計           |                             |         | 6,825,418,951<br>[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<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル    | 株式 604銘柄  | 97.1%        | 2.9%               | 73.6%          |
|            | 投資証券 36銘柄 |              |                    |                |
| イギリス・ポンド   | 株式 78銘柄   | 98.8%        | 1.2%               | 4.6%           |
|            | 投資証券 3銘柄  |              |                    |                |
| イスラエル・シェケル | 株式 9銘柄    | 100%         | -%                 | 0.1%           |
| オーストラリア・ドル | 株式 50銘柄   | 90.7%        | 9.3%               | 2.3%           |
|            | 投資証券 10銘柄 |              |                    |                |

|             |      |       |       |       |      |
|-------------|------|-------|-------|-------|------|
| カナダ・ドル      | 株式   | 86銘柄  | 99.7% | 0.3%  | 3.9% |
|             | 投資証券 | 2銘柄   |       |       |      |
| シンガポール・ドル   | 株式   | 14銘柄  | 88.0% | 12.0% | 0.4% |
|             | 投資証券 | 4銘柄   |       |       |      |
| 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 | 99.4% | 0.6%  | 9.1% |
|             | 投資証券 | 5銘柄   |       |       |      |
| 香港・ドル       | 株式   | 28銘柄  | 93.7% | 6.3%  | 0.9% |
|             | 投資証券 | 3銘柄   |       |       |      |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                          | 2021年6月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<br>ド(F0Fs用)(適格機関投資<br>家専用)                 | 147,412,708円    | 262,828,185円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス エマー<br>ジングプラス(為替ヘッジな<br>し)     | 494,252,758円    | 582,097,301円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス(為替ヘッ<br>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<br>イン 外国債券インデックス<br>エマーキングプラス(為替<br>ヘッジなし) | 801,683,813円    | 637,283,512円    |
| D-I's 外国債券インデッ<br>クス                                     | 946,948円        | 946,025円        |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                                   | 3,569,968円      | 11,046,385円     |
| iFree 外国債券イン<br>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<br>クス                                      | 49,249,685,981円 | 49,873,381,777円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                                       | 888,433,073円    | 1,015,192,007円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                                       | 528,928,478円    | 638,155,597円    |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                                       | 333,789,552円    | 416,524,630円    |
| DCダイワ・ワールドアセッ<br>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<br>ト(六つの羽/6分散コー<br>ス)                      | 398,386,255円    | 475,082,867円    |
| DCダイワ・ワールドアセッ<br>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<br>ヤー2030                                   | 24,115,938円     | 31,677,555円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040                                   | 7,428,392円      | 12,390,426円     |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワつみたてインデックス<br>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<br>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<br>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<br>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<br>ス(為替ヘッジなし)(ラッ<br>プ専用)   | - 円             | 8,553,439円      |
| ダイワ世界バランスファンド<br>40VA                    | 171,725,827円    | 126,818,187円    |
| ダイワ世界バランスファンド<br>60VA                    | 138,299,284円    | 101,559,044円    |
| ダイワ・バランスファンド3<br>5VA                     | 4,148,853,363円  | 3,578,350,089円  |
| ダイワ・バランスファンド2<br>5VA(適格機関投資家専<br>用)      | 245,616,231円    | 218,536,659円    |
| ダイワ・インデックスセレク<br>ト 外国債券                  | 144,966,306円    | 147,279,804円    |
| ダイワ・ノーロード 外国債<br>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<br>(為替ヘッジなし)(ダイワ<br>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<br>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)

## 金融商品の状況に関する事項

|    |                            |
|----|----------------------------|
| 区分 | 自 2021年6月8日<br>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。<br>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。<br>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。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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<br>(円)   | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|                 | (円)          | うち<br>1年超 |             |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引以外の<br>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<br>・ドル  | 20,163,888   | -         | 20,090,490  | 73,398      | -             | -         | -             | -           |
| オフショア・人<br>民元   | -            | -         | -           | -           | 171,335,360   | -         | 175,005,048   | 3,669,688   |
| スウェーデン<br>・クローナ | 22,289,608   | -         | 22,243,200  | 46,408      | -             | -         | -             | -           |
| デンマーク・<br>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。

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

|                           | 2021年6月7日現在          | 2022年6月6日現在          |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 3,1087円<br>(31,087円) | 3,1492円<br>(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 | 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<br>Note/Bond 20300515  | 714,000.000   | 879,776.520   |  |
| 5.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20310215 | 2,391,000.000 | 2,830,346.250 |  |
| 4.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20360215   | 1,176,000.000 | 1,392,172.320 |  |
| 5% United States Treasury<br>Note/Bond 20370515     | 847,000.000   | 1,052,261.980 |  |
| 4.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20380215 | 548,000.000   | 640,601.040   |  |
| 4.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20380515   | 519,000.000   | 614,444.100   |  |
| 3.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20390215   | 1,049,000.000 | 1,101,775.190 |  |
| 4.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20390515  | 1,121,000.000 | 1,287,569.390 |  |
| 4.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20390815   | 1,060,000.000 | 1,254,107.200 |  |
| 4.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20391115 | 1,210,000.000 | 1,407,375.200 |  |
| 4.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20400215 | 1,010,000.000 | 1,210,737.500 |  |
| 4.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20400515 | 1,678,000.000 | 1,948,829.200 |  |
| 3.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20400815 | 1,091,000.000 | 1,186,026.100 |  |
| 4.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20401115  | 1,469,000.000 | 1,670,811.220 |  |
| 4.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20410215  | 1,254,000.000 | 1,518,907.500 |  |
| 4.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20410515 | 1,365,000.000 | 1,573,476.450 |  |
| 3.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20410815  | 1,517,000.000 | 1,608,126.190 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20411115 | 1,450,000.000 | 1,406,717.500 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20420215 | 1,623,000.000 | 1,572,654.540 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20420515     | 1,353,000.000 | 1,283,334.030 |  |

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

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

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240331 | 4,550,000.000 | 4,513,190.500 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20270515 | 6,400,000.000 | 6,222,464.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20470515     | 2,000,000.000 | 1,890,000.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20240430     | 3,000,000.000 | 2,966,130.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20240531     | 5,300,000.000 | 5,234,969.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20240630     | 2,400,000.000 | 2,368,104.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20270815  | 5,900,000.000 | 5,691,612.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240731 | 3,000,000.000 | 2,965,050.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20470815  | 2,950,000.000 | 2,665,826.500 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20240831 | 2,000,000.000 | 1,962,340.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240930 | 2,500,000.000 | 2,465,225.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20271115  | 5,500,000.000 | 5,297,160.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20471115  | 2,500,000.000 | 2,261,700.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20241031  | 3,500,000.000 | 3,457,335.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20241130 | 3,200,000.000 | 3,149,472.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20241231  | 2,800,000.000 | 2,760,828.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20280215  | 6,350,000.000 | 6,270,625.000 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20250131   | 2,600,000.000 | 2,577,250.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20250228  | 2,700,000.000 | 2,692,170.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>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<br>Note/Bond 20290815 | 4,700,000.000 | 4,296,599.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20490815  | 4,600,000.000 | 3,804,660.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20260831 | 2,800,000.000 | 2,623,012.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240831  | 4,000,000.000 | 3,873,400.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260930 | 2,500,000.000 | 2,364,450.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20240930   | 3,000,000.000 | 2,916,300.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20241031   | 1,000,000.000 | 970,700.000   |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20261031 | 3,000,000.000 | 2,833,350.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20291115  | 5,850,000.000 | 5,388,844.500 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20491115 | 4,500,000.000 | 3,828,510.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20261130 | 2,000,000.000 | 1,888,420.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20241130   | 3,000,000.000 | 2,906,460.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20261231  | 2,500,000.000 | 2,371,475.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20241231  | 2,500,000.000 | 2,433,375.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20250131 | 1,700,000.000 | 1,636,641.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20300215   | 5,000,000.000 | 4,504,850.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20270131   | 6,500,000.000 | 6,087,640.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20500215     | 5,400,000.000 | 4,214,106.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20270228 | 300,000.000   | 275,718.000   |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20250228 | 5,200,000.000 | 4,966,364.000 |  |

|   |                |               |  |
|---|----------------|---------------|--|
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20250331   | 1,500,000.000  | 1,404,135.000 |  |
| 0.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20270331 | 1,600,000.000  | 1,432,864.000 |  |
| 0.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20300515 | 6,800,000.000  | 5,686,500.000 |  |
| 0.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20250430 | 2,700,000.000  | 2,512,458.000 |  |
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20270430   | 2,400,000.000  | 2,131,296.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20500515  | 5,600,000.000  | 3,585,736.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20400515 | 5,000,000.000  | 3,516,000.000 |  |
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20270531   | 3,500,000.000  | 3,100,755.000 |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20250531  | 3,000,000.000  | 2,774,760.000 |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20230615  | 5,500,000.000  | 5,388,680.000 |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20250630  | 6,500,000.000  | 5,998,265.000 |  |
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20270630   | 3,500,000.000  | 3,094,210.000 |  |
| 0.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20230715 | 1,000,000.000  | 976,170.000   |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20250731  | 3,400,000.000  | 3,129,564.000 |  |
| 0.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20230815 | 5,500,000.000  | 5,364,645.000 |  |
| 0.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20300815 | 10,000,000.000 | 8,314,800.000 |  |
| 0.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20270731 | 5,000,000.000  | 4,385,500.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20500815 | 6,700,000.000  | 4,437,142.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20400815 | 6,000,000.000  | 4,195,740.000 |  |
| 0.5% United States Treasury<br>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<br>Note/Bond 20240215 | 5,000,000.000 | 4,801,750.000 |  |
| 0.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20260131 | 5,000,000.000 | 4,558,200.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20280229 | 5,000,000.000 | 4,509,150.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20410215 | 4,700,000.000 | 3,736,829.000 |  |
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20260228   | 3,000,000.000 | 2,741,700.000 |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240315  | 2,000,000.000 | 1,919,680.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20280331  | 4,000,000.000 | 3,627,800.000 |  |
| 0.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20260331  | 4,000,000.000 | 3,683,120.000 |  |
| 0.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20240415 | 3,000,000.000 | 2,878,590.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20310515 | 8,700,000.000 | 7,795,635.000 |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240515  | 5,100,000.000 | 4,870,500.000 |  |
| 0.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20260430  | 4,500,000.000 | 4,137,165.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20280430  | 6,000,000.000 | 5,434,680.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20510515 | 6,400,000.000 | 5,449,984.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20410515  | 3,800,000.000 | 3,206,820.000 |  |
| 0.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20230531 | 1,000,000.000 | 979,410.000   |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20280531  | 4,000,000.000 | 3,619,360.000 |  |
| 0.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20260531  | 4,400,000.000 | 4,036,296.000 |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240615  | 2,000,000.000 | 1,904,840.000 |  |
| 0.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20230630 | 1,500,000.000 | 1,465,890.000 |  |

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

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

|              |   |               |   |  |
|--------------|---|---------------|---|--|
|              | 1.5% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20240229   | 4,000,000.000 | 3,929,040.000                                   |  |
|              | 1.875% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20270228 | 1,000,000.000 | 952,500.000                                     |  |
|              | 1.75% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20250315  | 5,000,000.000 | 4,850,750.000                                   |  |
|              | 2.375% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20290331 | 3,000,000.000 | 2,884,080.000                                   |  |
|              | 2.5% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20270331   | 5,000,000.000 | 4,898,200.000                                   |  |
|              | 2.25% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20240331  | 2,000,000.000 | 1,987,640.000                                   |  |
|              | 2.625% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20250415 | 2,000,000.000 | 1,986,640.000                                   |  |
|              | 2.875% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20320515 | 3,000,000.000 | 2,979,600.000                                   |  |
|              | 2.75% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20250515  | 3,000,000.000 | 2,990,430.000                                   |  |
|              | 2.875% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20520515 | 2,000,000.000 | 1,907,800.000                                   |  |
|              | 3.25% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20420515  | 1,500,000.000 | 1,482,060.000                                   |  |
|              | 2.5% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20240430   | 4,500,000.000 | 4,488,390.000                                   |  |
|              | 2.875% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20290430 | 3,000,000.000 | 2,977,380.000                                   |  |
|              | 2.75% UNITED STATES TREASURY<br>NOTE/BOND 20270430  | 3,000,000.000 | 2,970,930.000                                   |  |
|              | 2.5% UNITED STATES TREASURY<br>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<br>900,345,127.090<br>(117,801,156,429) |  |
| イギリス・ポ<br>ンド |   | イギリス・ポンド      | イギリス・ポンド  |  |
|              | 2% United Kingdom Gilt<br>20250907                  | 921,000.000   | 929,408.730                                     |  |
|              | 2.5% United Kingdom Gilt<br>20650722                | 1,582,000.000 | 1,690,066.420                                   |  |



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

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

|                |  |               |  |  |
|----------------|--|---------------|--|--|
|                | 4.5% United Kingdom Gilt<br>20421207             | 2,116,000.000 | 2,818,427.360                                  |  |
|                | 4.75% United Kingdom Gilt<br>20301207            | 1,600,000.000 | 1,945,856.000                                  |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20491207            | 1,343,000.000 | 1,833,275.580                                  |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20390907            | 1,446,000.000 | 1,819,545.180                                  |  |
|                | 4.5% United Kingdom Gilt<br>20340907             | 1,560,000.000 | 1,926,802.800                                  |  |
|                | 4% United Kingdom Gilt<br>20600122               | 1,174,000.000 | 1,676,601.140                                  |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20401207            | 1,577,000.000 | 2,003,121.170                                  |  |
|                | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20520722            | 1,552,000.000 | 2,004,904.640                                  |  |
|                | 3.25% United Kingdom Gilt<br>20440122            | 1,866,000.000 | 2,115,185.640                                  |  |
|                | 2.25% United Kingdom Gilt<br>20230907            | 1,582,000.000 | 1,593,453.680                                  |  |
|                | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20680722             | 1,386,000.000 | 1,878,653.700                                  |  |
|                | 2.75% United Kingdom Gilt<br>20240907            | 1,092,000.000 | 1,116,275.160                                  |  |
|                | 3.5% United Kingdom Gilt<br>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<br>74,272,087.200<br>(12,128,631,840) |  |
| イスラエル・<br>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<br>- Fixed 20261030 | 1,800,000.000 | 2,089,764.000                                  |  |
|                | 5.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20420131  | 1,600,000.000 | 2,118,208.000                                  |  |
|                | 3.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20240331 | 2,000,000.000 | 2,067,000.000                                  |  |
|                | 1.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20250831 | 2,300,000.000 | 2,266,558.000                                  |  |
|                | 2% Israel Government Bond -<br>Fixed 20270331    | 1,800,000.000 | 1,767,456.000                                  |  |

|            |  |               |   |  |
|------------|--|---------------|---|--|
|            | 3.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20470331 | 2,400,000.000 | 2,519,376.000                                 |  |
|            | 2.25% Israel Government Bond<br>- Fixed 20280928 | 1,800,000.000 | 1,774,350.000                                 |  |
|            | 1.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20231130  | 1,500,000.000 | 1,500,285.000                                 |  |
|            | 1% Israel Government Bond -<br>Fixed 20300331    | 2,400,000.000 | 2,128,752.000                                 |  |
|            | 0.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20250430  | 1,600,000.000 | 1,525,904.000                                 |  |
|            | 1.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20370531  | 1,700,000.000 | 1,371,849.000                                 |  |
|            | 0.15% Israel Government Bond<br>- Fixed 20230731 | 2,000,000.000 | 1,971,460.000                                 |  |
|            | 0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND -<br>FIXED 20260227  | 200,000.000   | 187,138.000                                   |  |
|            | 0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND -<br>FIXED 20241031  | 900,000.000   | 864,387.000                                   |  |
|            | 1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND -<br>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<br>24,415,686.000<br>(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<br>BOND 20270421     | 1,989,000.000 | 2,128,468.680                                 |  |
|            | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240421     | 573,000.000   | 574,449.690                                   |  |
|            | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290421     | 1,354,000.000 | 1,345,239.620                                 |  |
|            | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250421     | 1,798,000.000 | 1,812,635.720                                 |  |
|            | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20330421      | 1,258,000.000 | 1,371,182.260                                 |  |
|            | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20260421     | 1,748,000.000 | 1,820,209.880                                 |  |
|            | 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20370421     | 1,113,000.000 | 1,121,570.100                                 |  |

|  |               |                              |  |
|--|---------------|------------------------------|--|
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20350621 | 1,307,000.000 | 1,190,441.740                |  |
| 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20390621 | 792,000.000   | 743,299.920                  |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20271121 | 1,672,000.000 | 1,631,019.280                |  |
| 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20280521 | 1,178,000.000 | 1,111,878.860                |  |
| 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20470321    | 1,252,000.000 | 1,087,775.160                |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20281121 | 1,800,000.000 | 1,740,006.000                |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20291121 | 1,900,000.000 | 1,820,618.000                |  |
| 2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300521  | 2,870,000.000 | 2,687,726.300                |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20410521 | 1,390,000.000 | 1,195,177.600                |  |
| 1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20310621  | 2,840,000.000 | 2,410,506.800                |  |
| 1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20320521 | 1,700,000.000 | 1,383,103.000                |  |
| 0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20241121 | 2,400,000.000 | 2,253,984.000                |  |
| 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20301221    | 2,500,000.000 | 2,050,075.000                |  |
| 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20510621 | 1,400,000.000 | 899,570.000                  |  |
| 0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20251121 | 1,600,000.000 | 1,452,752.000                |  |
| 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20311121    | 2,500,000.000 | 2,005,575.000                |  |
| 0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20260921  | 1,200,000.000 | 1,072,908.000                |  |
| 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20321121 | 1,100,000.000 | 932,338.000                  |  |
| 3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH<br>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<br>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<br>20251206 | 5,200,000.000  | 5,335,564.000  |  |
| 3.25% China Government Bond<br>20281122 | 5,000,000.000  | 5,164,600.000  |  |
| 3.29% China Government Bond<br>20290523 | 5,000,000.000  | 5,178,500.000  |  |
| 3.25% China Government Bond<br>20260606 | 5,000,000.000  | 5,143,000.000  |  |
| 3.12% China Government Bond<br>20261205 | 12,000,000.000 | 12,295,560.000 |  |
| 3.13% China Government Bond<br>20291121 | 5,000,000.000  | 5,109,450.000  |  |
| 2.85% China Government Bond<br>20270604 | 6,000,000.000  | 6,065,100.000  |  |
| 2.68% China Government Bond<br>20300521 | 6,500,000.000  | 6,425,185.000  |  |
| 2.88% China Government Bond<br>20231105 | 27,000,000.000 | 27,266,490.000 |  |
| 3.27% China Government Bond<br>20301119 | 6,500,000.000  | 6,748,105.000  |  |
| 3.03% China Government Bond<br>20260311 | 7,000,000.000  | 7,138,110.000  |  |
| 3.81% China Government Bond<br>20500914 | 7,300,000.000  | 7,925,099.000  |  |
| 3.01% China Government Bond<br>20280513 | 5,000,000.000  | 5,078,250.000  |  |
| 3.72% China Government Bond<br>20510412 | 3,000,000.000  | 3,213,360.000  |  |
| 3.02% China Government Bond<br>20310527 | 5,800,000.000  | 5,876,386.000  |  |
| 2.69% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20260812 | 4,500,000.000  | 4,524,705.000  |  |
| 2.74% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20260804 | 5,000,000.000  | 5,037,050.000  |  |
| 3.57% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20240622 | 11,000,000.000 | 11,299,970.000 |  |
| 3.59% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20270803 | 5,500,000.000  | 5,784,185.000  |  |

|        |  |                |   |  |
|--------|--|----------------|---|--|
|        | 3.69% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20240921                | 15,000,000.000 | 15,503,850.000                                  |  |
|        | 3.69% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20280517                | 5,000,000.000  | 5,308,050.000                                   |  |
|        | 3.61% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20250607                | 10,000,000.000 | 10,395,400.000                                  |  |
|        | 3.54% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20280816                | 4,500,000.000  | 4,735,935.000                                   |  |
|        | 4.08% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20481022                | 3,100,000.000  | 3,499,125.000                                   |  |
|        | 3.86% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20490722                | 3,300,000.000  | 3,601,521.000                                   |  |
|        | 3.77% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20250308                | 11,000,000.000 | 11,466,180.000                                  |  |
|        | 3.39% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20500316                | 6,500,000.000  | 6,527,820.000                                   |  |
|        | 2.91% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20281014                | 5,500,000.000  | 5,554,560.000                                   |  |
|        | 3.53% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20511018                | 3,500,000.000  | 3,637,445.000                                   |  |
|        | 2.89% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20311118                | 4,000,000.000  | 4,018,000.000                                   |  |
|        | 2.37% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20270120                | 5,000,000.000  | 4,959,350.000                                   |  |
|        | 2.75% CHINA GOVERNMENT BOND<br>20320217                | 7,200,000.000  | 7,165,656.000                                   |  |
|        | 2.8% CHINA GOVERNMENT BOND<br>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<br>231,988,111.000<br>(4,562,347,787) |  |
| カナダ・ドル |  | カナダ・ドル         | カナダ・ドル  |  |
|        | 2.75% Canada Government<br>International Bond 20641201 | 605,000.000    | 568,058.700                                     |  |
|        | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290601             | 983,000.000    | 1,151,240.450                                   |  |
|        | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20330601             | 1,117,000.000  | 1,389,726.720                                   |  |
|        | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20370601                | 1,012,000.000  | 1,242,068.080                                   |  |

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



|               |  |               |   |  |
|---------------|--|---------------|---|--|
|               | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20260901    | 300,000.000   | 276,846.000                                 |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20310601  | 3,400,000.000 | 2,981,868.000                               |  |
|               | 0.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20230801 | 100,000.000   | 97,158.000                                  |  |
|               | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20241001 | 1,000,000.000 | 952,010.000                                 |  |
|               | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20531201 | 1,450,000.000 | 1,093,836.500                               |  |
|               | 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20231101  | 1,000,000.000 | 968,250.000                                 |  |
|               | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270301 | 200,000.000   | 184,880.000                                 |  |
|               | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240201 | 3,000,000.000 | 2,897,970.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20311201  | 1,700,000.000 | 1,482,247.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20250401  | 200,000.000   | 192,216.000                                 |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20240501  | 400,000.000   | 389,664.000                                 |  |
|               | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20320601    | 1,000,000.000 | 908,220.000                                 |  |
|               | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20291201 | 100,000.000   | 94,958.000                                  |  |
|               | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270901 | 400,000.000   | 395,032.000                                 |  |
|               | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240801 | 200,000.000   | 199,208.000                                 |  |
|               | カナダ・ドル 小計                                  |               | カナダ・ドル<br>46,267,282.870<br>(4,809,484,055) |  |
| シンガポール・<br>ドル |  | シンガポール・ドル     | シンガポール・ドル                                   |  |
|               | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20270301      | 772,000.000   | 802,926.320                                 |  |
|               | 3% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20240901        | 923,000.000   | 936,937.300                                 |  |
|               | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20300901    | 809,000.000   | 813,854.000                                 |  |

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

|                |  |                |  |  |
|----------------|--|----------------|--|--|
|                | 2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20250512   | 7,595,000.000  | 7,788,900.350                                  |  |
|                | 1% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20261112     | 7,180,000.000  | 6,979,175.400                                  |  |
|                | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20280512  | 5,050,000.000  | 4,786,895.000                                  |  |
|                | 2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20320601  | 3,300,000.000  | 3,484,569.000                                  |  |
|                | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20291112  | 7,400,000.000  | 6,921,146.000                                  |  |
|                | 0.125% SWEDISH GOVERNMENT<br>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<br>48,155,742.800<br>(644,323,839) |  |
| デンマーク・ク<br>ローネ | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20391115    | 13,662,000.000 | デンマーク・クローネ<br>19,169,835.300                   |  |
|                | 1.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20231115    | 4,846,000.000  | 4,920,967.620                                  |  |
|                | 1.75% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20251115   | 6,013,000.000  | 6,149,254.580                                  |  |
|                | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20271115    | 7,100,000.000  | 6,781,565.000                                  |  |
|                | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20291115    | 8,590,000.000  | 8,002,701.700                                  |  |
|                | 0.25% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20521115   | 3,500,000.000  | 2,241,995.000                                  |  |
|                | DANISH GOVERNMENT BOND<br>20311115         | 500,000.000    | 429,705.000                                    |  |
|                | DANISH GOVERNMENT BOND<br>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<br>48,674,964.200<br>(917,523,075)  |  |
| ノルウェー・ク<br>ローネ | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20240314   | 4,095,000.000  | ノルウェー・クローネ<br>4,142,461.050                    |  |

|               |  |               |   |  |
|---------------|--|---------------|---|--|
|               | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250313  | 5,395,000.000 | 5,274,799.400                                 |  |
|               | 1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20260219   | 4,340,000.000 | 4,165,401.800                                 |  |
|               | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270217  | 4,450,000.000 | 4,263,812.000                                 |  |
|               | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20280426     | 3,500,000.000 | 3,361,330.000                                 |  |
|               | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290906  | 3,850,000.000 | 3,591,819.000                                 |  |
|               | 1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300819 | 6,800,000.000 | 6,100,756.000                                 |  |
|               | 1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20310917  | 3,500,000.000 | 3,068,800.000                                 |  |
|               | 2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>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<br>35,567,349.250<br>(492,607,787) |  |
| ポーランド・ズ<br>ロチ |  | ポーランド・ズロチ     | ポーランド・ズロチ                                     |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20260725      | 4,377,000.000 | 3,692,874.900                                 |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20270725      | 3,170,000.000 | 2,574,991.000                                 |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20240425      | 2,870,000.000 | 2,663,704.400                                 |  |
|               | 2.75% Poland Government Bond<br>20291025     | 4,840,000.000 | 3,753,662.000                                 |  |
|               | 2.25% Poland Government Bond<br>20241025     | 3,400,000.000 | 3,082,610.000                                 |  |
|               | 0.75% Poland Government Bond<br>20250425     | 2,000,000.000 | 1,697,100.000                                 |  |
|               | 1.25% Poland Government Bond<br>20301025     | 3,000,000.000 | 1,996,350.000                                 |  |
|               | 0.25% Poland Government Bond<br>20261025     | 2,200,000.000 | 1,661,880.000                                 |  |
|               | POLAND GOVERNMENT BOND<br>20240725           | 1,000,000.000 | 870,870.000                                   |  |
|               | 1.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20320425     | 900,000.000   | 594,045.000                                   |  |

|             |  |               |  |  |
|-------------|--|---------------|--|--|
|             | 3.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20270525 | 500,000.000   | 434,900.000                                    |  |
|             | 5.75% Poland Government Bond<br>20290425 | 827,000.000   | 792,266.000                                    |  |
|             | 4% Poland Government Bond<br>20231025    | 2,125,000.000 | 2,055,937.500                                  |  |
|             | 2.75% Poland Government Bond<br>20280425 | 3,650,000.000 | 2,953,945.000                                  |  |
|             | 3.25% Poland Government Bond<br>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<br>32,961,167.700<br>(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<br>20270531  | 2,373,000.000 | 2,336,408.340                                  |  |
|             | 4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20300415  | 1,178,000.000 | 1,221,067.680                                  |  |
|             | 4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260415  | 1,514,000.000 | 1,553,636.520                                  |  |
|             | 4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20310630  | 1,300,000.000 | 1,296,932.000                                  |  |
|             | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20270315  | 731,000.000   | 733,565.810                                    |  |
|             | 3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20330415  | 1,427,000.000 | 1,359,417.280                                  |  |
|             | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280615  | 1,886,000.000 | 1,861,255.680                                  |  |
|             | 4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20430930  | 1,300,000.000 | 1,304,784.000                                  |  |
|             | 4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240715  | 1,057,000.000 | 1,075,899.160                                  |  |
|             | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20250915  | 1,737,000.000 | 1,758,156.660                                  |  |
|             | 4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20350531  | 1,220,000.000 | 1,181,777.400                                  |  |
|             | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230817    | 1,302,000.000 | 1,318,457.280                                  |  |
|             | 4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20460315  | 930,000.000   | 907,094.100                                    |  |

|   |                           |  |  |
|---|---------------------------|--|--|
| 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20261130   | 1,550,000.000             | 1,560,137.000                                    |  |
| 4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240930 | 1,550,000.000             | 1,575,621.500                                    |  |
| 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20271116 | 1,190,000.000             | 1,192,023.000                                    |  |
| 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20370407 | 1,950,000.000             | 1,987,791.000                                    |  |
| 3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20250314 | 1,200,000.000             | 1,213,524.000                                    |  |
| 4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20331107 | 1,200,000.000             | 1,221,396.000                                    |  |
| 4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20380608 | 600,000.000               | 615,216.000                                      |  |
| 3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260715 | 650,000.000               | 655,076.500                                      |  |
| 3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20290815 | 2,610,000.000             | 2,570,693.400                                    |  |
| 4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20480706 | 1,200,000.000             | 1,200,768.000                                    |  |
| 3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240614 | 400,000.000               | 401,064.000                                      |  |
| 3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20340705 | 1,300,000.000             | 1,218,087.000                                    |  |
| 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20400522 | 1,750,000.000             | 1,545,740.000                                    |  |
| 4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20500615 | 1,950,000.000             | 1,693,906.500                                    |  |
| 2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20310415 | 1,800,000.000             | 1,594,548.000                                    |  |
| 3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20320715 | 500,000.000               | 473,560.000                                      |  |
| 4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20421015 | 400,000.000               | 400,812.000                                      |  |
| 4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20290430 | 500,000.000               | 511,255.000                                      |  |
| マレーシア・リングット 小計                          |                           | マレーシア・リングット<br>39,539,670.810<br>(1,178,693,402) |  |
| メキシコ・ペソ<br>5.75% Mexican Bonos 20260305 | メキシコ・ペソ<br>37,290,000.000 | メキシコ・ペソ<br>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<br>278,209,946.490<br>(1,864,062,283) |  |
| ユーロ |  | ユーロ            | ユーロ   |  |
|     | 0.75% Finland Government Bond<br>20310415  | 364,000.000    | 336,725.480                                   |  |
|     | 0.875% Finland Government<br>Bond 20250915 | 279,000.000    | 277,630.110                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20260415   | 811,000.000    | 791,511.670                                   |  |
|     | Finland Government Bond<br>20230915        | 700,000.000    | 697,683.000                                   |  |
|     | 1.375% Finland Government<br>Bond 20470415 | 360,000.000    | 318,038.400                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20270915   | 800,000.000    | 768,240.000                                   |  |
|     | 1.125% Finland Government<br>Bond 20340415 | 670,000.000    | 614,718.300                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20280915   | 500,000.000    | 471,760.000                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20290915   | 500,000.000    | 464,990.000                                   |  |
|     | Finland Government Bond<br>20240915        | 200,000.000    | 196,702.000                                   |  |
|     | 0.125% Finland Government<br>Bond 20360415 | 310,000.000    | 241,331.900                                   |  |

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 5% Belgium Government Bond<br>20350328    | 1,904,000.000 | 2,543,724.960 |  |
| 4.25% Belgium Government Bond<br>20410328 | 1,604,000.000 | 2,069,753.480 |  |
| 4.5% Belgium Government Bond<br>20260328  | 1,001,000.000 | 1,132,321.190 |  |
| 4% Belgium Government Bond<br>20320328    | 780,000.000   | 935,422.800   |  |
| 2.25% Belgium Government Bond<br>20230622 | 1,338,000.000 | 1,365,295.200 |  |
| 3.75% Belgium Government Bond<br>20450622 | 843,000.000   | 1,049,931.210 |  |
| 2.6% Belgium Government Bond<br>20240622  | 1,505,000.000 | 1,564,056.200 |  |
| 3% Belgium Government Bond<br>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<br>20270715 | 825,000.000   | 1,033,403.250 |  |
| 4.15% Austria Government Bond<br>20370315 | 1,373,000.000 | 1,759,938.860 |  |
| 4.85% Austria Government Bond<br>20260315 | 875,000.000   | 1,003,038.750 |  |

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

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

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



|         |  |                                      |  |
|---------|--|--------------------------------------|--|
| 国債証券 合計 |  | 234,504,938,294<br>[234,504,938,294] |  |
| 合計      |  | 234,504,938,294<br>[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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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・リングgit | 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】

## ダイワ・ライフ・バランス50

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 当中間計算期間末<br>2022年12月6日現在 |
|-----------------|--------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                          |
| 流動資産            |                          |
| コール・ローン         | 120,309,224              |
| 親投資信託受益証券       | 21,552,795,445           |
| 未収入金            | 6,469,000                |
| 流動資産合計          | 21,679,573,669           |
| 資産合計            | 21,679,573,669           |
| <b>負債の部</b>     |                          |
| 流動負債            |                          |
| 未払解約金           | 15,938,241               |
| 未払受託者報酬         | 3,455,135                |
| 未払委託者報酬         | 19,579,356               |
| その他未払費用         | 863,701                  |
| 流動負債合計          | 39,836,433               |
| 負債合計            | 39,836,433               |
| <b>純資産の部</b>    |                          |
| 元本等             |                          |
| 元本              | 19,957,327,188           |
| 剰余金             |                          |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 11,682,410,048           |
| (分配準備積立金)       | 3,643,191,305            |
| 元本等合計           | 21,639,737,236           |
| 純資産合計           | 21,639,737,236           |
| 負債純資産合計         | 21,679,573,669           |

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 当中間計算期間<br>自 2022年6月7日<br>至 2022年12月6日 |
|---|--|
| <b>営業収益</b>                               |  |
| 受取利息                                      | 8                                      |
| 有価証券売買等損益                                 | 52,139,477                             |
| 営業収益合計                                    | 52,139,485                             |
| <b>営業費用</b>                               |  |
| 支払利息                                      | 21,394                                 |
| 受託者報酬                                     | 3,455,135                              |
| 委託者報酬                                     | 19,579,356                             |
| その他費用                                     | 863,701                                |
| 営業費用合計                                    | 23,919,586                             |
| 営業利益                                      | 28,219,899                             |
| 経常利益                                      | 28,219,899                             |
| 中間純利益                                     | 28,219,899                             |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ） | 1,311,234                              |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 10,950,779,049                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 1,169,637,726                          |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 1,169,637,726                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 467,537,860                            |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 467,537,860                            |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           | 11,682,410,048                         |

## (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<br>自 2022年6月7日<br>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<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>2022年12月6日現在 |
|---------------------------|--------------------------|
| 1. 1 期首元本額                | 9,354,402,028円           |
| 期中追加設定元本額                 | 1,002,489,675円           |
| 期中一部解約元本額                 | 399,564,515円             |
| 2. 中間計算期間末日における<br>受益権の総数 | 9,957,327,188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<br>自 2022年6月7日<br>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<br>2022年12月6日現在                      |
|--------------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び中間貸借対<br>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<br>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<br>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<br>2022年12月6日現在 |
|---------------------------|--------------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 2.1732円<br>(21,732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、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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      | 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<br>至 2022年12月6日  |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |

|                        |   |
|------------------------|---|
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>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<br>期首元本額<br>期中追加設定元本額<br>期中一部解約元本額 | 2022年6月7日<br>144,218,034,186円<br>10,169,953,264円<br>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<br>ファンド                       | 2,867,620,826円   |
| ダイワ・トピックス・イン<br>デックスファンドV A                | 4,779,531,783円   |
| 適格機関投資家専用・ダイ<br>ワ・トピックスインデックス<br>ファンドV A 2 | 917,689円   |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)       | 22,001,280円  |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)       | 268,219,414円   |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)       | 20,586,631円  |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)       | 569,064,100円   |
| 日本株式インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用)   | 470,899,018円   |



|                                     |                 |
|-------------------------------------|-----------------|
| D - I ' s T O P I Xイン<br>デックス       | 29,461,595円     |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050             | 219,346,077円    |
| i F r e e T O P I Xイン<br>デックス       | 6,312,421,987円  |
| i F r e e 8資産バランス                   | 4,259,741,459円  |
| i F r e e 年金バランス                    | 788,284,819円    |
| D Cダイワ日本株式インデッ<br>クス                | 69,183,972,487円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                  | 3,301,755,691円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                  | 4,749,379,043円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                  | 4,666,929,163円  |
| 年金ダイワ日本株式インデッ<br>クス                 | 6,702,922,990円  |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030             | 57,494,927円     |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040             | 70,614,624円     |
| ダイワつみたてインデックス<br>日本株式               | 2,709,909,622円  |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス30             | 11,751,428円     |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス50             | 10,397,873円     |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス70             | 26,190,775円     |
| ダイワ国内株式インデックス<br>(ラップ専用)            | 2,032,092,860円  |
| ダイワ世界バランスファンド<br>40VA               | 77,693,100円     |
| ダイワ世界バランスファンド<br>60VA               | 34,293,201円     |
| ダイワ・バランスファンド3<br>5VA                | 5,041,330,410円  |
| ダイワ・バランスファンド2<br>5VA(適格機関投資家専<br>用) | 454,758,876円    |

|    |   |  |                   |
|----|---|--|-------------------|
|    | ダイワ国内バランスファンド<br>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<br>30VA（適格機関投資家専用）          |  | 104,389,988円      |
|    | ダイワ・ノーロードTOP<br>PIXファンド                   |  | 202,346,274円      |
|    | ダイワファンドラップTOP<br>PIXインデックス                |  | 11,464,646,925円   |
|    | ダイワTOPPIXインデック<br>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<br>インTOPPIXインデック<br>ス       |  | 3,199,482,022円    |
|    | ダイワ・インデックスセレクト<br>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・<br>インデックス（確定拠出年金<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(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)

## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 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         |              | 153,774,052    |
| 国債証券            |              | 38,738,443,760 |
| 地方債証券           |              | 1,440,789,900  |
| 特殊債券            |              | 722,408,500    |
| 社債券             |              | 1,286,970,300  |
| 未収利息            |              | 76,402,161     |
| 前払費用            |              | 3,195,189      |
| 流動資産合計          |              | 42,421,983,862 |
| 資産合計            |              | 42,421,983,862 |
| 負債の部            |              |                |
| 流動負債            |              |                |
| 未払解約金           |              | 2,371,433      |
| 流動負債合計          |              | 2,371,433      |
| 負債合計            |              | 2,371,433      |
| 純資産の部           |              |                |
| 元本等             |              |                |
| 元本              | 1            | 34,246,911,260 |
| 剰余金             |              |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） |              | 8,172,701,169  |
| 元本等合計           |              | 42,419,612,429 |
| 純資産合計           |              | 42,419,612,429 |
| 負債純資産合計         |              | 42,421,983,862 |

## 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<br>至 2022年12月6日  |
|-----------------|--|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                      | 2022年12月6日現在    |
|--|-----------------|
| 1. 1 期首                                  | 2022年6月7日       |
| 期首元本額                                    | 30,891,408,853円 |
| 期中追加設定元本額                                | 3,725,154,990円  |
| 期中一部解約元本額                                | 369,652,583円    |
| 期末元本額の内訳                                 |                 |
| ファンド名                                    |                 |
| 日本債券インデックスファン<br>ド（F0Fs用）（適格機関投資<br>家専用） | 1,548,582,007円  |
| i F r e e 日本債券イン<br>デックス                 | 3,693,520,223円  |
| i F r e e 8資産バランス<br>ダイワ・ライフ・バランス3<br>0  | 4,737,434,958円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                       | 9,990,638,089円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                       | 6,961,193,159円  |
| D Cダイワ・ワールドアセッ<br>ト（六つの羽ノ安定コース）          | 2,311,095,059円  |
|  | 1,633,948,847円  |

|                             |                 |
|-----------------------------|-----------------|
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) | 1,283,747,684円  |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)  | 494,321,217円    |
| ダイワつみたてインデックス日本債券           | 1,254,351,922円  |
| ダイワつみたてインデックスバランス30         | 36,466,976円     |
| ダイワつみたてインデックスバランス50         | 15,674,151円     |
| ダイワつみたてインデックスバランス70         | 13,055,990円     |
| ダイワ世界バランスファンド40VA           | 216,676,466円    |
| ダイワ世界バランスファンド60VA           | 56,204,512円     |
| 計                           | 34,246,911,260円 |
| 2. 期末日における受益権の総数            | 34,246,911,260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<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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

| 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)

|           | 2022年12月6日現在 |
|-----------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.2386円      |

(1万口当たり純資産額)

(12,386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<br>至 2022年12月6日   |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>  |



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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分           | 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 | 308,036,729円    |
| V A           |                 |
| ダイワ国内重視バランスファ | 3,459,588円      |
| ンド30VA(一般投資家私 |                 |
| 募)            |                 |
| ダイワ国内重視バランスファ | 36,926,372円     |
| ンド50VA(一般投資家私 |                 |
| 募)            |                 |

|  |                 |
|--|-----------------|
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド30VA(一般投資家私<br>募)                     | 6,474,561円      |
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド50VA(一般投資家私<br>募)                     | 180,430,894円    |
| 外国株式インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用)                 | 69,302,834円     |
| ダイワファンドラップ 外国<br>株式インデックス エマー<br>ジングプラス(為替ヘッジな<br>し)     | 503,540,395円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>株式インデックス(為替ヘッ<br>ジなし)                   | 2,950,686,221円  |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国株式インデックス<br>エマージングプラス(為替<br>ヘッジなし) | 638,387,425円    |
| D-I's 外国株式インデッ<br>クス                                     | 18,393,304円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                                   | 47,101,791円     |
| iFree 外国株式イン<br>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<br>クス                                      | 43,856,142,460円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                                       | 521,630,147円    |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                                       | 1,000,988,398円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                                       | 822,320,687円    |
| 大和DC海外株式インデック<br>スファンド                                   | 1,892,448,923円  |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030                                   | 12,165,937円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040                                   | 12,260,597円     |

|  |                 |
|--|-----------------|
| ダイワつみたてインデックス<br>外国株式                    | 1,387,611,128円  |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス30                  | 1,875,196円      |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス50                  | 2,214,762円      |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス70                  | 4,618,088円      |
| ダイワ先進国株式インデック<br>ス(為替ヘッジなし)(投資<br>一任専用)  | 4,346,432円      |
| ダイワ世界バランスファンド<br>40VA                    | 72,721,941円     |
| ダイワ世界バランスファンド<br>60VA                    | 53,797,340円     |
| ダイワ・バランスファンド3<br>5VA                     | 1,206,119,997円  |
| ダイワ・バランスファンド2<br>5VA(適格機関投資家専<br>用)      | 62,419,910円     |
| ダイワバランスファンド<br>2021-02(適格機関投資家専<br>用)    | 173,081,567円    |
| ダイワ・インデックスセレク<br>ト 外国株式                  | 1,149,957,791円  |
| ダイワ・ノーロード 外国株<br>式ファンド                   | 428,134,905円    |
| ダイワ外国株式インデックス<br>(為替ヘッジなし)(ダイワ<br>SMA専用) | 1,283,241,198円  |
| ダイワ投信倶楽部外国株式イ<br>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          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

| 種 類          | 2022年12月6日 現在  |           |                |             |
|--------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
|              | 契約額等<br>(円)    | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(円) |
|              |                |           |                |             |
| 市場取引         |                |           |                |             |
| 株価指数<br>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。

- 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。
- 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。
- 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          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|                | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 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・<br>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。

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

|              | 2022年12月6日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 4.3022円      |
| (1万口当たり純資産額) | (43,022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<br>至 2022年12月6日   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>  |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法     | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>   |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分       | 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<br>V A                                     | 446,318,132円    |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)                     | 9,071,985円      |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)                     | 50,770,453円     |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)                     | 19,793,735円     |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)                     | 244,298,068円    |
| 外国債券インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用)                 | 356,097,659円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス エマー<br>ジングプラス(為替ヘッジな<br>し)     | 584,338,037円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス(為替ヘッ<br>ジなし)                   | 2,662,838,986円  |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国債券インデックス<br>エマージングプラス(為替<br>ヘッジなし) | 611,768,122円    |
| D-I's 外国債券インデッ<br>クス                                     | 1,001,377円      |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                                   | 12,877,429円     |
| iFree 外国債券イン<br>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<br>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<br>（為替ヘッジなし）（ダイワ<br>SMA専用） | 1,746,349,407円  |
| ダイワ投信倶楽部外国債券イ<br>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<br>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<br>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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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<br>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<br>（円）   | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）   | 評価損益<br>（円） |
| 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・<br>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・<br>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。

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

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

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2022年12月30日

|                  |                 |
|------------------|-----------------|
| 資産総額             | 21,211,449,078円 |
| 負債総額             | 9,559,674円      |
| 純資産総額（ - ）       | 21,201,889,404円 |
| 発行済数量            | 10,059,340,477口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 2.1077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

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

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

## 純資産額計算書

2022年12月30日

|                  |                 |
|------------------|-----------------|
| 資産総額             | 42,017,535,662円 |
| 負債総額             | 4,578,707円      |
| 純資産総額（ - ）       | 42,012,956,955円 |
| 発行済数量            | 34,370,648,164口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.2223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

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

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

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

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年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議



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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

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<br>(2021年3月31日) | 当事業年度<br>(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                     | 1                     |
| 建物        | 224                   | 203                   |
|           | 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<br>(2021年3月31日) | 当事業年度<br>(2022年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>負債の部</b>  |                       |                       |
| <b>流動負債</b>  |                       |                       |
| 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                     | 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                |
| <b>固定負債</b>  |                       |                       |
| 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                |
| <b>純資産の部</b> |                       |                       |

|              |        |        |
|--------------|--------|--------|
| 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<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>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<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>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   |        |       |              |             | 株主資本<br>合計 |
|-------------------------|--------|--------|-------|--------------|-------------|------------|
|                         | 資本金    | 資本剰余金  | 利益剰余金 |              | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                         |        | 資本準備金  | 利益準備金 | その他利益<br>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<br>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<br>証券評価<br>差額金 | 評価・換算<br>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<br>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)

|                         | 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<br>繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 |         |
| 当期首残高                   | 15,174 | 11,495 | 374   | 10,574              | 10,948  | 37,618  |
| 当期変動額                   |        |        |       |                     |         |         |
| 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<br>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<br>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<br>(2021年3月31日) | 当事業年度<br>(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<br>(2021年3月31日) | 当事業年度<br>(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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>総額(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|--------------------|-----------------|----------------|----------------|
| 2020年6月23日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 10,564             | 4,050           | 2020年<br>3月31日 | 2020年<br>6月24日 |

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

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

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

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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>定時株主総会 | 普通株式  | 9,388          | 3,599       | 2021年<br>3月31日 | 2021年<br>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。

|           |            |
|-----------|------------|
| 剰余金の配当の総額 | 12,737百万円  |
| 配当の原資     | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額  | 4,883円     |
| 基準日       | 2022年3月31日 |
| 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係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価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いません。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、記載していません。

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、記載していません。

#### 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<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(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<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(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<br>(百万円) | 売却益の合計額<br>(百万円) | 売却損の合計額<br>(百万円) |
|------------------|--------------|------------------|------------------|
| (1)株式            | -            | -                | -                |
| (2)その他<br>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<br>(百万円) | 売却益の合計額<br>(百万円) | 売却損の合計額<br>(百万円) |
|------------------|--------------|------------------|------------------|
| (1)株式            | -            | -                | -                |
| (2)その他<br>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いません。

#### 2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

|             | 前事業年度                         |     | 当事業年度                         |     |
|-------------|-------------------------------|-----|-------------------------------|-----|
|             | (自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |     | (自 2021年4月1日<br>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                         |     | 当事業年度                         |     |
|---------------------|-------------------------------|-----|-------------------------------|-----|
|                     | (自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |     | (自 2021年4月1日<br>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                         |     | 当事業年度                         |     |
|-----------------|-------------------------------|-----|-------------------------------|-----|
|                 | (自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |     | (自 2021年4月1日<br>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        |  | 当事業年度        |  |
|---------|--------------|--|--------------|--|
|         | (2021年3月31日) |  | (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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関係内容      |            | 取引の内容             | 取引金額<br>(百万円) | 科目        | 期末残高<br>(百万円) |
|-----|-------------|---------|--------------------|---------|---------------------------|-----------|------------|-------------------|---------------|-----------|---------------|
|     |             |         |                    |         |                           | 役員<br>兼任等 | 事業上<br>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<br>100.0              | あり        | 経営管理       | 資金の貸付<br>利息の受取(注) | 19,300<br>0   | 関係会社短期貸付金 | 18,700<br>-   |

## 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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関係内容      |            | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円)   | 科目                        | 期末残高<br>(百万円)   |
|-----|---------------|---------|--------------------|---------|---------------------------|-----------|------------|-----------------------|-----------------|---------------------------|-----------------|
|     |               |         |                    |         |                           | 役員<br>兼任等 | 事業上<br>の関係 |                       |                 |                           |                 |
| 親会社 | (株)大和証券グループ本社 | 東京都千代田区 | 247,397            | 証券持株会社業 | 被所有<br>100.0              | あり        | 経営管理       | 資金の貸付<br><br>利息の受取(注) | 19,000<br><br>0 | 関係会社短期貸付金<br><br>受取利息関係会社 | 24,900<br><br>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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容       | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(百万円) |
|-----|--|-----------|-------------------|---------|-----------------------|-----------|-------------|---------------|----|---------------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd. | Singapore | 133               | 金融商品取引業 | 所有<br>直接100.0         | 経営管理      | 債務保証<br>(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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容       | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(百万円) |
|-----|--|-----------|-------------------|---------|-----------------------|-----------|-------------|---------------|----|---------------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd. | Singapore | 133               | 金融商品取引業 | 所有<br>直接100.0         | 経営管理      | 債務保証<br>(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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係                      | 取引の内容            | 取引金額<br>(百万円) | 科目      | 期末残高<br>(百万円) |
|-------------|-------------------|---------|-------------------|---------|-----------------------|--------------------------------|------------------|---------------|---------|---------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株)           | 東京都千代田区 | 100,000           | 金融商品取引業 | -                     | 証券投資信託受益証券の募集販売<br><br>本社ビルの管理 | 証券投資信託の代行手数料(注2) | 14,917        | 未払手数料   | 3,321         |
|             |                   |         |                   |         |                       |                                | 不動産の賃借料(注4)      | 527           | 長期差入保証金 | 1,054         |
| 同一の親会社をもつ会社 | 株大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区  | 3,000             | 情報サービス業 | -                     | ソフトウェアの開発                      | ソフトウェアの購入(注3)    | 883           | 未払費用    | 179           |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ(株)        | 東京都中央区  | 100               | 不動産管理業  | -                     | 本社ビルの管理                        | 不動産の賃借料(注4)      | 527           | -       | -             |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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<br>(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(百万円) |
|----|--------|-----|-------------------|-------|-----------------------|-----------|-------|---------------|----|---------------|
|----|--------|-----|-------------------|-------|-----------------------|-----------|-------|---------------|----|---------------|

|             |         |         |         |         |   |                            |                                 |                 |                  |                |
|-------------|---------|---------|---------|---------|---|----------------------------|---------------------------------|-----------------|------------------|----------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株) | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | - | 証券投資信託受益証券の募集販売<br>本社ビルの管理 | 証券投資信託の代行手数料(注2)<br>不動産の賃借料(注3) | 15,348<br>1,062 | 未払手数料<br>長期差入保証金 | 3,028<br>1,054 |
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)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<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |            | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>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いません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

|                 | 前事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>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<br>(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     |   |                         |
| ソフトウェア     |   | 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<br>(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<br>剰余金<br>繰越利益<br>剰余金 | 利益剰余金<br>合計 |        |
| 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<br>項目の当中間期<br>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ェアについては、社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

#### 3．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金



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

#### (2) 退職給付引当金

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

#### (3) 役員退職慰労引当金

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

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

当社は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<br>(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<br>(自 2022年4月1日<br>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<br>(自 2022年4月1日<br>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<br>(自 2022年4月1日<br>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<br>(自 2022年4月1日<br>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<br>株式数 | 当中間会計期間<br>増加株式数 | 当中間会計期間<br>減少株式数 | 当中間会計期間末<br>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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|-----------------|---------------------|------------|------------|
| 2022年6月23日<br>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<br>計上額（百万円） | 取得原価<br>（百万円） | 差額<br>（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<br>(自 2022年4月1日<br>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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

| 当中間会計期間<br>(自 2022年4月1日<br>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。

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

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

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】

|         | 名 称               | 資本金の額<br>(2022年03月末日現在) | 事業の内容 | 備考 |
|---------|-------------------|-------------------------|-------|----|
| 受託会社    | 三井住友信託銀行株式会社      | 342,037百万円              | (注6)  |    |
| 再信託受託会社 | 株式会社日本カスト<br>ディ銀行 | 51,000百万円               | (注6)  |    |



|           |                   |              |      |  |
|-----------|-------------------|--------------|------|--|
| 販売会社      | 大和証券株式会社          | 100,000百万円   | (注1) |  |
|           | S M B C 日興証券株式会社  | 10,000百万円    | (注1) |  |
|           | 株式会社S B I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) |  |
|           | きらぼしライフデザイン証券株式会社 | 3,000百万円     | (注1) |  |
|           | 株式会社CONNECT       | 4,150百万円     | (注1) |  |
|           | 第四北越証券株式会社        | 600百万円       | (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) |  |
|           | 楽天証券株式会社          | 17,495百万円    | (注1) |  |
|           | ワイエム証券株式会社        | 1,270百万円     | (注1) |  |
|           | P W M 日本証券株式会社    | 3,000百万円     | (注1) |  |
|           | 損保ジャパン D C 証券株式会社 | 3,000百万円     | (注1) |  |
|           | 株式会社北九州銀行         | 10,000百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社きらぼし銀行        | 43,734百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社高知銀行          | 19,544百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社清水銀行          | 10,816百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社仙台銀行          | 22,735百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社東邦銀行          | 23,519百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社東北銀行          | 13,233百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社富山銀行          | 6,730百万円     | (注3) |  |
|           | 日本生命保険相互会社        | 1,450,000百万円 | (注9) |  |
|           | PayPay銀行株式会社      | 37,250百万円    | (注3) |  |
|           | 三井住友信託銀行株式会社      | 342,037百万円   | (注6) |  |
|           | 株式会社宮崎太陽銀行        | 15,252百万円    | (注3) |  |
|           | 株式会社武蔵野銀行         | 45,743百万円    | (注3) |  |
| 株式会社もみじ銀行 | 10,000百万円         | (注3)         |      |  |
| 株式会社山形銀行  | 12,008百万円         | (注3)         |      |  |
| 株式会社山口銀行  | 10,005百万円         | (注3)         |      |  |
| 株式会社りそな銀行 | 279,928百万円        | (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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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いません。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

## 第3【その他】

### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
- ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
- ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
  - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
  - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 使用開始日を記載することがあります。
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
  - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
  - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- ・ 次の事項を記載することがあります。
  - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

- ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
  - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
  - ・ 図案を採用することがあります。
  - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
  - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。)を掲載することがあります。
  - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

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 | 公認会計士 | 間瀬 | 友未 |
| 業務執行社員   |       |    |    |
| 指定有限責任社員 | 公認会計士 | 深井 | 康治 |
| 業務執行社員   |       |    |    |

**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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井 康治 |
|--------------------|-------|-------|

|                    |       |       |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 竹内 知明 |
|--------------------|-------|-------|

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス50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、ダイワ・ライフ・バランス50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を検討すること、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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 間瀬 友未 |
| 指定有限責任社員<br>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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以上

(注) 1. 上記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 公認会計士 深井 康治  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明  
業務執行社員**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」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス50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、ダイワ・ライフ・バランス50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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記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。