

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年5月31日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	i F r e e 8 資産バランス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

i F r e e 8資産バランス

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <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、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

(7) 【申込期間】

2021年6月1日から2021年11月30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】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <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】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所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。

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のい  
ずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受け付けは行ない  
ません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

委託会社の各営業日( )の午後3時までに受け付けた取得および換金の申込み(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。

( )前 の申込受付中止日を除きます。

金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2  
条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同  
じ。)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(投資対象国における非  
常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な  
政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関す  
る障害等)が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込  
みの受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込みを取消することができるものとし  
ます。

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。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売  
会社により異なる場合があります。

「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  
たがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を  
規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称  
に読替えるものとします(以下同じ。 )。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関  
の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振  
替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいま  
す。)への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。



## 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、値動きの異なる8つの資産クラスに分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

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

- ・「追加型投信」...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
- ・「内外」...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、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
- ・「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

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「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
- ・「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

- ・「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
- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

#### < 信託金の限度額 >

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

#### < ファンドの特色 >

iFree 8資産バランス

SIMPLE  
& EASY

インデックスってなに？

FREE  
& LOW

費用はどれくらいかかるのかな？



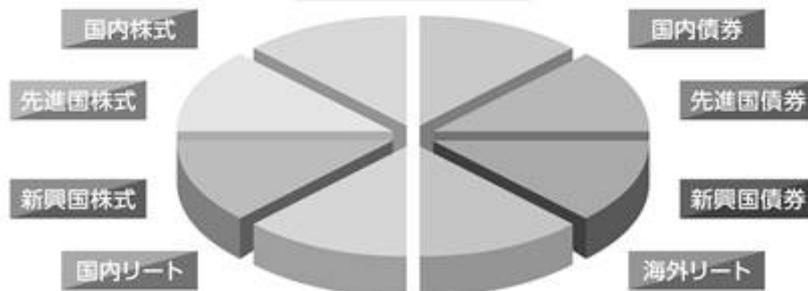
これらの質問については、以降でご説明します。

## ファンドの目的・特色

値動きの異なる8つの資産クラスに均等分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

### ■ 8つの資産クラスについて

資産配分のイメージ



- ・内外の株式、債券およびリート(不動産投資信託)に投資します。
- ・各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果をそれぞれの対象インデックスに連動させることをめざして運用を行ないます。

※先進国株式・債券の資産クラスには、日本の株式・債券を含みません。

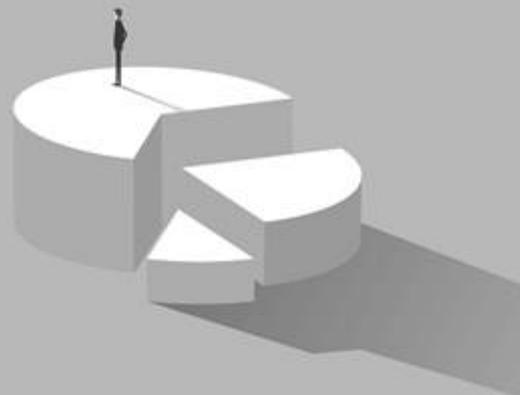
※対象インデックスについては、後掲の「対象インデックスについて」をご参照下さい。

当ファンドは、「つみたてNISA」対象ファンドです。





# インデックス ってなに?



## 「インデックス」とは

いふなれば「市場のモノサシ」です。

マーケット(市場)を構成する個々の価格データからマーケット全体の動向がわかるように情報会社等が計算したもので、「〇〇指数」「〇〇インデックス」などと呼ばれます。

インデックスの動きを確認することにより、マーケットのおおよその動きを読み取ることができます。

インデックス	マーケット

一般に  
インデックスの上昇時はマーケットは好調  
インデックスの下落時はマーケットは低調  
と考えられます。

当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

### ■対象インデックスについて

資産クラス	対象インデックス
国内株式	東証株価指数(TOPIX)
先進国株式	MSCIコクサイ指数(円ベース)
新興国株式	FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数

資産クラス	対象インデックス
先進国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券	JPモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
海外リート	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース)

※対象インデックスの内容については、後掲の「インデックスの概要について」をご参照下さい。



# 費用はどれくらいかかるのかな？



## ファンドへの投資にかかる主な費用は

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

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —



### 運用管理費用っていくらくらい？

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。  
 当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.242%(税込)です。  
 1年間ファンドの値段(基準価額)が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	≒	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.242%		242円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

## ■ インデックスの概要について

### ● 東証株価指数(TOPIX)

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

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

### ● MSCIコクサイ指数

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

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

### ● FTSE RAFI エマージング インデックス

FTSE RAFI エマージング インデックスとは、FTSE社(FTSE International Limited)の流動性基準、時価総額基準、浮動株調整をクリアした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、リサーチ・アフィリエイツ社(Research Affiliates LLC)独自のインデックス構成手法により、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。なお、FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)は、FTSE RAFI エマージング インデックス(米ドルベース)をともに、FTSE International Limitedの承諾を得て委託会社が計算したものです。

[iFree 8資産バランス]は、いかなる形式においてもFTSE International Limited(以下[FTSE])、ロンドン証券取引所グループ会社(以下[LSEG])、またはResearch Affiliates LLC(以下[RA]) (以下、総称して「ライセンサ各社」)によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については(過失の有無に関わらず)何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE®はLSEGの商標です。Fundamental Index®およびRAFI®はResearch Affiliates, LLCの登録商標です。

The iFree Balanced Fund 8 is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

### ● NOMURA-BPI総合指数

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

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

### ● FTSE世界国債インデックス

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

### ● JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与えうる制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみならず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.

### ● 東証REIT指数(配当込み)

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

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

### ● S&P先進国REIT指数

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

## ファンドの仕組みなど



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 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
- 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場合、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、「ファンドの特色」の運用が行なわれないことがあります。

## 分配方針

毎年9月7日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

### 【分配方針】

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2016年9月8日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないません。</p> <p>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 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せん。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</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： 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せん。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 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資
投資対象	内外の株式・債券およびリート（不動産投資信託） など（ファミリーファンド方式で運用を行ないません。）	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2021年3月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

## ・沿革

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

## ・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

## 主要投資対象

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

各マザーファンドは、それぞれかつ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. 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））
3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））
4. 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）
5. 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））
6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券（JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算））
7. ダイワJ - REITマザーファンドの受益証券（東証REIT指数（配当込み））
8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））

## 投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、次の資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

- 1．国内株式
- 2．先進国株式
- 3．新興国株式
- 4．国内債券
- 5．先進国債券
- 6．新興国債券
- 7．国内リート
- 8．海外リート

ロ．各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。

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

ニ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から8．までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の9．から12．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
4. 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
5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
7. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
10. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9.の証券の性質を有するもの
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

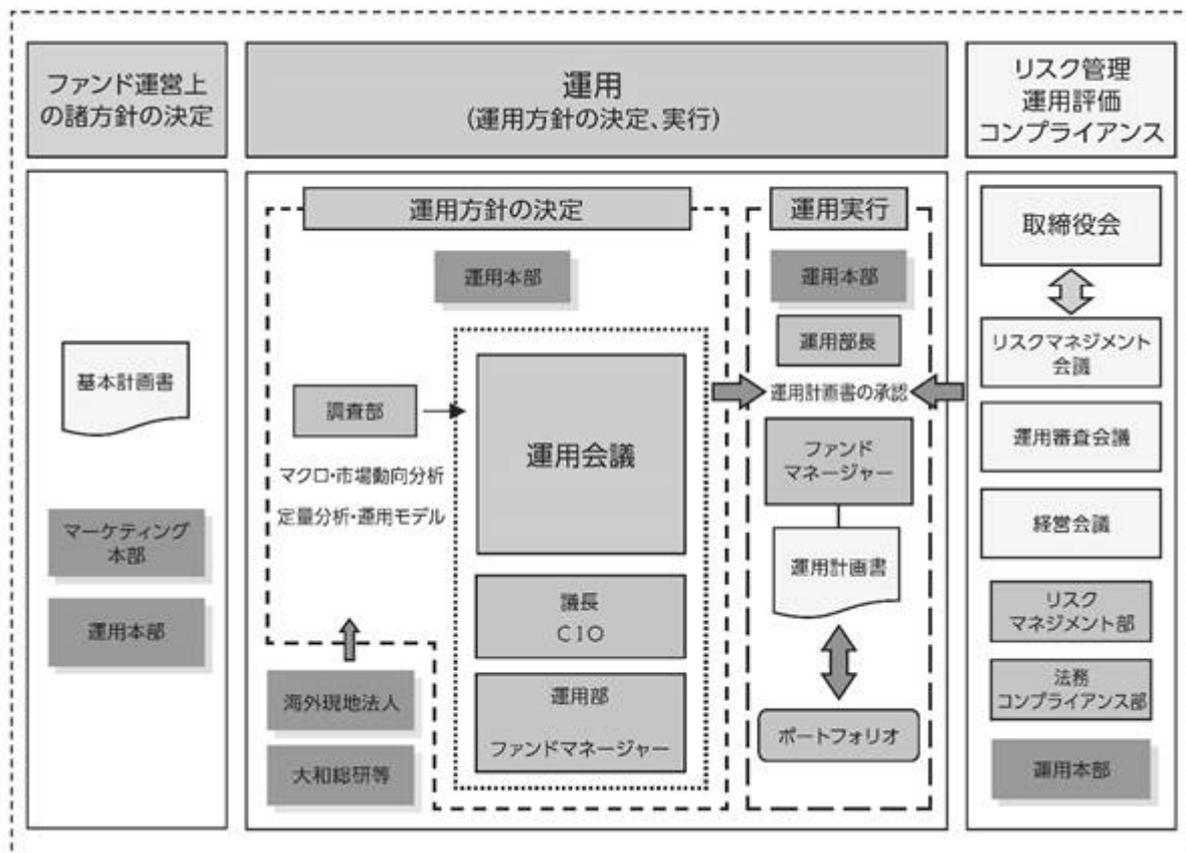
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

### イ．基本計画書の策定

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

### ロ．基本的な運用方針の決定

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

### ハ．運用計画書の作成・承認

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

## 職務権限

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

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

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

### ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

### ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

### ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

## 運用審査会議、リスクマネジメント会議および経営会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

### イ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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．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。

### ハ．経営会議

法令等の遵守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。

#### 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2021年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

##### 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

##### 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

##### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

##### 外国為替予約取引（信託約款）

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

八．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。

二．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

##### 投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### (2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

#### (3) 主な投資制限

## 株式

株式への投資には、制限を設けません。

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

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

## スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、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、

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、

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、

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

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

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

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．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 17．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 18．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

イ. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みません。)

ロ. 新興国の企業のDR(預託証券)

ハ. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF(上場投資信託証券)

投資態度

イ. 主として、新興国の株式(DR(預託証券))を含みます。以下同じ。)( )に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。

ロ. 株式およびETF(上場投資信託証券)の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ハ. 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託

財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約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。

ニ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、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、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することを指図することができます。

1. 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. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 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。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。)
20. 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。)
21. 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
22. 外国の者に対する権利で前21.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(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

株式への投資割合には、制限を設けません。

#### 投資信託証券

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引等

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

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

ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を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、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．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が、保有外貨建資産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、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．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。

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

#### 4. 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 - B P I 総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 投資信託証券

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

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。

## 5. 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。

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予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

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。

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### 同一銘柄の株式

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 6. ダイワ新興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

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

#### 投資態度

イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。

ロ．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

15. 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。）

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

17. 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

18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のう

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

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 投資信託証券

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引等

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

ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を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、市場実勢金利等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。

金利先渡取引および為替先渡取引

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.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．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が、保有外貨建資産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、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．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。

ヘ．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。

## 7. ダイワJ-REITマザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

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

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

## 投資態度

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

## 株式

株式への直接投資は、行ないません。

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

## 同一銘柄の投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

## 先物取引

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

## 8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

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

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

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

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

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

### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

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

## 3 【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の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。

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）



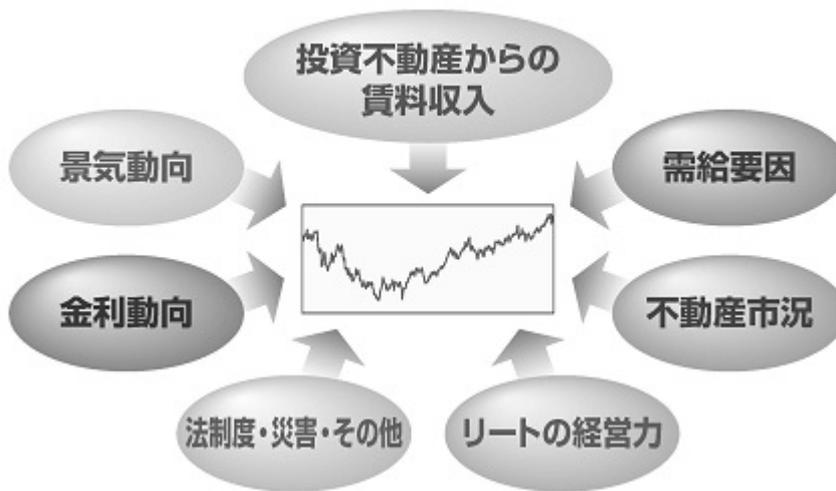
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

## 〈リートの子な価格変動要因〉



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

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

ロ．リー子の価格や配当は、リー子の収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

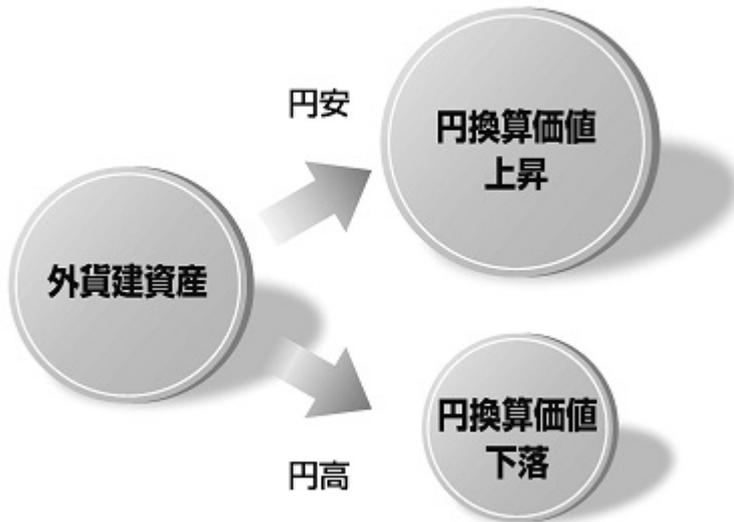
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リー子の価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

外国証券への投資に伴うリスク

## イ．為替リスク

## 〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

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

## ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる面がある場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

その他

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

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

## (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

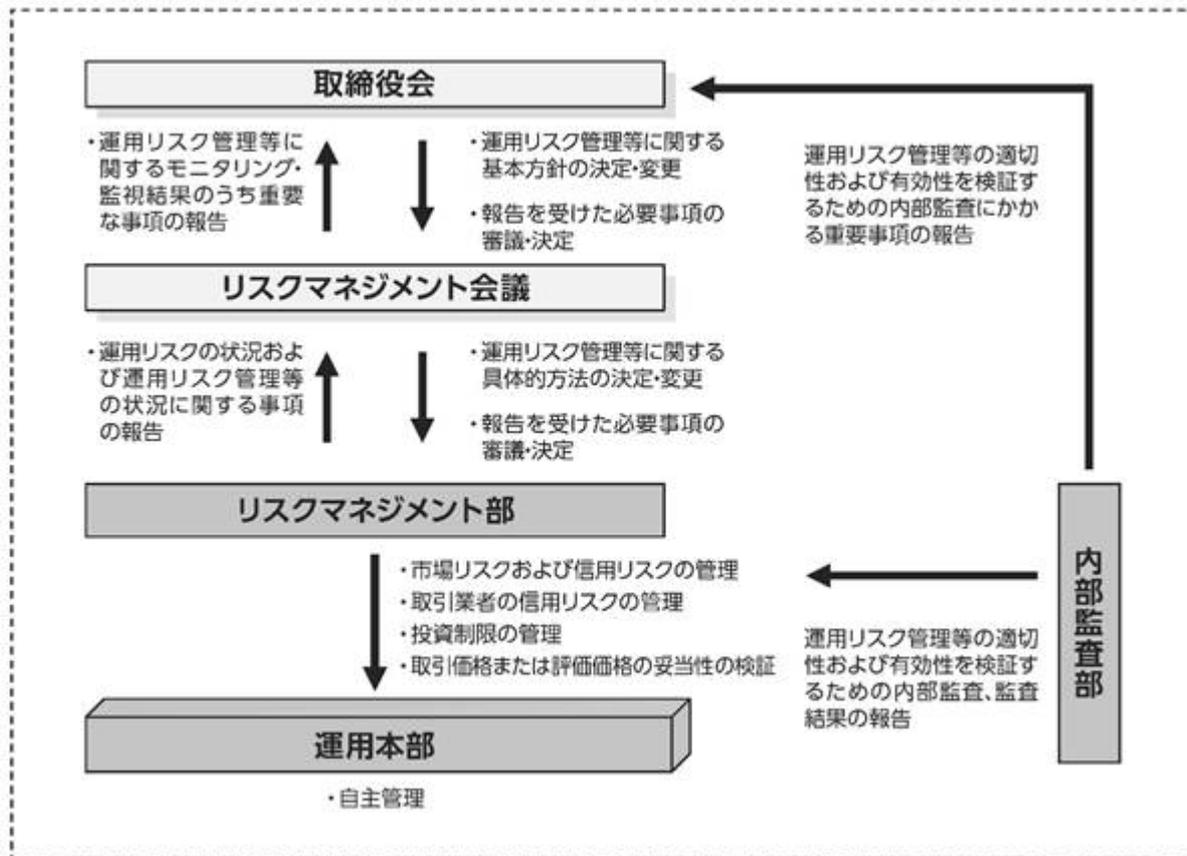
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

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

## (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年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年における年間騰落率の推移を表示しています。



※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：NOMJURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円ベース)

### ※指数について

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

「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0.242%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬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、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.10%（税抜）	年率0.10%（税抜）	年率0.02%（税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、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。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

#### < マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

#### イ．収益分配金に対する課税

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

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（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「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたN I S Aをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた

配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

「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、年間40万円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20年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。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

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。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2021年3月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】 (2021年3月31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	28,529,547,480	99.02
内 日本	28,529,547,480	99.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	283,205,570	0.98
純資産総額	28,812,753,050	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】 (2021年3月31日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,430,418,039	2.1214 3,034,540,810	2.5793 3,689,477,247	12.81
2	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,114,336,327	2.7095 3,019,315,505	3.2620 3,634,965,098	12.62
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	1,033,603,779	2.8466 2,942,270,152	3.4778 3,594,667,222	12.48
4	ダイワ新興国株式ファンダメン タル・インデックス・マザーファ ンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,955,044,887	1.3864 2,710,585,519	1.8118 3,542,150,326	12.29
5	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	1,150,862,751	3.0371 3,495,310,952	3.0706 3,533,839,163	12.26
6	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	2,681,084,270	1.0713 2,872,367,101	1.3165 3,529,647,441	12.25

7	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	2,737,195,238	1.2880 3,525,674,764	1.2863 3,520,854,234	12.22
8	ダイワ新興国債券インデック ス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	2,487,644,948	1.3627 3,390,033,027	1.4005 3,483,946,749	12.09

(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	99.02%
合計	99.02%

(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。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年9月7日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
第2計算期間末 (2018年9月7日)	9,247,296,645	9,247,296,645	1.1443	1.1443
第3計算期間末 (2019年9月9日)	15,633,295,158	15,633,295,158	1.2108	1.2108
2020年3月末日	17,380,415,834	-	1.0653	-
4月末日	18,645,696,775	-	1.1022	-
5月末日	20,010,201,025	-	1.1412	-
6月末日	20,726,874,162	-	1.1534	-
7月末日	21,385,709,402	-	1.1619	-

8月末日	22,538,124,977	-	1.1988	-
第4計算期間末 (2020年9月7日)	22,486,955,149	22,486,955,149	1.1937	1.1937
9月末日	22,619,770,278	-	1.1764	-
10月末日	22,641,088,114	-	1.1550	-
11月末日	24,457,780,705	-	1.2375	-
12月末日	25,471,096,067	-	1.2679	-
2021年1月末日	26,220,581,111	-	1.2876	-
2月末日	27,235,384,654	-	1.3225	-
3月末日	28,812,753,050	-	1.3706	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
2020年9月8日～ 2021年3月7日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.8
第2計算期間	2.3
第3計算期間	5.8
第4計算期間	1.4
2020年9月8日～ 2021年3月7日	10.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,119,041,794	1,173,761,616
第2計算期間	5,936,562,291	1,810,640,911
第3計算期間	6,888,328,647	2,057,961,207
第4計算期間	9,224,765,978	3,298,328,374
2020年9月8日～ 2021年3月7日	4,019,672,590	2,206,701,747

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

## トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2021年3月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		172,478,466,130	98.08
	内 日本	172,478,466,130	98.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,384,490,633	1.92
純資産総額		175,862,956,763	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)		4,865,460,000	2.77
	内 日本	4,865,460,000	2.77

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

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

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

## (2) 投資資産 (2021年3月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	652,100	7,084.05 4,619,511,103	8,616.00 5,618,493,600	3.19
2 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	501,300	6,409.17 3,212,918,349	9,330.00 4,677,129,000	2.66
3 ソニー	日本	株式	電気機 器	403,300	8,236.50 3,321,781,969	11,595.00 4,676,263,500	2.66
4 キーエンス	日本	株式	電気機 器	63,200	47,308.57 2,989,902,084	50,270.00 3,177,064,000	1.81
5 三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,342,600	440.53 1,913,084,206	591.70 2,569,516,420	1.46

6	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	440,600	4,296.76 1,893,153,241	5,401.00 2,379,680,600	1.35
7	任天堂	日本	株式	その他製品	36,800	60,420.00 2,223,456,000	61,810.00 2,274,608,000	1.29
8	信越化学	日本	株式	化学	116,600	14,413.66 1,680,633,420	18,610.00 2,169,926,000	1.23
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	535,600	3,920.02 2,099,567,121	3,985.00 2,134,366,000	1.21
10	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	738,900	2,241.07 1,655,928,795	2,842.00 2,099,953,800	1.19
11	日本電産	日本	株式	電気機器	154,900	9,763.22 1,512,324,032	13,435.00 2,081,081,500	1.18
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	82,000	19,569.77 1,604,721,177	22,320.00 1,830,240,000	1.04
13	第一三共	日本	株式	医薬品	552,600	3,255.97 1,799,250,631	3,225.00 1,782,135,000	1.01
14	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	37,700	26,970.06 1,016,771,443	46,790.00 1,763,983,000	1.00
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	439,200	3,078.43 1,352,047,455	4,007.00 1,759,874,400	1.00
16	KDDI	日本	株式	情報・通信業	506,700	2,802.85 1,420,205,927	3,395.00 1,720,246,500	0.98
17	本田技研	日本	株式	輸送用機器	506,800	2,545.25 1,289,933,333	3,319.00 1,682,069,200	0.96
18	村田製作所	日本	株式	電気機器	189,100	6,871.54 1,299,409,642	8,842.00 1,672,022,200	0.95
19	HOYA	日本	株式	精密機器	127,500	11,714.29 1,493,572,546	13,005.00 1,658,137,500	0.94
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	443,400	2,766.78 1,226,793,721	3,587.00 1,590,475,800	0.90
21	日立	日本	株式	電気機器	309,400	3,703.39 1,145,830,644	5,004.00 1,548,237,600	0.88
22	ファナック	日本	株式	電気機器	56,500	20,432.58 1,154,441,183	26,185.00 1,479,452,500	0.84
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	862,000	1,386.43 1,195,103,897	1,599.00 1,378,338,000	0.78
24	S M C	日本	株式	機械	18,800	58,116.84 1,092,596,639	64,310.00 1,209,028,000	0.69
25	三菱商事	日本	株式	卸売業	386,000	2,622.69 1,012,359,801	3,130.00 1,208,180,000	0.69

26	三井物産	日本	株式	卸売業	514,700	1,888.47 971,996,382	2,302.00 1,184,839,400	0.67
27	花王	日本	株式	化学	154,000	8,192.42 1,261,633,392	7,313.00 1,126,202,000	0.64
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	210,500	4,854.60 1,021,893,534	5,265.00 1,108,282,500	0.63
29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	248,000	3,376.67 837,416,045	4,463.00 1,106,824,000	0.63
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	65,400	15,148.80 990,732,085	16,625.00 1,087,275,000	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.08%
合計	98.08%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.17%
建設業	2.36%
食料品	3.26%
繊維製品	0.48%
パルプ・紙	0.25%
化学	7.24%
医薬品	5.40%
石油・石炭製品	0.44%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	0.81%
鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.75%
金属製品	0.62%
機械	5.56%
電気機器	17.14%
輸送用機器	7.22%
精密機器	2.50%
その他製品	2.32%

電気・ガス業	1.34%
陸運業	3.35%
海運業	0.23%
空運業	0.45%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	9.05%
卸売業	4.70%
小売業	4.61%
銀行業	5.07%
証券、商品先物取引業	0.77%
保険業	1.82%
その他金融業	1.13%
不動産業	1.97%
サービス業	5.46%
合計	98.08%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2021年6月	買建	249	4,823,559,850	4,865,460,000	2.77%

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

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

#### ダイワJ-REITマザーファンド

#### (1) 投資状況 (2021年3月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	446,711,775,330	97.55

	内 日本	446,711,775,330	97.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		11,233,715,830	2.45
純資産総額		457,945,491,160	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	11,225,200,000	2.45
内 日本	11,225,200,000	2.45

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

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

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

## (2) 投資資産 (2021年3月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	46,403	673,833.62 31,267,901,919	651,000.00 30,208,353,000	6.60
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	41,231	674,930.19 27,828,047,054	653,000.00 26,923,843,000	5.88
3	GLP投資法人	日本	投資証券	128,836	163,562.92 21,072,793,146	181,800.00 23,422,384,800	5.11
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	205,367	108,427.03 22,267,335,670	113,100.00 23,227,007,700	5.07
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	65,183	316,864.10 20,654,153,213	355,500.00 23,172,556,500	5.06
6	野村不動産マスターF	日本	投資証券	133,330	172,061.13 22,940,910,475	166,400.00 22,186,112,000	4.84
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	58,827	288,081.11 16,946,947,769	297,100.00 17,477,501,700	3.82
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	82,151	184,079.13 15,122,285,298	192,400.00 15,805,852,400	3.45
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,163	325,221.62 12,736,654,477	347,000.00 13,589,561,000	2.97

10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	88,176	147,123.52 12,972,764,125	148,600.00 13,102,953,600	2.86
11	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	121,269	86,240.37 10,458,283,539	92,000.00 11,156,748,000	2.44
12	産業ファンド	日本	投資証券	58,281	178,201.96 10,385,788,769	189,900.00 11,067,561,900	2.42
13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	25,670	394,661.81 10,130,968,838	413,000.00 10,601,710,000	2.32
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,755	754,253.36 9,620,501,715	787,000.00 10,038,185,000	2.19
15	API投資法人	日本	投資証券	20,660	473,028.93 9,772,777,831	485,500.00 10,030,430,000	2.19
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	14,210	608,456.04 8,646,160,439	649,000.00 9,222,290,000	2.01
17	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	26,939	302,559.83 8,150,659,440	312,000.00 8,404,968,000	1.84
18	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	132,827	60,714.29 8,064,497,868	62,300.00 8,275,122,100	1.81
19	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,390	512,287.70 7,371,820,045	547,000.00 7,871,330,000	1.72
20	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	45,947	159,672.86 7,336,489,180	167,800.00 7,709,906,600	1.68
21	森ヒルズリート	日本	投資証券	48,432	151,005.97 7,313,521,329	153,300.00 7,424,625,600	1.62
22	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	172,398	40,310.90 6,949,519,705	41,750.00 7,197,616,500	1.57
23	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,784	734,290.58 6,450,008,523	779,000.00 6,842,736,000	1.49
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,683	465,506.98 6,369,532,091	471,500.00 6,451,534,500	1.41
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	18,537	319,177.02 5,916,584,584	337,500.00 6,256,237,500	1.37
26	イオンリート投資	日本	投資証券	41,819	146,621.71 6,131,573,501	149,000.00 6,231,031,000	1.36
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	28,101	197,573.81 5,552,021,691	216,000.00 6,069,816,000	1.33
28	プレミア投資法人	日本	投資証券	37,240	149,578.19 5,570,291,803	158,100.00 5,887,644,000	1.29
29	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	53,840	106,735.64 5,746,647,227	108,600.00 5,847,024,000	1.28

30	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	33,194	171,118.94 5,680,122,289	173,300.00 5,752,520,200	1.26
----	--------------	----	------	--------	-----------------------------	-----------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.55%
合計	97.55%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2021年6月	買建	5,600	10,827,600,000	11,225,200,000	2.45%

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

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

#### ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

#### (1) 投資状況（2021年3月31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	25,381,259,330	87.67
内 日本	25,381,259,330	87.67
地方債証券	1,658,156,700	5.73
内 日本	1,658,156,700	5.73
特殊債券	830,850,100	2.87

	内 日本	830,850,100	2.87
社債券		927,163,200	3.20
	内 日本	927,163,200	3.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		154,392,220	0.53
純資産総額		28,951,821,550	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (2021年3月31日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	137 5年国債	日本	国債証券	500,000,000	100.66 503,300,000	100.59 502,975,000	0.100000 2023/09/20	1.74
2	139 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.77 433,325,300	100.70 433,010,000	0.100000 2024/03/20	1.50
3	138 5年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.76 403,058,000	100.66 402,676,000	0.100000 2023/12/20	1.39
4	135 5年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.54 402,197,100	100.46 401,852,000	0.100000 2023/03/20	1.39
5	352 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.17 364,234,800	100.82 362,959,200	0.100000 2028/09/20	1.25
6	419 2年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.41 351,454,200	100.39 351,372,000	0.100000 2022/12/01	1.21
7	141 5年国債	日本	国債証券	330,000,000	100.89 332,937,000	100.80 332,646,600	0.100000 2024/09/20	1.15
8	334 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	102.60 328,332,800	102.37 327,603,200	0.600000 2024/06/20	1.13
9	345 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.21 323,872,800	100.97 323,123,200	0.100000 2026/12/20	1.12
10	347 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	101.28 303,866,250	100.96 302,901,000	0.100000 2027/06/20	1.05
11	351 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	101.27 303,820,100	100.86 302,601,000	0.100000 2028/06/20	1.05
12	136 5年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.59 301,794,300	100.53 301,602,000	0.100000 2023/06/20	1.04

13	360 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.71 302,153,400	100.18 300,564,000	0.100000 2030/09/20	1.04
14	359 10年国債	日本	国債証券	293,000,000	100.86 295,531,200	100.32 293,937,600	0.100000 2030/06/20	1.02
15	143 5年国債	日本	国債証券	280,000,000	100.99 282,780,000	100.87 282,452,800	0.100000 2025/03/20	0.98
16	358 10年国債	日本	国債証券	275,000,000	100.88 277,443,600	100.40 276,102,750	0.100000 2030/03/20	0.95
17	145 5年国債	日本	国債証券	270,000,000	101.03 272,799,310	100.94 272,546,100	0.100000 2025/09/20	0.94
18	348 10年国債	日本	国債証券	270,000,000	101.30 273,530,700	100.94 272,540,700	0.100000 2027/09/20	0.94
19	337 10年国債	日本	国債証券	260,000,000	101.74 264,544,800	101.56 264,079,400	0.300000 2024/12/20	0.91
20	349 10年国債	日本	国債証券	250,000,000	101.38 253,460,000	100.94 252,357,500	0.100000 2027/12/20	0.87
21	353 10年国債	日本	国債証券	240,000,000	101.31 243,161,900	100.77 241,852,800	0.100000 2028/12/20	0.84
22	140 5年国債	日本	国債証券	240,000,000	100.81 241,960,400	100.75 241,821,600	0.100000 2024/06/20	0.84
23	354 10年国債	日本	国債証券	240,000,000	101.16 242,796,100	100.67 241,622,400	0.100000 2029/03/20	0.83
24	350 10年国債	日本	国債証券	230,000,000	101.39 233,208,500	100.94 232,166,600	0.100000 2028/03/20	0.80
25	133 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.43 230,995,900	100.33 230,761,300	0.100000 2022/09/20	0.80
26	361 10年国債	日本	国債証券	229,000,000	99.82 228,599,310	100.09 229,219,840	0.100000 2030/12/20	0.79
27	356 10年国債	日本	国債証券	220,000,000	101.04 222,299,750	100.54 221,207,800	0.100000 2029/09/20	0.76
28	335 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	102.40 215,054,700	102.17 214,573,800	0.500000 2024/09/20	0.74
29	343 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	101.09 212,309,460	100.96 212,034,900	0.100000 2026/06/20	0.73
30	329 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	102.38 204,760,000	102.08 204,162,000	0.800000 2023/06/20	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

国債証券	87.67%
地方債証券	5.73%
特殊債券	2.87%
社債券	3.20%
合計	99.47%

(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。

#### ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況（2021年3月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	12,322,105,763	86.20
内 中国	4,289,112,534	30.00
内 台湾	1,885,648,887	13.19
内 タイ	576,520,219	4.03
内 シンガポール	12,915,814	0.09
内 マレーシア	73,460,725	0.51
内 インドネシア	192,833,681	1.35
内 インド	1,021,922,003	7.15
内 サウジアラビア	226,513,264	1.58
内 ロシア	1,129,088,083	7.90
内 トルコ	193,466,337	1.35
内 カナダ	10,279,756	0.07
内 メキシコ	331,835,161	2.32
内 チリ	79,304,529	0.55
内 ブラジル	1,814,916,714	12.70
内 南アフリカ	484,288,056	3.39

投資証券		138,313,546	0.97
	内 アメリカ	138,313,546	0.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,834,863,760	12.84
純資産総額		14,295,283,069	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,607,441,667	11.24
内 シンガポール	181,806,855	1.27
内 アメリカ	1,425,634,812	9.97
為替予約取引(買建)	582,681,351	4.08
内 日本	582,681,351	4.08
為替予約取引(売建)	213,442,484	1.49
内 日本	213,442,484	1.49

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

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

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

(注4) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産 (2021年3月31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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	195,000	1,377.19 268,553,280	2,316.36 451,690,200	3.16
2	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技 術	809,902	387.87 314,146,061	502.46 406,943,359	2.85
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	4,272,000	85.58 365,663,735	93.98 401,499,648	2.81
4	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	5,024,000	70.17 352,579,332	79.17 397,772,186	2.78

5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費財・サービス	82,500	3,325.29 274,337,847	3,155.58 260,335,680	1.82
6	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	150,277	1,424.17 214,020,625	1,705.48 256,295,552	1.79
7	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	448,136	517.37 231,857,713	546.44 244,880,870	1.71
8	GAZPROM PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	368,139	586.87 216,092,649	652.96 240,382,832	1.68
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	178,000	1,218.92 216,971,171	1,332.15 237,123,056	1.66
10	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	422,000	443.43 187,139,276	456.58 192,677,942	1.35
11	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	348,626	456.06 159,001,174	524.21 182,755,885	1.28
12	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	20,288	8,139.73 165,140,928	8,952.01 181,618,391	1.27
13	VALE SA	ブラジル	株式	素材	89,590	1,081.86 96,925,984	1,859.86 166,624,965	1.17
14	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	19,100	7,481.11 142,889,390	8,679.28 165,774,248	1.16
15	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	346,300	444.56 153,960,922	451.79 156,455,847	1.09
16	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	49,181	2,855.08 140,415,848	3,084.53 151,700,565	1.06
17	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	55,600	2,273.42 126,444,608	2,487.65 138,313,546	0.97
18	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	938,300	137.29 128,830,104	143.84 134,972,109	0.94
19	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	3,063,000	41.49 127,126,770	41.58 127,361,990	0.89
20	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	1,911,800	48.07 91,918,611	59.80 114,340,934	0.80
21	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	2,274,000	41.58 94,586,273	44.28 100,707,274	0.70
22	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	46,824	1,249.04 58,485,538	2,105.65 98,595,237	0.69

23	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国	株式	不動産	292,000	325.55 95,065,985	296.90 86,695,968	0.61
24	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	143,300	609.86 87,395,399	588.59 84,345,692	0.59
25	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	91,500	533.81 48,845,371	867.92 79,415,412	0.56
26	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	19,590	2,877.79 56,376,036	3,960.58 77,587,919	0.54
27	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	1,852,000	38.19 70,737,347	41.01 75,952,742	0.53
28	CEMEX SAB-CPO	メキシコ	株式	素材	843,619	35.88 30,280,334	80.16 67,626,186	0.47
29	JD.COM INC-ADR	中国	株式	一般消費財・サービス	7,200	7,121.75 51,276,776	9,188.93 66,160,296	0.46
30	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	ロシア	株式	エネルギー	79,499	595.28 47,331,772	824.56 65,552,338	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	86.20%
投資証券	0.97%
合計	87.16%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	13.10%
素材	8.53%
資本財・サービス	2.62%
一般消費財・サービス	6.19%
生活必需品	3.67%
ヘルスケア	0.73%
金融	29.14%
情報技術	11.85%
コミュニケーション・サービス	4.83%
公益事業	2.59%

不動産	2.94%
合計	86.20%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMGMKT 2021年6月	買建	196	1,451,332,485	1,425,634,812	9.97%
	シンガポ ール	SGX CNX NIFTY ETS 2021 年4月	買建	55	179,179,707	181,806,855	1.27%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年4 月	買建	5,263,608	579,111,905	582,681,351	4.08%
		香港ドル売/円買 2021年 4月	売建	3,300,000	46,989,360	46,992,000	0.33%
		米ドル売/円買 2021年4 月	売建	1,500,000	166,062,450	166,050,000	1.16%
		トルコ・リラ売/円買 2021年4月	売建	30,157	401,087	400,484	0.00%

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

(注2) 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。

#### 外国株式インデックスマザーファンド

##### (1) 投資状況 (2021年3月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	178,758,396,158	92.52
内 香港	2,033,776,987	1.05
内 シンガポール	603,992,588	0.31

内 イスラエル	366,957,183	0.19
内 ノルウェー	394,991,663	0.20
内 スウェーデン	2,255,988,354	1.17
内 デンマーク	1,461,425,157	0.76
内 イギリス	8,553,962,812	4.43
内 アイルランド	428,421,254	0.22
内 オランダ	2,515,083,520	1.30
内 ベルギー	559,224,317	0.29
内 フランス	6,572,775,534	3.40
内 ドイツ	5,672,541,753	2.94
内 スイス	5,514,593,737	2.85
内 ポルトガル	92,658,003	0.05
内 スペイン	1,423,645,678	0.74
内 イタリア	1,494,847,563	0.77
内 フィンランド	602,875,338	0.31
内 オーストリア	111,410,261	0.06
内 カナダ	6,432,760,493	3.33
内 アメリカ	127,794,175,693	66.14
内 オーストラリア	3,714,819,789	1.92
内 ニュージーランド	157,468,481	0.08
投資証券	4,262,753,596	2.21
内 香港	83,050,813	0.04
内 シンガポール	90,879,948	0.05
内 イギリス	103,987,626	0.05
内 フランス	95,801,422	0.05
内 カナダ	21,771,985	0.01
内 アメリカ	3,421,693,152	1.77
内 オーストラリア	425,798,404	0.22
内 その他	19,770,246	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,194,856,178	5.28
純資産総額	193,216,005,932	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)	10,156,350,797	5.26
内 イギリス	481,626,035	0.25
内 ドイツ	1,620,146,088	0.84
内 カナダ	371,256,732	0.19

	内 アメリカ	7,386,142,752	3.82
	内 オーストラリア	297,179,190	0.15
為替予約取引(買建)		6,261,308,000	3.24
	内 日本	6,261,308,000	3.24

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

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

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

(注4) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産（2021年3月31日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	565,900	12,914.54 7,308,341,411	13,274.12 7,511,829,601	3.89
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	239,100	23,862.98 5,705,660,938	25,668.11 6,137,245,938	3.18
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	14,200	353,500.57 5,019,708,753	338,251.15 4,803,166,414	2.49
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	79,950	30,714.38 2,455,618,599	31,884.48 2,549,164,176	1.32
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	9,990	198,283.49 1,980,852,415	226,564.69 2,263,381,290	1.17
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	9,867	198,688.02 1,960,455,617	227,568.83 2,245,421,679	1.16

7	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	25,220	65,223.68 1,644,943,539	70,369.49 1,774,718,543	0.92
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	101,370	13,465.54 1,365,010,835	17,102.48 1,733,678,479	0.90
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	87,500	15,965.93 1,397,028,566	18,268.25 1,598,472,496	0.83
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	56,200	23,362.46 1,312,976,316	23,459.44 1,318,421,034	0.68
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,516	37,403.26 1,178,802,664	41,356.82 1,303,401,779	0.67
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	45,550	25,634.90 1,167,669,718	28,584.21 1,302,010,989	0.67
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	82,417	15,315.06 1,262,228,554	14,995.66 1,235,898,093	0.64
14	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	60,162	16,365.81 984,605,481	20,540.02 1,235,729,062	0.64
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	35,800	30,522.08 1,092,691,979	33,746.62 1,208,129,075	0.63
16	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	95,600	11,997.16 1,146,938,831	12,442.65 1,189,517,627	0.62
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	29,550	37,557.81 1,109,833,983	39,656.32 1,171,844,315	0.61
18	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	20,550	58,770.07 1,207,725,481	57,001.25 1,171,375,846	0.61
19	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	258,601	3,216.78 831,878,592	4,316.58 1,116,272,655	0.58
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	138,600	5,253.18 728,092,065	7,059.97 978,512,771	0.51
21	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	36,950	23,468.30 867,155,117	26,187.34 967,622,339	0.50
22	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	14,130	47,870.88 676,416,922	67,015.74 946,932,406	0.49

23	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	151,990	5,731.23 871,102,205	6,086.83 925,138,173	0.48
24	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	137,704	6,697.40 922,271,240	6,486.49 893,216,845	0.46
25	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	140,705	4,475.00 629,670,980	6,276.14 883,085,672	0.46
26	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	14,650	54,488.14 798,252,202	56,837.40 832,668,011	0.43
27	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルス ケア	23,330	35,520.75 828,699,456	35,687.18 832,581,968	0.43
28	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技 術	15,920	52,793.83 840,478,779	51,531.07 820,374,739	0.42
29	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	236,791	3,212.02 760,587,413	3,402.11 805,590,994	0.42
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	140,450	4,731.08 664,482,638	5,731.45 804,983,094	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.52%
投資証券	2.21%
合計	94.72%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.23%
素材	4.27%
資本財・サービス	9.48%
一般消費財・サービス	10.87%
生活必需品	6.86%

ヘルスケア	11.95%
金融	13.50%
情報技術	20.54%
コミュニケーション・サービス	8.48%
公益事業	2.92%
不動産	0.42%
合計	92.52%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2021年6月	買建	338	7,399,925,704	7,386,142,752	3.82%
	イギリス	FT 100 2021年6月	買建	47	480,281,730	481,626,035	0.25%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2021年6 月	買建	21	301,584,427	297,179,190	0.15%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2021 年6月	買建	19	373,167,308	371,256,732	0.19%
	ドイツ	SMI 2021年6月	買建	27	341,098,496	348,604,520	0.18%
		EURO STOXX 50 2021年6 月	買建	253	1,242,740,311	1,271,541,568	0.66%
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2021年4月	買建	1,760,000	206,091,393	206,729,600	0.11%
		カナダ・ドル買/円売 2021年4月	買建	2,650,000	225,515,557	232,590,500	0.12%
		ユーロ買/円売 2021年4 月	買建	5,580,000	720,225,775	724,284,000	0.37%
		英ポンド買/円売 2021年 4月	買建	1,340,000	200,366,828	203,961,400	0.11%
		豪ドル買/円売 2021年4 月	買建	1,650,000	136,735,443	139,177,500	0.07%
		米ドル買/円売 2021年4 月	買建	42,950,000	4,616,019,125	4,754,565,000	2.46%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

### (1) 投資状況（2021年3月31日現在）

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	281,375,001	0.75
内 アメリカ	281,375,001	0.75
投資証券	36,421,833,056	96.99
内 ガーンジー	85,229,240	0.23
内 マン島	12,779,369	0.03
内 韓国	45,207,748	0.12
内 香港	613,543,643	1.63
内 シンガポール	1,496,273,411	3.98
内 イスラエル	14,788,734	0.04
内 イギリス	2,028,819,865	5.40
内 アイルランド	44,793,785	0.12
内 オランダ	67,360,547	0.18
内 ベルギー	446,184,632	1.19
内 フランス	805,631,426	2.15
内 ドイツ	91,098,126	0.24
内 スペイン	157,246,396	0.42
内 イタリア	5,954,783	0.02
内 カナダ	722,728,493	1.92
内 アメリカ	26,992,918,383	71.88
内 オーストラリア	2,629,559,518	7.00
内 ニューゼaland	161,714,957	0.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	850,466,184	2.26
純資産総額	37,553,674,241	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

不動産投信指数先物取引(買建)	866,578,159	2.31
内 ドイツ	190,726,822	0.51
内 アメリカ	675,851,337	1.80
為替予約取引(買建)	507,086,800	1.35
内 日本	507,086,800	1.35

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

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

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

## (2) 投資資産 (2021年3月31日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	180,319	11,119.93 2,005,137,827	11,819.39 2,131,262,316	5.68
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	21,800	77,322.85 1,685,638,908	74,711.53 1,628,711,494	4.34
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	68,678	15,087.66 1,036,195,995	15,636.68 1,073,895,937	2.86
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	80,247	9,579.40 768,720,515	12,774.82 1,025,141,534	2.73
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	37,000	24,431.92 903,982,134	27,348.69 1,011,901,578	2.69
6	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	102,000	7,153.41 729,651,747	8,074.08 823,556,191	2.19
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	34,100	18,578.90 633,541,296	20,743.73 707,361,285	1.88
8	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	83,800	6,582.70 551,636,931	8,063.00 675,680,179	1.80
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	91,217	6,811.21 621,305,392	7,098.72 647,524,417	1.72
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	422,710	1,567.83 662,752,645	1,521.85 643,303,073	1.71
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,100	18,096.54 562,804,360	18,407.75 572,481,078	1.52
12	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	91,079	5,325.15 485,017,200	6,058.05 551,761,245	1.47

13	LINK REIT	香港	投資証券	518,600	978.30 507,354,259	1,033.82 536,141,126	1.43
14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	138,597	3,189.66 442,082,602	3,570.39 494,846,382	1.32
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	15,867	27,619.93 438,247,048	30,790.66 488,555,485	1.30
16	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	32,300	12,270.32 396,333,607	14,724.43 475,599,089	1.27
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	130,900	3,305.13 432,647,373	3,540.50 463,452,209	1.23
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	27,828	13,767.45 383,121,919	16,312.01 453,930,653	1.21
19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	27,300	15,539.36 424,225,885	16,586.57 452,813,421	1.21
20	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	91,300	4,260.34 388,972,610	4,702.96 429,380,321	1.14
21	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	290,230	1,380.42 400,666,930	1,437.05 417,075,370	1.11
22	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	130,500	2,850.78 372,035,198	3,123.12 407,568,348	1.09
23	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	34,400	11,268.72 387,644,755	11,404.23 392,305,756	1.04
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	72,500	4,345.14 315,027,962	4,915.52 356,375,490	0.95
25	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	42,800	7,724.12 330,596,777	7,826.08 334,956,648	0.89
26	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証券	141,700	2,195.26 311,080,929	2,350.37 333,047,897	0.89
27	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	171,500	1,619.90 277,830,288	1,915.28 328,471,035	0.87
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,305,090	242.19 316,114,534	237.05 309,373,673	0.82
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	41,200	6,522.92 268,745,757	7,165.15 295,204,229	0.79
30	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	23,700	10,835.63 256,806,348	12,297.66 291,454,703	0.78

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

投資信託受益証券	0.75%
投資証券	96.99%
合計	97.74%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFRS 2021年6月	買建	170	672,520,073	675,851,337	1.80%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFR 2021年6月	買建	178	189,741,419	190,726,822	0.51%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年4 月	買建	3,260,000	350,658,153	360,882,000	0.96%
		英ポンド買/円売 2021年 4月	買建	50,000	7,611,135	7,610,500	0.02%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2021年4月	買建	40,000	3,144,916	3,094,800	0.01%
		豪ドル買/円売 2021年4 月	買建	80,000	6,748,240	6,748,000	0.02%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2021年4月	買建	30,000	2,426,457	2,467,500	0.01%
		香港ドル買/円売 2021年 4月	買建	300,000	4,220,700	4,272,000	0.01%
		ユーロ買/円売 2021年4 月	買建	940,000	121,461,500	122,012,000	0.32%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（2021年3月31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	18,517,425,671	96.61
内 中国	1,904,487,974	9.94
内 タイ	1,631,692,825	8.51
内 マレーシア	1,367,825,873	7.14
内 フィリピン	28,604,424	0.15
内 インドネシア	1,812,853,709	9.46
内 ポーランド	1,458,073,261	7.61
内 ロシア	1,356,389,770	7.08
内 ハンガリー	728,441,368	3.80
内 ルーマニア	550,376,295	2.87
内 トルコ	311,882,239	1.63
内 チェコ	712,941,329	3.72
内 メキシコ	1,778,536,868	9.28
内 ドミニカ共和国	23,125,091	0.12
内 コロンビア	920,995,354	4.81
内 ベルギー	465,203,786	2.43
内 チリ	464,040,214	2.42
内 ブラジル	1,529,817,559	7.98
内 ウルグアイ	21,037,313	0.11
内 南アフリカ	1,451,100,419	7.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	649,921,236	3.39
純資産総額	19,167,346,907	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)	320,749,553	1.67
内 日本	320,749,553	1.67
為替予約取引(売建)	33,640,000	0.18
内 日本	33,640,000	0.18

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

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

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

## (2) 投資資産（2021年3月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	25,700,000	84.32 415,207,888	81.28 400,247,245	- 2024/01/01	2.09
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	34,550,000	114.42 293,349,473	113.58 291,174,823	10.500000 2026/12/21	1.52
3	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	12,210,000	112.78 263,855,606	105.32 246,389,399	10.000000 2023/01/01	1.29
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	10,690,000	117.67 241,028,114	105.52 216,142,871	10.000000 2025/01/01	1.13
5	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	12,700,000	87.56 213,083,399	85.21 207,345,630	- 2023/07/01	1.08
6	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	30,730,000	119.44 197,467,046	111.77 184,799,661	8.500000 2029/05/31	0.96
7	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	9,150,000	117.27 205,603,508	105.12 184,300,595	10.000000 2027/01/01	0.96
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	26,900,000	91.92 183,477,211	91.00 181,640,167	8.000000 2030/01/31	0.95
9	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債証 券	5,990,000	109.48 182,710,947	108.34 180,799,308	2.500000 2026/07/25	0.94
10	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	30,230,000	112.22 182,519,822	106.12 172,603,819	7.500000 2027/06/03	0.90
11	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	31,450,000	103.41 174,977,522	101.80 172,248,310	6.500000 2022/06/09	0.90
12	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	29,520,000	77.49 169,737,236	77.93 170,707,577	8.750000 2048/02/28	0.89
13	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債証 券	5,450,000	112.99 171,560,626	110.47 167,734,333	2.750000 2029/10/25	0.88
14	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	30,900,000	103.16 171,511,455	98.80 164,257,070	5.750000 2026/03/05	0.86

15	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,500,000	108.01 165,505,255	106.53 163,246,645	2.500000 2024/04/25	0.85
16	China Government Bond	中国	国債証券	9,350,000	98.63 155,303,734	98.93 155,781,838	2.360000 2023/07/02	0.81
17	China Government Bond	中国	国債証券	9,400,000	95.88 151,776,212	95.54 151,235,998	2.680000 2030/05/21	0.79
18	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	24,150,000	120.74 156,879,056	114.05 148,190,838	10.000000 2024/12/05	0.77
19	Colombian TES	コロンビア	国債証券	5,090,000,000	103.03 155,759,588	97.17 146,899,339	6.000000 2028/04/28	0.77
20	China Government Bond	中国	国債証券	8,600,000	98.07 142,037,049	98.06 142,021,655	2.850000 2027/06/04	0.74
21	China Government Bond	中国	国債証券	8,200,000	101.87 140,680,305	100.66 139,010,427	3.290000 2029/05/23	0.73
22	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,310,000,000	115.66 148,056,736	108.34 138,689,184	7.500000 2026/08/26	0.72
23	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,500,000	111.37 139,625,822	109.92 137,812,972	2.750000 2028/04/25	0.72
24	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,500,000	105.82 132,669,041	104.48 130,989,083	2.500000 2023/01/25	0.68
25	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,750,000	110.54 135,296,656	106.54 130,406,976	8.000000 2023/12/07	0.68
26	China Government Bond	中国	国債証券	8,000,000	96.54 130,064,548	95.91 129,215,340	1.990000 2025/04/09	0.67
27	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	23,000,000	105.12 130,084,002	103.27 127,796,197	6.750000 2023/03/09	0.67
28	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,000,000	112.38 133,016,518	107.10 126,767,110	8.000000 2024/09/05	0.66
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	16,000,000,000	101.35 124,870,399	102.53 126,320,656	6.500000 2025/06/15	0.66
30	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	19,600,000	86.71 126,118,067	86.38 125,634,341	8.250000 2032/03/31	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.61%
合計	96.61%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ハンガリー・フォリント買/円売 2021年4月	買建	62,027,000	22,312,352	22,131,233	0.12%
		マレーシア・リングギット買/円売 2021年4月	買建	600,000	15,923,760	15,984,000	0.08%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2021年4月	買建	2,478,000	70,669,438	69,012,300	0.36%
		南アフリカ・ランド買/円売 2021年4月	買建	1,762,000	12,600,969	13,056,420	0.07%
		インドネシア・ルピア買/円売 2021年4月	買建	2,400,000,000	18,230,400	18,480,000	0.10%
		メキシコ・ペソ買/円売 2021年4月	買建	3,402,000	17,485,189	18,268,740	0.10%
		タイ・バーツ買/円売 2021年4月	買建	6,600,000	23,241,240	23,298,000	0.12%
		米ドル買/円売 2021年4月	買建	190,000	21,034,577	21,033,000	0.11%
		チェコ・コルナ買/円売 2021年4月	買建	6,241,000	30,956,649	30,955,360	0.16%
		ルーマニア・レイ買/円売 2021年4月	買建	2,770,000	73,076,390	72,966,300	0.38%
		トルコ・リラ買/円売 2021年4月	買建	1,180,000	16,872,110	15,564,200	0.08%
オフショア人民元売/円買 2021年4月	売建	2,000,000	33,664,400	33,640,000	0.18%		

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

(注2) 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。

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（2021年3月31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	217,180,430,472	98.41
内 ユーロ	89,493,213,905	40.55
内 シンガポール	936,010,634	0.42
内 マレーシア	1,043,914,017	0.47
内 イスラエル	916,970,899	0.42
内 ノルウェー	533,364,190	0.24
内 スウェーデン	703,029,320	0.32
内 デンマーク	1,061,676,714	0.48
内 イギリス	14,551,369,282	6.59
内 ポーランド	1,363,946,949	0.62
内 カナダ	4,380,621,916	1.98
内 アメリカ	95,479,226,448	43.26
内 メキシコ	1,669,965,000	0.76
内 オーストラリア	5,047,121,198	2.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,514,839,670	1.59
純資産総額	220,695,270,142	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,718,919,130	0.78
内 日本	1,718,919,130	0.78

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

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

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

## (2) 投資資産（2021年3月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
-----	----	----	--------------------------	-------------------	-------------------	--------------------------	-----------------

1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	99.33 1,077,760,737	92.59 1,004,595,160	0.875000 2030/11/15	0.46
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	98.10 1,086,076,171	90.73 1,004,516,114	0.625000 2030/08/15	0.46
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,887,000	128.09 978,815,653	123.97 947,348,673	2.500000 2030/05/25	0.43
4	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,864,000	189.46 950,236,434	176.70 886,233,902	4.500000 2041/04/25	0.40
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,700,000	116.60 864,896,079	110.14 816,971,159	2.875000 2028/08/15	0.37
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,500,000	99.60 827,078,429	98.07 814,366,153	0.250000 2025/06/30	0.37
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	116.28 836,833,087	110.07 792,080,230	2.875000 2028/05/15	0.36
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,600,000	115.31 842,568,640	108.28 791,252,562	2.625000 2029/02/15	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,800,000	98.33 849,160,092	91.10 786,691,753	0.625000 2030/05/15	0.36
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,350,000	114.92 807,958,270	109.20 767,706,372	2.750000 2028/02/15	0.35
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,900,000	107.46 820,885,865	100.46 767,474,047	1.625000 2029/08/15	0.35
12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,571,000	173.86 805,901,015	164.09 760,587,711	4.000000 2037/01/04	0.34
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	111.71 791,514,502	107.00 758,191,678	2.375000 2027/05/15	0.34
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,668,000	102.86 759,349,354	102.44 756,234,090	1.625000 2022/11/15	0.34
15	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,730,000	101.88 757,788,637	101.45 754,590,495	- 2023/04/14	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	96.94 751,258,166	95.98 743,847,204	0.750000 2028/01/31	0.34
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,920,000	119.56 763,561,220	115.33 736,547,763	1.500000 2031/05/25	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,162,000	107.84 735,699,575	106.52 726,694,601	2.375000 2024/08/15	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,086,000	110.45 729,182,820	109.12 720,396,053	2.250000 2024/05/25	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	103.67 721,640,852	103.12 717,784,825	2.000000 2022/11/30	0.33

21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,101,000	108.38 717,647,570	107.13 709,338,092	1.000000 2025/11/25	0.32
22	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,448,000	163.79 733,065,177	158.16 707,877,041	5.500000 2031/01/04	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,499,000	123.39 720,572,509	120.70 704,852,031	2.750000 2027/10/25	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	99.51 716,124,867	97.64 702,632,086	0.250000 2025/09/30	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,921,000	107.71 706,106,473	106.18 696,070,555	2.250000 2024/11/15	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,900,000	111.12 725,856,276	106.10 693,092,316	2.250000 2027/08/15	0.31
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,950,000	110.17 707,885,392	107.59 691,276,509	0.750000 2028/11/25	0.31
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,899,000	109.92 699,021,379	108.67 691,060,033	1.750000 2024/11/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,840,000	109.21 706,145,047	106.60 689,276,651	2.250000 2025/11/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,788,000	107.99 692,001,375	105.97 679,083,059	2.125000 2025/05/15	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	98.41%
合計	98.41%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年4月	買建	7,051,000	759,589,676	780,545,700	0.35%
		豪ドル買/円売 2021年4月	買建	105,000	8,773,590	8,856,750	0.00%
		ユーロ買/円売 2021年4月	買建	6,488,000	839,198,214	842,142,400	0.38%
		英ポンド買/円売 2021年4月	買建	574,000	86,253,575	87,374,280	0.04%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●iFree 8資産バランス

2021年3月31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	13,706円
純資産総額	288億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.6%
3カ月間	8.1%
6カ月間	16.5%
1年間	28.7%
3年間	20.5%
5年間	-
設定来	37.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年9月	第2期 18年9月	第3期 19年9月	第4期 20年9月				
分配金	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

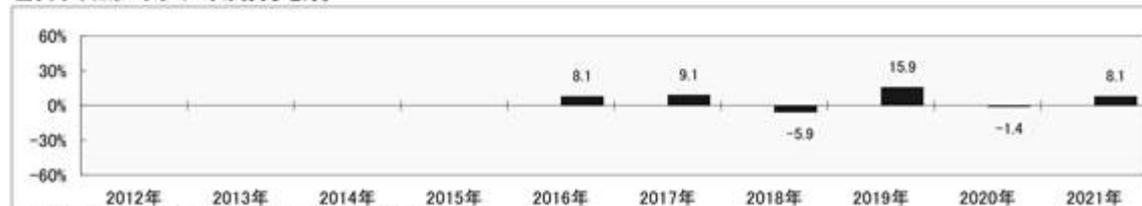
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.8%	外国株式・先物	1,627	24.2%	日本円	38.1%	MSCI EMGMKT 202106	アメリカ	1.2%
ダイワJ-REIT MF	12.6%	外国債券	1,023	23.8%	米ドル	25.9%	日本ビルファンド	日本	0.8%
外国株式INDEXMF	12.5%	外国リート・先物	331	13.0%	ユーロ	7.0%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.7%
ダイワ新興国株式 F-INDEX・MF	12.3%	国内リート・先物	62	12.6%	香港ドル	3.4%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.7%
外国債券INDEXMF	12.3%	国内株式・先物	2,138	12.4%	ブラジル・レアル	2.7%	GLP投資法人	日本	0.6%
トピックス・インデックス・MF	12.3%	国内債券	282	12.2%	英ポンド	2.1%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.6%
日本債券インデックスMF(BPD)	12.2%	外国投資信託等	11	0.2%	台湾ドル	2.1%	日本プロロジリート	日本	0.6%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.1%				オフショア人民元	1.8%	野村不動産マスターF	日本	0.6%
					メキシコ・ペソ	1.5%	EQUINIX INC	アメリカ	0.6%
		コール・ローン、その他		4.7%	その他	15.4%	APPLE INC	アメリカ	0.5%
合計	99.0%	合計	5,474	-	合計	100.0%	合計		7.1%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月8日)から年末、2021年は3月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

## 2 【換金(解約)手続等】

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

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

### <一部解約>

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、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たものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数

と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <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9月8日から翌年9月7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、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいま

す。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本 1. から 7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとし、

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金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)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)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、

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2019年9月10日から2020年9月7日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

iFree 8資産バランス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年9月9日現在	第4期 2020年9月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	8,805,078	40,515,304
コール・ローン	178,639,108	236,884,751
親投資信託受益証券	15,480,377,432	22,260,919,838
未収入金	-	5,669,000
流動資産合計	15,667,821,618	22,543,988,893
資産合計	15,667,821,618	22,543,988,893
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	17,290,452	32,340,327
未払受託者報酬	1,514,307	2,170,797
未払委託者報酬	15,143,408	21,708,390
その他未払費用	578,293	814,230
流動負債合計	34,526,460	57,033,744
負債合計	34,526,460	57,033,744
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 12,911,568,998	1 18,838,006,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,721,726,160	3,648,948,547
（分配準備積立金）	740,647,513	600,813,640
元本等合計	15,633,295,158	22,486,955,149
純資産合計	15,633,295,158	22,486,955,149
負債純資産合計	15,667,821,618	22,543,988,893

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自	2018年9月8日 至 2019年9月9日	自	2019年9月10日 至 2020年9月7日
営業収益				
受取利息		16		1,252
有価証券売買等損益		757,199,976		182,945,594
その他収益		9,082		-
営業収益合計		757,209,074		182,944,342
営業費用				
支払利息		102,587		93,084
受託者報酬		2,667,535		4,153,580
委託者報酬		26,676,147		41,536,560
その他費用		1,017,619		1,560,114
営業費用合計		30,463,888		47,343,338
営業利益又は営業損失( )		726,745,186		230,287,680
経常利益又は経常損失( )		726,745,186		230,287,680
当期純利益又は当期純損失( )		726,745,186		230,287,680
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		60,735,806		75,373,261
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,166,095,087		2,721,726,160
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,197,729,439		1,787,238,412
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,197,729,439		1,787,238,412
剰余金減少額又は欠損金増加額		308,107,746		705,101,606
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		308,107,746		705,101,606
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,721,726,160		3,648,948,547

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第4期	
	自 2019年9月10日	至 2020年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年9月7日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年9月9日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首元本額	8,081,201,558円	12,911,568,998円
期中追加設定元本額	6,888,328,647円	9,224,765,978円
期中一部解約元本額	2,057,961,207円	3,298,328,374円
2. 計算期間末日における受益権の総数	12,911,568,998口	18,838,006,602口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年9月8日 至 2019年9月9日	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(666,056,012円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,981,164,177円)及び分配準備積立金(74,591,501円)より分配対象額は2,721,811,690円(1万口当たり2,108.04円)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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,048,288,205円)及び分配準備積立金(600,813,640円)より分配対象額は3,649,101,845円(1万口当たり1,937.10円)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4期 自 2019年9月10日 至 2020年9月7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 についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第3期	第4期
	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	743,617,482	113,722,511
合計	743,617,482	113,722,511

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期	第4期
2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第4期
自 2019年9月10日
至 2020年9月7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3期	第4期
	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.2108円	1.1937円

(1万口当たり純資産額)	(12,108円)	(11,937円)
--------------	-----------	-----------

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	1,979,363,769	2,742,606,438	
	ダイワ新興国債券インデックス・マ ザーファンド	2,065,719,756	2,801,735,705	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	2,611,590,900	2,777,688,081	
	外国株式インデックスマザーファンド	981,559,457	2,786,450,986	
	外国債券インデックスマザーファンド	917,298,628	2,788,312,639	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,030,596,868	2,790,547,139	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	1,321,841,726	2,797,810,197	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	2,155,267,221	2,775,768,653	
親投資信託受益証券 合計			22,260,919,838	
合計			22,260,919,838	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

#### 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	920,724,520	2,123,832,560
コール・ローン	18,679,834,936	12,417,617,328
株式 3 4	143,418,368,822	153,692,856,715
派生商品評価勘定	35,009,360	6,183,250
未収入金	-	635,200
未収配当金	73,411,423	90,118,686
未収利息	2,053,379	2,841,197
その他未収収益 5	15,104,823	7,928,451
差入委託証拠金	-	23,625,000
流動資産合計	163,144,507,263	168,365,638,387
資産合計	163,144,507,263	168,365,638,387
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,687,560	2,404,350
前受金	20,970,000	8,432,700
未払金	453,240	-
未払解約金	85,204,320	259,193,620
受入担保金	18,345,738,651	13,624,119,620
その他未払費用	-	20,610
流動負債合計	18,454,053,771	13,894,170,900

負債合計		18,454,053,771	13,894,170,900
純資産の部			
元本等			
元本	1	144,845,005,615	145,237,517,692
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	154,552,123	9,233,949,795
元本等合計		144,690,453,492	154,471,467,487
純資産合計		144,690,453,492	154,471,467,487
負債純資産合計		163,144,507,263	168,365,638,387

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	133,142,800,795円	144,845,005,615円
期中追加設定元本額	24,777,146,793円	37,864,010,477円
期中一部解約元本額	13,074,941,973円	37,471,498,400円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス	3,981,452,767円	3,333,406,253円
ファンド		
ダイワ・トピックス・イン	7,641,426,702円	6,867,723,764円
デックスファンドV A		
適格機関投資家専用・ダイ	8,942,503円	2,658,809円
ワ・トピックスインデックス		
ファンドV A 2		
ダイワ国内重視バランスファ	60,746,661円	46,604,616円
ンド30VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国内重視バランスファ	916,911,182円	694,930,134円
ンド50VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国際分散バランスファ	49,098,482円	36,922,244円
ンド30VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国際分散バランスファ	1,292,228,501円	991,235,317円
ンド50VA(一般投資家私		
募)		
日本株式インデックスファン	31,360,033円	111,142,691円
ド(FOFs用)(適格機関投資		
家専用)		

D - I ' s T O P I Xイン デックス	40,960,686円	55,500,923円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	19,815,592円	13,272,102円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	3,797,856円	24,121,009円
i F r e e T O P I Xイン デックス	1,268,101,330円	1,955,526,936円
i F r e e 8資産バランス	1,947,225,962円	2,611,590,900円
i F r e e 年金バランス	56,205,644円	106,797,967円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	66,167,265,247円	65,767,887,875円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,958,171,733円	3,015,238,978円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,319,476,310円	3,722,562,513円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,065,450,046円	3,360,347,649円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,884,951,746円	5,142,755,615円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	14,890,058円	12,786,758円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	54,597,360円	49,666,344円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	21,081,691円	36,796,901円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	188,769,158円	720,335,780円
ダイワつみたてインデックス バランス30	198,705円	11,325,834円
ダイワつみたてインデックス バランス50	300,351円	7,141,239円
ダイワつみたてインデックス バランス70	479,367円	10,252,913円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	168,466,009円	146,777,901円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	172,376,788円	156,434,763円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,412,289,074円	8,252,862,172円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	3,092,274円	- 円

	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	832,285,188円	728,799,049円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	127,742,510円	106,898,813円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	223,926,223円	196,192,338円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	171,710,495円	179,125,727円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	9,672,817,615円	10,574,812,421円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	7,600,163,548円	9,698,721,896円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	2,571,694,149円	2,001,806,712円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,434,474,057円	1,332,052,976円
	ダイワライフスタイル25	195,535,287円	193,695,326円
	ダイワライフスタイル50	684,411,989円	675,255,051円
	ダイワライフスタイル75	560,900,654円	534,673,123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)	13,019,214,082円	11,750,877,360円
	計	144,845,005,615円	145,237,517,692円
2.	期末日における受益権の総数	144,845,005,615口	145,237,517,692口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は154,552,123円でありま す。	
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 17,639,775,940円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 12,801,083,940円

5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 518,600,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 531,280,000円
6.	5 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11,253,905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5,022,985円が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
-----	-------------

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7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	18,853,215,056	542,696,140
合計	18,853,215,056	542,696,140

(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(2018年9月20日から2019年9月9日まで、及び2019年9月20日から2020年9月7日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	1,209,035,000	-	1,242,400,000	33,365,000	767,554,700	-	771,360,000	3,805,300
合計	1,209,035,000	-	1,242,400,000	33,365,000	767,554,700	-	771,360,000	3,805,300

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	0.9989円	1.0636円
(1万口当たり純資産額)	(9,989円)	(10,636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	3,300	2,702.00	8,916,600	
日本水産	92,400	454.00	41,949,600	
マルハニチロ	13,400	2,336.00	31,302,400	
ハウスイ	500	918.00	459,000	
カネコ種苗	2,800	1,395.00	3,906,000	
サカタのタネ	11,000	3,475.00	38,225,000	貸付株式数 4,300株
ホクト	7,100	2,152.00	15,279,200	
ホクリヨウ	1,600	648.00	1,036,800	
ヒノキヤグループ	2,300	1,749.00	4,022,700	
ショーボンドHD	14,400	5,080.00	73,152,000	貸付株式数 5,700株
ミライト・ホールディングス	27,500	1,506.00	41,415,000	
タマホーム	5,000	1,272.00	6,360,000	貸付株式数 1,900株
サンヨーホームズ	1,200	636.00	763,200	貸付株式数 300株
日本アクア	3,800	622.00	2,363,600	貸付株式数 600株
ファーストコーポレーション	3,000	619.00	1,857,000	貸付株式数 500株
ベステラ	1,600	983.00	1,572,800	貸付株式数 300株
キャンディル	1,400	749.00	1,048,600	貸付株式数 500株
スペースバリューHD	11,100	385.00	4,273,500	

住石ホールディングス	18,400	118.00	2,171,200	
日鉄鉱業	2,100	4,210.00	8,841,000	
三井松島HLDGS	3,400	764.00	2,597,600	
国際石油開発帝石	371,400	640.10	237,733,140	貸付株式数 144,000株
石油資源開発	12,100	1,801.00	21,792,100	
K&Oエナジーグループ	4,500	1,514.00	6,813,000	貸付株式数 400株
ダイセキ環境ソリューション	1,800	682.00	1,227,600	貸付株式数 600株
第一カッター興業	1,100	2,218.00	2,439,800	貸付株式数 200株
明豊ファシリティワークス	2,700	650.00	1,755,000	
安藤・間	55,100	706.00	38,900,600	
東急建設	27,100	477.00	12,926,700	
コムシスホールディングス	32,800	2,842.00	93,217,600	
ピーアールホールディングス	9,900	710.00	7,029,000	
高松コンストラクションGP	5,700	2,208.00	12,585,600	貸付株式数 2,100株
東建コーポレーション	2,800	7,020.00	19,656,000	貸付株式数 1,100株
ソネック	900	845.00	760,500	貸付株式数 300株
ヤマウラ	4,000	815.00	3,260,000	貸付株式数 1,500株
大成建設	71,300	3,595.00	256,323,500	
大林組	213,800	998.00	213,372,400	
清水建設	217,000	798.00	173,166,000	
飛島建設	5,900	1,070.00	6,313,000	
長谷工コーポレーション	82,600	1,443.00	119,191,800	
松井建設	8,300	670.00	5,561,000	
銭高組	900	3,645.00	3,280,500	貸付株式数 200株
鹿島建設	167,800	1,299.00	217,972,200	
不動テトラ	5,500	1,469.00	8,079,500	
大末建設	2,300	883.00	2,030,900	
鉄建建設	4,600	2,026.00	9,319,600	
西松建設	16,400	1,987.00	32,586,800	貸付株式数 300株
三井住友建設	51,700	427.00	22,075,900	
大豊建設	4,800	2,806.00	13,468,800	
前田建設	53,500	729.00	39,001,500	
佐田建設	4,500	419.00	1,885,500	貸付株式数 800株
ナカノドー建設	5,700	373.00	2,126,100	
奥村組	11,600	2,487.00	28,849,200	
東鉄工業	9,200	2,649.00	24,370,800	
イチケン	1,500	1,562.00	2,343,000	

富士ピー・エス	3,000	634.00	1,902,000	貸付株式数	1,200株
浅沼組	2,400	4,265.00	10,236,000		
戸田建設	88,700	676.00	59,961,200	貸付株式数	34,000株
熊谷組	9,900	2,656.00	26,294,400		
北野建設	1,300	2,488.00	3,234,400		
植木組	900	2,639.00	2,375,100	貸付株式数	300株
矢作建設	9,300	852.00	7,923,600		
ピーエス三菱	7,000	590.00	4,130,000	貸付株式数	2,300株
日本ハウスHLDGS	14,200	264.00	3,748,800	貸付株式数	2,400株
大東建託	23,300	9,404.00	219,113,200	貸付株式数	5,000株
新日本建設	9,000	843.00	7,587,000		
NIPPO	17,700	2,709.00	47,949,300		
東亜道路	1,300	3,350.00	4,355,000		
前田道路	18,900	1,932.00	36,514,800		
日本道路	2,100	7,500.00	15,750,000		
東亜建設	6,700	1,612.00	10,800,400	貸付株式数	2,500株
日本国土開発	20,800	593.00	12,334,400	貸付株式数	6,100株
若築建設	3,700	1,198.00	4,432,600		
東洋建設	23,900	400.00	9,560,000	貸付株式数	1,100株
五洋建設	84,800	685.00	58,088,000		
世紀東急	10,200	803.00	8,190,600		
福田組	2,500	4,880.00	12,200,000	貸付株式数	900株
日本ドライケミカル	1,700	1,537.00	2,612,900	貸付株式数	600株
住友林業	54,100	1,652.00	89,373,200		
日本基礎技術	7,300	421.00	3,073,300		
巴コーポレーション	9,200	351.00	3,229,200	貸付株式数	1,600株
大和ハウス	211,500	2,837.00	600,025,500		
ライト工業	12,200	1,591.00	19,410,200	貸付株式数	3,500株
積水ハウス	231,600	2,052.00	475,243,200	貸付株式数	92,600株
日特建設	5,500	790.00	4,345,000		
北陸電気工事	3,700	1,029.00	3,807,300		
ユアテック	12,300	615.00	7,564,500		
日本リーテック	4,500	2,635.00	11,857,500	貸付株式数	500株
四電工	1,200	2,200.00	2,640,000		
中電工	8,700	2,246.00	19,540,200		
関電工	30,600	831.00	25,428,600		
きんでん	50,900	1,752.00	89,176,800		
東京エネシス	7,100	735.00	5,218,500		
トーエネック	2,200	3,525.00	7,755,000		
住友電設	6,100	2,285.00	13,938,500		

日本電設工業	11,700	2,150.00	25,155,000	貸付株式数	2,000株
協和エクシオ	32,400	2,650.00	85,860,000		
新日本空調	5,600	2,017.00	11,295,200		
日本工営	4,400	2,676.00	11,774,400	貸付株式数	1,100株
九電工	15,000	2,988.00	44,820,000		
三機工業	15,400	1,165.00	17,941,000		
日揮ホールディングス	65,800	1,136.00	74,748,800		
中外炉工業	2,300	1,468.00	3,376,400	貸付株式数	400株
ヤマト	6,800	637.00	4,331,600		
太平電業	5,200	2,215.00	11,518,000		
高砂熱学	18,600	1,496.00	27,825,600		
三晃金属	900	2,045.00	1,840,500		
NEC ネットエスアイ	18,900	1,870.00	35,343,000		
朝日工業社	1,400	2,767.00	3,873,800		
明星工業	13,800	790.00	10,902,000		
大気社	10,400	2,877.00	29,920,800		
ダイダン	5,100	2,591.00	13,214,100		
日比谷総合設備	6,900	1,750.00	12,075,000	貸付株式数	100株
日本製粉	20,100	1,658.00	33,325,800		
日清製粉G本社	77,300	1,666.00	128,781,800		
日東富士製粉	500	6,080.00	3,040,000		
昭和産業	6,300	3,480.00	21,924,000	貸付株式数	500株
鳥越製粉	6,000	936.00	5,616,000	貸付株式数	2,400株
中部飼料	8,400	1,583.00	13,297,200		
フィード・ワン	45,700	181.00	8,271,700		
東洋精糖	1,200	1,246.00	1,495,200		
日本甜菜糖	3,500	1,755.00	6,142,500	貸付株式数	100株
三井製糖	6,000	1,906.00	11,436,000	貸付株式数	2,200株
塩水港精糖	6,900	224.00	1,545,600	貸付株式数	2,100株
日新製糖	3,300	1,789.00	5,903,700		
LIFULL	22,600	460.00	10,396,000		
ミクシィ	12,400	2,569.00	31,855,600		
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,279.00	5,499,700	貸付株式数	100株
日本M&Aセンター	49,200	5,200.00	255,840,000		
メンバーズ	1,900	1,636.00	3,108,400		
中広	600	548.00	328,800	貸付株式数	200株
UTグループ	10,200	3,310.00	33,762,000	貸付株式数	4,000株
アイティメディア	2,600	2,300.00	5,980,000	貸付株式数	800株
タケエイ	6,200	968.00	6,001,600		

E・Jホールディングス	1,200	2,323.00	2,787,600		
ピーネックスグループ	8,100	1,184.00	9,590,400	貸付株式数	3,100株
コシダカホールディングス	15,500	436.00	6,758,000		
アルトナー	1,800	1,029.00	1,852,200	貸付株式数	300株
パソナグループ	7,000	1,456.00	10,192,000	貸付株式数	2,800株
CDS	1,600	1,305.00	2,088,000	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーション	14,600	363.00	5,299,800	貸付株式数	5,600株
GCA	7,800	643.00	5,015,400	貸付株式数	700株
エス・エム・エス	20,200	2,885.00	58,277,000		
サニーサイドアップG	2,100	712.00	1,495,200	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	65,100	1,713.00	111,516,300		
リニカル	3,200	788.00	2,521,600	貸付株式数	1,200株
クックパッド	22,600	356.00	8,045,600	貸付株式数	8,700株
エスクリ	2,000	356.00	712,000	貸付株式数	800株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	583.00	1,807,300	貸付株式数	500株
森永製菓	16,000	3,845.00	61,520,000		
中村屋	1,800	3,895.00	7,011,000	貸付株式数	300株
江崎グリコ	20,300	4,485.00	91,045,500	貸付株式数	7,800株
名糖産業	3,300	1,495.00	4,933,500	貸付株式数	1,300株
井村屋グループ	3,800	2,204.00	8,375,200	貸付株式数	600株
不二家	3,800	2,247.00	8,538,600	貸付株式数	500株
山崎製パン	51,300	1,714.00	87,928,200	貸付株式数	20,400株
第一屋製パン	1,300	982.00	1,276,600	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,390.00	5,929,000	貸付株式数	100株
亀田製菓	3,900	5,110.00	19,929,000		
寿スピリッツ	6,600	4,740.00	31,284,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,200	3,270.00	102,024,000		
森永乳業	12,600	5,020.00	63,252,000		
六甲バター	4,500	1,725.00	7,762,500	貸付株式数	500株
ヤクルト	47,000	5,610.00	263,670,000		
明治ホールディングス	45,200	7,970.00	360,244,000		
雪印メグミルク	16,500	2,279.00	37,603,500		
プリマハム	10,700	2,972.00	31,800,400	貸付株式数	2,700株
日本ハム	26,100	4,700.00	122,670,000		
林兼産業	2,300	570.00	1,311,000	貸付株式数	400株
丸大食品	7,300	1,855.00	13,541,500	貸付株式数	2,800株
S Foods	5,500	2,849.00	15,669,500		
柿安本店	2,300	2,496.00	5,740,800		
伊藤ハム米久HLDGS	44,200	680.00	30,056,000		

学情	2,400	1,046.00	2,510,400	
スタジオアリス	3,200	1,622.00	5,190,400	貸付株式数 1,200株
クロスキャット	1,800	1,276.00	2,296,800	貸付株式数 600株
シミックホールディングス	3,600	1,280.00	4,608,000	
エプコ	1,300	957.00	1,244,100	貸付株式数 300株
システナ	23,800	1,743.00	41,483,400	
N J S	1,400	1,799.00	2,518,600	貸付株式数 500株
デジタルアーツ	3,300	7,760.00	25,608,000	貸付株式数 1,300株
日鉄ソリューションズ	10,000	3,055.00	30,550,000	
総合警備保障	25,900	5,000.00	129,500,000	
キューブシステム	3,500	1,159.00	4,056,500	貸付株式数 1,400株
いちご	85,500	284.00	24,282,000	
エイジア	1,400	2,015.00	2,821,000	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	69,700	132.00	9,200,400	
コア	2,800	1,337.00	3,743,600	
カカクコム	48,100	2,654.00	127,657,400	貸付株式数 7,400株
アイロムグループ	2,400	1,944.00	4,665,600	貸付株式数 900株 (100株)
セントケア・ホールディング	4,000	670.00	2,680,000	貸付株式数 1,600株
サイネックス	1,100	770.00	847,000	
ルネサンス	3,500	957.00	3,349,500	貸付株式数 1,400株
ディップ	9,200	2,338.00	21,509,600	貸付株式数 3,600株
S B Sホールディングス	5,900	1,993.00	11,758,700	貸付株式数 800株
デジタルホールディングス	3,500	1,269.00	4,441,500	
新日本科学	7,100	682.00	4,842,200	貸付株式数 1,000株
ツクイ	15,200	621.00	9,439,200	
キャリアデザインセンター	1,700	897.00	1,524,900	
ベネフィット・ワン	23,700	2,451.00	58,088,700	貸付株式数 6,900株
エムスリー	143,600	6,340.00	910,424,000	
ツカダ・グローバルHOLD	4,000	280.00	1,120,000	貸付株式数 1,600株
プラス	700	498.00	348,600	貸付株式数 100株
アウトソーシング	37,100	950.00	35,245,000	貸付株式数 7,000株
ウェルネット	6,600	620.00	4,092,000	貸付株式数 2,600株
ワールドホールディングス	2,300	1,891.00	4,349,300	貸付株式数 100株 (100株)
ディー・エヌ・エー	27,500	1,762.00	48,455,000	
博報堂D Y H L D G S	90,500	1,360.00	123,080,000	
ぐるなび	11,300	747.00	8,441,100	貸付株式数 4,500株

タカミヤ	6,700	526.00	3,524,200	
ジャパンベストレスキュー S	5,000	961.00	4,805,000	
ファンコミュニケーションズ	18,000	459.00	8,262,000	
ライク	2,300	1,808.00	4,158,400	貸付株式数 900株
ビジネス・ブレークスルー	3,200	398.00	1,273,600	貸付株式数 1,000株
エスプール	16,600	729.00	12,101,400	
WDBホールディングス	3,000	2,889.00	8,667,000	
手間いらず	400	5,180.00	2,072,000	貸付株式数 100株
ティア	3,600	459.00	1,652,400	
CDG	700	1,724.00	1,206,800	貸付株式数 200株 (200株)
バリューコマース	3,600	3,270.00	11,772,000	貸付株式数 100株
インフォマート	71,300	719.00	51,264,700	貸付株式数 27,600株
サッポロホールディングス	23,300	1,814.00	42,266,200	貸付株式数 8,900株
アサヒグループホールディング ン	143,300	3,461.00	495,961,300	貸付株式数 57,300株
キリンHD	290,100	2,004.50	581,505,450	貸付株式数 116,000株
宝ホールディングス	50,700	1,017.00	51,561,900	
オエノンホールディングス	18,000	413.00	7,434,000	貸付株式数 3,200株
養命酒	2,100	1,801.00	3,782,100	貸付株式数 800株
コカ・コーラボトラーズJ HD	48,000	1,749.00	83,952,000	貸付株式数 19,200株
サントリー食品インター	45,800	3,805.00	174,269,000	貸付株式数 18,300株
ダイドーグループHD	3,500	5,010.00	17,535,000	貸付株式数 1,200株
伊藤園	20,800	6,410.00	133,328,000	貸付株式数 8,300株
キーコーヒー	6,700	2,178.00	14,592,600	貸付株式数 2,600株
ユニカフェ	1,600	970.00	1,552,000	
ジャパンフーズ	900	1,220.00	1,098,000	
日清オイリオグループ	8,800	3,115.00	27,412,000	
不二製油グループ	16,700	3,045.00	50,851,500	
かどや製油	800	3,590.00	2,872,000	
J-オイルミルズ	3,600	3,735.00	13,446,000	
ローソン	17,000	5,120.00	87,040,000	貸付株式数 6,800株
サンエー	5,600	4,280.00	23,968,000	貸付株式数 300株
カワチ薬品	5,200	2,781.00	14,461,200	
エービーシー・マート	10,500	5,430.00	57,015,000	貸付株式数 4,100株
ハードオフコーポレーショ ン	2,500	663.00	1,657,500	

高千穂交易	2,500	940.00	2,350,000		
アスクール	7,000	3,430.00	24,010,000	貸付株式数	900株
ゲオホールディングス	12,100	1,717.00	20,775,700		
アダストリア	9,300	1,675.00	15,577,500		
ジーフット	4,400	482.00	2,120,800	貸付株式数	700株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	440.00	440,000	貸付株式数	400株
カワニシホールディングス	700	1,366.00	956,200	貸付株式数	100株
伊藤忠食品	1,700	5,300.00	9,010,000		
くら寿司	3,500	4,940.00	17,290,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
キャンドウ	3,200	2,142.00	6,854,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,300	895.00	5,638,500		
パルグループHLDGS	6,900	1,148.00	7,921,200		
JALUX	1,800	1,595.00	2,871,000	貸付株式数	700株
エディオン	30,900	1,130.00	34,917,000	貸付株式数	12,300株 (400株)
あらた	5,300	5,100.00	27,030,000		
サーラコーポレーション	13,600	577.00	7,847,200	貸付株式数	2,300株
ワッツ	2,800	886.00	2,480,800	貸付株式数	1,100株 (400株)
トーメンデバイス	1,000	3,760.00	3,760,000	貸付株式数	400株
ハローズ	2,500	3,890.00	9,725,000	貸付株式数	900株
J Pホールディングス	20,200	284.00	5,736,800	貸付株式数	7,800株
フジオフードG本社	5,700	1,350.00	7,695,000	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,400	2,960.00	4,144,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロニクス	2,400	2,906.00	6,974,400		
ひらまつ	11,800	200.00	2,360,000		
フィールズ	4,900	328.00	1,607,200		
双日	370,700	240.00	88,968,000		
アルフレッサホールディングス	74,600	2,152.00	160,539,200		
大黒天物産	1,600	5,320.00	8,512,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	1,051.00	6,095,800	貸付株式数	2,300株
ファーマライズHD	1,500	750.00	1,125,000		
キッコーマン	49,200	5,740.00	282,408,000		
味の素	151,100	1,978.50	298,951,350		
キューピー	38,100	1,996.00	76,047,600	貸付株式数	14,700株
ハウス食品G本社	25,600	3,460.00	88,576,000		

カゴメ	26,000	3,275.00	85,150,000	貸付株式数	10,000株
焼津水産化工	3,200	918.00	2,937,600		
アリアケジャパン	6,200	7,330.00	45,446,000		
ピエトロ	800	1,690.00	1,352,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	2,241.00	3,809,700	貸付株式数	500株
やまみ	600	2,070.00	1,242,000	貸付株式数	100株
ニチレイ	32,600	2,704.00	88,150,400		
横浜冷凍	17,500	897.00	15,697,500		
東洋水産	35,200	5,690.00	200,288,000		
イトアンド	2,300	1,901.00	4,372,300	貸付株式数	900株
大冷	800	2,255.00	1,804,000	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,800	937.00	3,560,600	貸付株式数	1,500株
日清食品HD	29,100	10,180.00	296,238,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,235.00	7,599,000		
一正蒲鉾	2,600	1,021.00	2,654,600		
フジッコ	7,400	1,997.00	14,777,800		
ロックフィールド	7,300	1,316.00	9,606,800	貸付株式数	2,900株 (2,400株)
日本たばこ産業	366,400	1,963.50	719,426,400	貸付株式数	153,400株
ケンコーマヨネーズ	3,800	1,774.00	6,741,200		
わらべや日洋HD	4,400	1,476.00	6,494,400		
なとり	3,900	1,856.00	7,238,400		
イフジ産業	1,000	874.00	874,000	貸付株式数	100株
ピクルスコーポレーション	1,500	2,576.00	3,864,000	貸付株式数	300株
北の達人コーポ	23,800	537.00	12,780,600	貸付株式数	9,500株
ユーグレナ	29,400	799.00	23,490,600	貸付株式数	11,700株
スター・マイカ・HLDGS	3,300	1,250.00	4,125,000		
ADワークスグループ	15,900	159.00	2,528,100		
片倉工業	9,600	1,199.00	11,510,400		
グンゼ	4,900	3,815.00	18,693,500	貸付株式数	200株
ヒューリック	143,000	973.00	139,139,000	貸付株式数	56,900株
神栄	1,000	497.00	497,000	貸付株式数	300株
ラサ商事	3,400	941.00	3,199,400		
アルペン	5,200	1,824.00	9,484,800	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	635.00	1,206,500	貸付株式数	600株
ラクーンホールディングス	3,200	1,929.00	6,172,800	貸付株式数	1,200株
クオールホールディングス	9,800	1,161.00	11,377,800	貸付株式数	3,700株

アルコニックス	7,100	1,412.00	10,025,200		
神戸物産	23,100	5,780.00	133,518,000	貸付株式数	9,200株
ソリトンシステムズ	3,100	1,809.00	5,607,900	貸付株式数	600株
ジンスホールディングス	3,600	7,520.00	27,072,000	貸付株式数	1,400株
ビックカメラ	39,800	1,111.00	44,217,800	貸付株式数	15,200株
D C Mホールディングス	37,300	1,231.00	45,916,300	貸付株式数	14,900株
ペッパーフードサービス	5,700	411.00	2,342,700	貸付株式数	2,200株 (300株)
ハイパー	900	557.00	501,300	貸付株式数	200株
M o n o t a R O	47,700	4,200.00	200,340,000	貸付株式数	19,000株
東京一番フーズ	1,500	558.00	837,000	貸付株式数	600株 (600株)
D Dホールディングス	2,700	819.00	2,211,300	貸付株式数	1,000株
あい ホールディングス	9,500	1,793.00	17,033,500		
ディーブイエックス	2,300	900.00	2,070,000		
きちりホールディングス	1,700	640.00	1,088,000	貸付株式数	400株
アークランドサービスHD	4,900	2,110.00	10,339,000	貸付株式数	1,900株
J . フロント リテイリング	80,100	727.00	58,232,700	貸付株式数	32,000株
ドトール・日レスHD	9,900	1,648.00	16,315,200	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシH L D G S	27,700	3,610.00	99,997,000		
ブロンコビリー	3,500	2,240.00	7,840,000		
Z O Z O	46,200	2,837.00	131,069,400		
トレジャー・ファクトリー	2,000	763.00	1,526,000	貸付株式数	300株
物語コーポレーション	1,800	9,780.00	17,604,000	貸付株式数	600株 (100株)
ココカラファイン	7,000	6,130.00	42,910,000		
三越伊勢丹HD	117,300	563.00	66,039,900		
東洋紡	26,400	1,538.00	40,603,200		
ユニチカ	19,800	376.00	7,444,800		
富士紡ホールディングス	3,200	3,505.00	11,216,000		
日清紡ホールディングス	45,500	724.00	32,942,000	貸付株式数	16,700株
倉敷紡績	6,600	1,972.00	13,015,200		
ダイワボウHD	5,700	6,170.00	35,169,000		
シキボウ	4,000	975.00	3,900,000		
日東紡績	10,100	4,090.00	41,309,000	貸付株式数	1,600株
トヨタ紡織	19,900	1,507.00	29,989,300		
マクニカ・富士エレH L D G S	16,000	1,837.00	29,392,000		
H a m e e	2,400	2,397.00	5,752,800	貸付株式数	900株

ラクト・ジャパン	2,500	3,545.00	8,862,500	貸付株式数	1,000株
ウエルシアHD	40,000	4,190.00	167,600,000		
クリエイトSDH	11,300	3,600.00	40,680,000	貸付株式数	4,500株
バイタルKSKHD	12,700	1,054.00	13,385,800	貸付株式数	1,300株
八洲電機	5,100	968.00	4,936,800	貸付株式数	2,000株
メディアスホールディングス	3,700	845.00	3,126,500	貸付株式数	600株
レスターホールディングス	7,000	2,027.00	14,189,000		
ジューテックHD	1,700	997.00	1,694,900	貸付株式数	100株
丸善CHI HD	8,000	376.00	3,008,000	貸付株式数	2,800株
大光	2,800	681.00	1,906,800	貸付株式数	1,100株 (1,000株)
OCHIホールディングス	1,900	1,504.00	2,857,600		
TOKAIホールディングス	35,500	1,017.00	36,103,500	貸付株式数	14,100株
黒谷	1,600	500.00	800,000	貸付株式数	200株
ミサワ	1,600	784.00	1,254,400	貸付株式数	200株
ティーライフ	900	1,301.00	1,170,900	貸付株式数	200株
Cominix	1,100	712.00	783,200	貸付株式数	400株
エー・ピーカンパニー	1,500	408.00	612,000	貸付株式数	400株
三洋貿易	6,700	1,023.00	6,854,100		
チムニー	2,000	1,425.00	2,850,000	貸付株式数	800株
シュッピン	4,600	846.00	3,891,600	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ビューティガレージ	1,100	2,052.00	2,257,200	貸付株式数	200株
オイシックス・ラ・大地	6,600	3,280.00	21,648,000		
ウイン・パートナーズ	4,800	932.00	4,473,600	貸付株式数	100株
ネクステージ	9,600	1,071.00	10,281,600	貸付株式数	3,800株
ジョイフル本田	19,700	1,441.00	28,387,700	貸付株式数	7,600株
鳥貴族	2,300	1,492.00	3,431,600	貸付株式数	600株
キリン堂ホールディングス	2,600	2,544.00	6,614,400	貸付株式数	300株
ホットランド	4,500	1,171.00	5,269,500	貸付株式数	1,800株
すかいらーくHD	75,200	1,648.00	123,929,600	貸付株式数	30,000株 (2,800株)
SFPホールディングス	3,800	1,390.00	5,282,000	貸付株式数	600株
綿半ホールディングス	2,500	2,756.00	6,890,000	貸付株式数	900株
日本毛織	21,800	967.00	21,080,600	貸付株式数	3,700株
ダイトウボウ	12,100	111.00	1,343,100	貸付株式数	4,100株
トーア紡コーポレーション	2,600	465.00	1,209,000	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテッド	9,700	199.00	1,930,300		

ヨシックス	1,100	1,932.00	2,125,200	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパー マーケ	19,500	1,172.00	22,854,000	貸付株式数	7,800株
三栄建築設計	3,000	1,444.00	4,332,000	貸付株式数	300株
野村不動産HLDGS	40,500	2,066.00	83,673,000		
三重交通グループHD	13,300	450.00	5,985,000	貸付株式数	5,300株
サムティ	9,500	1,479.00	14,050,500	貸付株式数	3,800株
日本商業開発	4,700	1,688.00	7,933,600	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーショ ン	11,200	1,391.00	15,579,200	貸付株式数	4,100株
フィル・カンパニー	1,200	1,847.00	2,216,400		
ハウスコム	900	1,232.00	1,108,800		
日本管理センター	4,700	1,218.00	5,724,600		
サンセイランディック	2,500	717.00	1,792,500	貸付株式数	300株
エストラスト	1,400	645.00	903,000	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,600	627.00	8,527,200		
オープンハウス	19,500	3,515.00	68,542,500		
東急不動産HD	181,900	468.00	85,129,200	貸付株式数	72,700株
飯田GHD	55,900	2,085.00	116,551,500		
イーグランド	1,900	725.00	1,377,500		
帝国繊維	7,500	2,619.00	19,642,500	貸付株式数	1,300株
日本コークス工業	56,000	61.00	3,416,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	572.00	1,658,800		
ミタチ産業	2,000	562.00	1,124,000	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,000	1,743.00	5,229,000	貸付株式数	1,200株
あさひ	5,000	1,779.00	8,895,000	貸付株式数	800株
日本調剤	4,100	1,591.00	6,523,100		
コスモス薬品	5,900	17,280.00	101,952,000	貸付株式数	2,300株
シップヘルスケアHD	10,800	4,940.00	53,352,000		
トーエル	3,200	763.00	2,441,600	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイイトHD	2,900	2,628.00	7,621,200		
オンリー	1,100	506.00	556,600	貸付株式数	100株
セブン&アイ・HLDGS	262,600	3,333.00	875,245,800	貸付株式数	105,000株
クリエイイト・レストラン ツ・ホール	36,100	647.00	23,356,700	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,100	1,343.00	2,820,300		
ツルハホールディングス	14,600	14,170.00	206,882,000	貸付株式数	5,600株
デリカフーズHLDGS	2,200	682.00	1,500,400	貸付株式数	800株
スターティアホールディン グス	1,700	608.00	1,033,600	貸付株式数	500株

サンマルクホールディングス	5,300	1,651.00	8,750,300	
フェリシモ	1,400	991.00	1,387,400	貸付株式数 400株
トリドールホールディングス	16,600	1,412.00	23,439,200	貸付株式数 6,600株 (1,600株)
帝人	54,500	1,661.00	90,524,500	貸付株式数 4,900株
東レ	483,500	501.50	242,475,250	
クラレ	105,100	1,096.00	115,189,600	貸付株式数 42,000株
旭化成	442,500	928.20	410,728,500	
サカイオーベックス	1,700	1,945.00	3,306,500	
TOKYO BASE	6,000	367.00	2,202,000	貸付株式数 2,200株
稲葉製作所	3,700	1,323.00	4,895,100	貸付株式数 600株
宮地エンジニアリングG	2,000	1,600.00	3,200,000	貸付株式数 700株
トーカロ	18,700	1,063.00	19,878,100	
アルファCO	2,200	929.00	2,043,800	
SUMCO	80,100	1,415.00	113,341,500	貸付株式数 32,000株
川田テクノロジーズ	1,400	4,925.00	6,895,000	
RS TECHNOLOGIES	1,900	3,150.00	5,985,000	貸付株式数 400株
信和	3,600	700.00	2,520,000	
ビーロット	3,400	685.00	2,329,000	貸付株式数 500株
ファーストブラザーズ	1,500	870.00	1,305,000	貸付株式数 500株
ハウストゥ	3,500	1,011.00	3,538,500	貸付株式数 600株
シーアールイー	2,000	1,436.00	2,872,000	貸付株式数 600株
プロパティエージェント	1,300	1,198.00	1,557,400	貸付株式数 400株
ケイアイスター不動産	2,400	2,425.00	5,820,000	貸付株式数 800株
アグレ都市デザイン	2,200	571.00	1,256,200	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,600	2,873.00	4,596,800	貸付株式数 400株
テンポイノベーション	1,700	729.00	1,239,300	貸付株式数 600株
グローバルリンクマネジメント	1,400	605.00	847,000	貸付株式数 400株
住江織物	1,400	1,766.00	2,472,400	貸付株式数 500株
日本フェルト	3,500	469.00	1,641,500	
イチカワ	900	1,288.00	1,159,200	貸付株式数 100株
エコナックホールディングス	13,500	90.00	1,215,000	
日東製網	800	1,416.00	1,132,800	貸付株式数 100株
芦森工業	1,300	899.00	1,168,700	貸付株式数 500株
アツギ	5,300	509.00	2,697,700	
ウイルプラスHLDGS	1,100	584.00	642,400	貸付株式数 100株

J Mホールディングス	5,100	3,210.00	16,371,000	貸付株式数 1,900株 (600株)
コマダホールディングス	14,600	1,867.00	27,258,200	貸付株式数 5,600株
サツドラホールディングス	900	1,985.00	1,786,500	
アレンザホールディングス	3,300	1,338.00	4,415,400	貸付株式数 300株 (300株)
串カツ田中H L D G S	1,300	1,726.00	2,243,800	貸付株式数 500株
バロックジャパン	4,600	632.00	2,907,200	
クスリのアオキH L D G S	6,000	8,870.00	53,220,000	貸付株式数 1,900株
ダイニック	2,400	780.00	1,872,000	
共和レザー	3,600	565.00	2,034,000	
ピーバンドットコム	600	970.00	582,000	
力の源H D	3,000	688.00	2,064,000	貸付株式数 1,200株
スシローグローバルH L D G S	36,800	2,705.00	99,544,000	
アセンテック	1,400	1,952.00	2,732,800	貸付株式数 200株
セーレン	16,400	1,554.00	25,485,600	
ソトー	2,400	954.00	2,289,600	
東海染工	900	1,130.00	1,017,000	貸付株式数 100株
小松マテーレ	10,800	793.00	8,564,400	
ワコールホールディングス	16,700	1,842.00	30,761,400	
ホギメディカル	7,600	3,280.00	24,928,000	
クラウディアH L D G S	1,700	300.00	510,000	貸付株式数 600株
T S Iホールディングス	22,400	310.00	6,944,000	貸付株式数 8,500株
マツオカコーポレーション	1,900	2,071.00	3,934,900	貸付株式数 700株
ワールド	9,500	1,509.00	14,335,500	
T I S	66,800	2,062.00	137,741,600	
J N Sホールディングス	2,800	627.00	1,755,600	貸付株式数 300株
電算システム	2,500	3,650.00	9,125,000	貸付株式数 900株
グリー	40,900	449.00	18,364,100	貸付株式数 16,300株
コーエーテクモH D	13,700	4,095.00	56,101,500	
三菱総合研究所	2,900	4,035.00	11,701,500	
ボルテージ	1,900	520.00	988,000	貸付株式数 600株
電算	700	2,204.00	1,542,800	
A G S	3,700	825.00	3,052,500	
ファインデックス	5,700	1,311.00	7,472,700	貸付株式数 2,100株
ブレインパッド	1,700	3,995.00	6,791,500	貸付株式数 300株
K L a b	12,800	915.00	11,712,000	貸付株式数 5,000株
ポールトゥウィン・ピット クル	8,000	947.00	7,576,000	貸付株式数 2,700株

イーブックイニシアティブ	900	3,145.00	2,830,500	貸付株式数	300株
ネクソン	168,300	2,506.00	421,759,800	貸付株式数	72,400株
アイスタイル	18,400	304.00	5,593,600	貸付株式数	7,300株
エムアップホールディングス	1,900	3,535.00	6,716,500	貸付株式数	700株
エイチーム	4,500	932.00	4,194,000	貸付株式数	1,800株
エニグモ	6,300	1,533.00	9,657,900		
テクノスジャパン	5,300	781.00	4,139,300		
e n i s h	3,500	825.00	2,887,500	貸付株式数	1,400株
コロプラ	21,900	950.00	20,805,000	貸付株式数	8,700株 (8,700株)
オルトプラス	4,900	515.00	2,523,500	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	32,900	505.00	16,614,500	貸付株式数	13,100株
クロス・マーケティングG	3,200	330.00	1,056,000	貸付株式数	600株
デジタルハーツHLDGS	3,700	1,004.00	3,714,800	貸付株式数	1,400株
システム情報	4,900	1,222.00	5,987,800	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,100	6,900.00	14,490,000	貸付株式数	800株
じげん	16,500	356.00	5,874,000		
ブイキューブ	4,200	1,713.00	7,194,600	貸付株式数	1,600株
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	841.00	1,093,300	貸付株式数	100株
サイバーリンクス	1,200	1,876.00	2,251,200	貸付株式数	200株
ディー・エル・イー	4,300	414.00	1,780,200		
フィックスターズ	7,100	1,023.00	7,263,300	貸付株式数	2,700株
CARTA HOLDINGS	3,200	1,166.00	3,731,200	貸付株式数	1,200株
オプティム	3,500	2,856.00	9,996,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
セレス	2,300	1,851.00	4,257,300	貸付株式数	800株
SHIFT	2,700	12,330.00	33,291,000	貸付株式数	600株
特種東海製紙	4,200	4,415.00	18,543,000		
ティーガイア	6,000	2,055.00	12,330,000	貸付株式数	2,400株
セック	1,000	3,055.00	3,055,000		
日本アジアグループ	7,300	292.00	2,131,600		
テクマトリックス	9,400	2,122.00	19,946,800		
プロシップ	1,900	1,515.00	2,878,500	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	16,100	2,169.00	34,920,900	貸付株式数	6,400株
GMOペイメントゲートウェイ	14,100	10,340.00	145,794,000	貸付株式数	1,100株
ザッパラス	2,900	445.00	1,290,500	貸付株式数	1,300株

システムリサーチ	1,800	1,684.00	3,031,200	貸付株式数	700株
インターネットイニシア ティブ	9,900	4,105.00	40,639,500		
さくらインターネット	7,000	636.00	4,452,000	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	1,900	1,220.00	2,318,000		
GMOグローバルサインH D	1,200	8,060.00	9,672,000	貸付株式数	400株 (400株)
SRAホールディングス	3,600	2,349.00	8,456,400		
システムインテグレータ	2,300	713.00	1,639,900	貸付株式数	800株
朝日ネット	4,700	901.00	4,234,700		
eBASE	8,000	1,156.00	9,248,000		
アバント	6,300	1,017.00	6,407,100	貸付株式数	1,700株
アドソル日進	2,400	2,503.00	6,007,200	貸付株式数	900株
フリービット	3,700	839.00	3,104,300	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
コムチュア	7,500	2,504.00	18,780,000		
サイバーコム	1,200	1,846.00	2,215,200	貸付株式数	400株 (400株)
アステリア	4,400	810.00	3,564,000		
アイル	3,700	1,355.00	5,013,500	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	279,000	487.00	135,873,000		
日本製紙	29,600	1,321.00	39,101,600	貸付株式数	11,700株
三菱製紙	7,300	347.00	2,533,100		
北越コーポレーション	39,900	364.00	14,523,600		
中越パルプ	2,800	1,446.00	4,048,800		
巴川製紙	2,100	804.00	1,688,400		
大王製紙	29,500	1,437.00	42,391,500	貸付株式数	200株
阿波製紙	2,000	470.00	940,000		
マークライنز	3,300	2,166.00	7,147,800	貸付株式数	1,100株
メディカル・データ・ビジ	5,000	1,906.00	9,530,000	貸付株式数	2,000株
gumi	8,600	1,034.00	8,892,400	貸付株式数	1,400株
ショーケース	1,600	790.00	1,264,000	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	1,265.00	2,024,000	貸付株式数	600株
テラスカイ	2,400	4,595.00	11,028,000		
デジタル・インフォメー ション	2,900	1,214.00	3,520,600	貸付株式数	1,000株
PCIホールディングス	2,800	1,149.00	3,217,200	貸付株式数	1,000株
パイプドHD	900	1,718.00	1,546,200	貸付株式数	300株 (200株)
アイピーシー	1,400	929.00	1,300,600	貸付株式数	200株

ネオジャパン	1,200	2,845.00	3,414,000	貸付株式数	200株
P R T I M E S	1,200	2,326.00	2,791,200	貸付株式数	400株
ランドコンピュータ	1,000	1,036.00	1,036,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,500.00	4,050,000		
オープンドア	3,400	1,366.00	4,644,400	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	1,304.00	2,738,400		
アカツキ	2,400	4,050.00	9,720,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	1,838.00	919,000	貸付株式数	200株 (200株)
UBICOMホールディングス	1,600	1,923.00	3,076,800		
L I N E	20,400	5,410.00	110,364,000		
カナミックネットワーク	6,000	771.00	4,626,000		
ノムラシステムコーポレーション	3,600	398.00	1,432,800	貸付株式数	1,100株
レンゴー	63,100	783.00	49,407,300		
トーモク	4,100	1,724.00	7,068,400	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	5,000	2,805.00	14,025,000	貸付株式数	800株
チェンジ	4,600	8,220.00	37,812,000	貸付株式数	900株
シンクロ・フード	2,700	335.00	904,500	貸付株式数	100株
オークネット	4,100	1,280.00	5,248,000	貸付株式数	1,500株
セグエグループ	1,300	1,186.00	1,541,800	貸付株式数	100株
エイトレッド	1,100	1,941.00	2,135,100	貸付株式数	300株
A O I T Y O H O L D I N G S	6,700	410.00	2,747,000	貸付株式数	2,500株
マクロミル	13,500	845.00	11,407,500	貸付株式数	5,400株
ビーグリー	1,300	1,537.00	1,998,100	貸付株式数	500株 (400株)
オロ	1,700	2,999.00	5,098,300	貸付株式数	600株
ユーザーローカル	600	4,065.00	2,439,000	貸付株式数	200株
テモナ	1,300	1,517.00	1,972,100	貸付株式数	400株
ニーズウェル	1,000	732.00	732,000		
サインポスト	1,300	1,306.00	1,697,800	貸付株式数	500株
昭和電工	47,500	2,008.00	95,380,000	貸付株式数	19,000株
住友化学	490,500	360.00	176,580,000		
住友精化	3,000	3,375.00	10,125,000		
日産化学	37,100	5,560.00	206,276,000		
ラサ工業	2,300	1,668.00	3,836,400	貸付株式数	900株
クレハ	5,700	4,615.00	26,305,500		
多木化学	2,600	5,960.00	15,496,000	貸付株式数	1,000株

テイカ	4,900	1,397.00	6,845,300	
石原産業	11,900	757.00	9,008,300	
片倉コープアグリ	1,700	1,216.00	2,067,200	
日本曹達	9,900	3,035.00	30,046,500	
東ソー	103,200	1,667.00	172,034,400	
トクヤマ	19,200	2,567.00	49,286,400	
セントラル硝子	13,700	2,111.00	28,920,700	
東亜合成	42,000	1,056.00	44,352,000	貸付株式数 16,800株
大阪ソーダ	6,800	2,542.00	17,285,600	
関東電化	15,800	757.00	11,960,600	
デンカ	24,300	3,095.00	75,208,500	
イビデン	41,700	3,485.00	145,324,500	
信越化学	114,600	13,490.00	1,545,954,000	
日本カ - バイド	2,100	1,195.00	2,509,500	
堺 化 学	4,300	1,994.00	8,574,200	
第一稀元素化学工	7,100	779.00	5,530,900	
エア・ウォーター	62,100	1,459.00	90,603,900	
大陽日酸	64,200	1,769.00	113,569,800	
日本化学工業	2,100	2,255.00	4,735,500	
東邦アセチレン	900	1,260.00	1,134,000	
日本パ - カライジング	33,700	982.00	33,093,400	
高圧ガス	10,600	796.00	8,437,600	
チタン工業	900	1,710.00	1,539,000	貸付株式数 100株
四国化成	10,300	1,119.00	11,525,700	
戸田工業	1,500	2,471.00	3,706,500	貸付株式数 500株
ステラ ケミファ	3,600	2,863.00	10,306,800	貸付株式数 1,400株 (100株)
保土谷化学	2,500	4,875.00	12,187,500	
日本触媒	10,400	5,640.00	58,656,000	
大日精化	5,900	2,201.00	12,985,900	
カネカ	17,300	2,823.00	48,837,900	
協和キリン	68,600	2,809.00	192,697,400	貸付株式数 26,600株
三菱瓦斯化学	62,100	1,925.00	119,542,500	
三井化学	61,900.04	2,636.00	163,168,505	
J S R	62,200	2,401.00	149,342,200	
東京応化工業	11,400	5,040.00	57,456,000	貸付株式数 4,500株 (100株)
大阪有機化学	6,100	2,397.00	14,621,700	
三菱ケミカルH L D G S	446,500	653.50	291,787,750	
K H ネオケム	11,800	2,396.00	28,272,800	貸付株式数 4,400株

ダイセル	87,000	787.00	68,469,000	
住友ベークライト	10,500	3,010.00	31,605,000	
積水化学	141,300	1,685.00	238,090,500	
日本ゼオン	60,300	1,159.00	69,887,700	
アイカ工業	20,000	3,630.00	72,600,000	
宇部興産	33,800	1,918.00	64,828,400	
積水樹脂	12,000	2,137.00	25,644,000	
タキロンシーアイ	14,500	695.00	10,077,500	
旭有機材	3,800	1,252.00	4,757,600	
ニチバン	3,500	1,634.00	5,719,000	貸付株式数 1,400株
リケンテクノス	16,600	387.00	6,424,200	
大倉工業	3,100	1,540.00	4,774,000	貸付株式数 600株
積水化成成品	8,900	560.00	4,984,000	
群栄化学	1,500	2,321.00	3,481,500	
タイガース ポリマー	3,400	418.00	1,421,200	貸付株式数 600株
ミライアル	2,300	1,001.00	2,302,300	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,400	843.00	2,023,200	貸付株式数 400株
ダイキョーニシカワ	14,100	572.00	8,065,200	
竹本容器	2,200	969.00	2,131,800	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,600	1,690.00	6,084,000	
日本化薬	41,400	979.00	40,530,600	
カーリットホールディングス	6,900	488.00	3,367,200	貸付株式数 2,600株
E P Sホールディングス	9,000	1,011.00	9,099,000	
ソルクシーズ	3,000	1,022.00	3,066,000	貸付株式数 1,000株
レグス	1,700	976.00	1,659,200	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	24,300	904.00	21,967,200	
フェイス	2,300	1,032.00	2,373,600	
プロトコーポレーション	6,000	1,207.00	7,242,000	
ハイマックス	800	2,384.00	1,907,200	
アミューズ	3,500	2,347.00	8,214,500	
野村総合研究所	94,800	2,764.00	262,027,200	
ドリームインキュベータ	1,900	1,400.00	2,660,000	
サイバネットシステム	5,100	850.00	4,335,000	貸付株式数 400株
クイック	3,900	1,230.00	4,797,000	
T A C	4,400	230.00	1,012,000	
C Eホールディングス	4,100	562.00	2,304,200	貸付株式数 1,300株
ケネディクス	60,400	526.00	31,770,400	貸付株式数 22,900株
日本システム技術	1,200	1,748.00	2,097,600	
電通グループ	67,100	2,952.00	198,079,200	貸付株式数 26,800株

インテージホールディングス	8,400	910.00	7,644,000	貸付株式数	1,400株
テイクアンドギヴニーズ	2,400	568.00	1,363,200	貸付株式数	900株
東邦システムサイエンス	1,700	968.00	1,645,600	貸付株式数	600株
びあ	1,800	3,015.00	5,427,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,500	1,740.00	4,350,000	貸付株式数	1,000株 (200株)
ソースネクスト	31,600	297.00	9,385,200	貸付株式数	12,600株
シーティーエス	7,300	907.00	6,621,100	貸付株式数	2,900株
ネクシーズグループ	2,400	936.00	2,246,400	貸付株式数	800株
インフォコム	7,300	3,620.00	26,426,000		
メディカルシステムネットワーク	6,400	474.00	3,033,600		
日本精化	5,400	1,502.00	8,110,800		
扶桑化学工業	6,700	3,550.00	23,785,000		
トリケミカル	1,500	10,100.00	15,150,000		
HEROZ	900	3,630.00	3,267,000	貸付株式数	300株
ラクスル	5,300	3,145.00	16,668,500	貸付株式数	800株
FIG	7,700	238.00	1,832,600	貸付株式数	1,300株
システムサポート	1,400	1,606.00	2,248,400	貸付株式数	300株
ADEKA	30,900	1,536.00	47,462,400		
日油	25,100	4,060.00	101,906,000		
ミヨシ油脂	2,500	1,141.00	2,852,500	貸付株式数	400株
新日本理化	10,700	159.00	1,701,300		
ハリマ化成グループ	5,500	955.00	5,252,500		
イーソル	3,100	1,182.00	3,664,200	貸付株式数	1,200株
アルテリア・ネットワークス	7,400	1,797.00	13,297,800		
東海ソフト	400	1,236.00	494,400	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,600	1,061.00	1,697,600	貸付株式数	200株
トピラシステムズ	800	1,960.00	1,568,000	貸付株式数	200株
花王	163,200	7,860.00	1,282,752,000	貸付株式数	65,200株 (300株)
第一工業製薬	2,500	4,235.00	10,587,500	貸付株式数	900株
石原ケミカル	1,800	2,037.00	3,666,600	貸付株式数	700株
日華化学	2,200	866.00	1,905,200	貸付株式数	700株
ニイタカ	1,400	2,997.00	4,195,800	貸付株式数	500株
三洋化成	4,000	4,955.00	19,820,000		
武田薬品	567,100	3,800.00	2,154,980,000		

アステラス製薬	590,900	1,618.50	956,371,650	
大日本住友製薬	50,500	1,295.00	65,397,500	
塩野義製薬	85,700	5,777.00	495,088,900	
わかもと製薬	8,500	251.00	2,133,500	
あすか製薬	7,700	1,175.00	9,047,500	
日本新薬	17,800	8,340.00	148,452,000	
バイオエルミン製薬	1,200	2,386.00	2,863,200	
中外製薬	213,200	4,708.00	1,003,745,600	貸付株式数 85,200株
科研製薬	11,700	4,825.00	56,452,500	
エーザイ	81,600	9,405.00	767,448,000	
理研ビタミン	6,500	2,095.00	13,617,500	
ロート製薬	35,000	3,440.00	120,400,000	
小野薬品	156,500	3,139.00	491,253,500	
久光製薬	18,000	4,825.00	86,850,000	貸付株式数 7,200株
有機合成薬品	5,900	334.00	1,970,600	貸付株式数 2,000株
持田製薬	9,500	3,850.00	36,575,000	
参天製薬	127,000	1,958.00	248,666,000	
扶桑薬品	2,400	2,694.00	6,465,600	
日本ケミファ	900	2,470.00	2,223,000	
ツムラ	21,100	2,904.00	61,274,400	
日医工	19,200	1,190.00	22,848,000	貸付株式数 7,600株
テルモ	192,900	4,295.00	828,505,500	
HUGグループHD	18,200	2,692.00	48,994,400	
キッセイ薬品工業	12,100	2,282.00	27,612,200	
生化学工業	13,200	1,063.00	14,031,600	
栄研化学	11,900	1,957.00	23,288,300	
日水製薬	2,800	1,129.00	3,161,200	貸付株式数 1,100株
鳥居薬品	4,300	2,813.00	12,095,900	
JCRファーマ	4,800	11,670.00	56,016,000	
東和薬品	8,700	2,062.00	17,939,400	
富士製薬工業	4,600	1,079.00	4,963,400	
沢井製薬	14,000	5,480.00	76,720,000	
ゼリア新薬工業	12,400	1,960.00	24,304,000	
第一三共	195,000	9,294.00	1,812,330,000	
キョーリン製薬HD	15,000	2,061.00	30,915,000	
大幸薬品	8,300	2,485.00	20,625,500	
ダイト	4,200	3,375.00	14,175,000	
大塚ホールディングス	141,600	4,454.00	630,686,400	貸付株式数 56,600株
大正製薬HD	14,400	6,450.00	92,880,000	
ペプチドリーム	34,600	4,235.00	146,531,000	貸付株式数 13,800株

大日本塗料	7,500	880.00	6,600,000		
日本ペイントHOLD	55,100	9,060.00	499,206,000	貸付株式数	22,000株
関西ペイント	75,000	2,575.00	193,125,000		
神東塗料	6,800	186.00	1,264,800	貸付株式数	2,000株
中国塗料	19,000	1,005.00	19,095,000		
日本特殊塗料	5,000	956.00	4,780,000		
藤倉化成	8,900	522.00	4,645,800		
太陽ホールディングス	4,900	5,440.00	26,656,000		
D I C	28,200	2,512.00	70,838,400	貸付株式数	11,200株
サカタインクス	14,600	1,028.00	15,008,800		
東洋インキS Cホールディ ン	14,200	1,906.00	27,065,200	貸付株式数	5,600株
T & K T O K A	5,100	778.00	3,967,800	貸付株式数	1,900株
アルプス技研	5,700	1,846.00	10,522,200		
サニックス	11,400	272.00	3,100,800	貸付株式数	4,500株
ダイオーズ	1,200	1,028.00	1,233,600	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,800	723.00	4,916,400		
オリエンタルランド	69,300	14,465.00	1,002,424,500	貸付株式数	27,700株
フォーカスシステムズ	4,200	824.00	3,460,800	貸付株式数	1,600株
ダスキン	16,200	2,713.00	43,950,600		
パーク24	36,000	1,810.00	65,160,000	貸付株式数	14,400株
明光ネットワークジャパン	8,100	752.00	6,091,200	貸付株式数	3,200株
ファルコホールディングス	3,500	1,506.00	5,271,000	貸付株式数	1,400株
クレスコ	4,000	1,233.00	4,932,000		
フジ・メディア・HD	64,500	1,038.00	66,951,000		
秀英予備校	1,400	446.00	624,400		
田谷	1,200	565.00	678,000	貸付株式数	400株
ラウンドワン	18,100	825.00	14,932,500	貸付株式数	7,200株
リゾートトラスト	29,800	1,540.00	45,892,000		
オービック	23,200	18,410.00	427,112,000		
ジャストシステム	10,900	7,240.00	78,916,000		
T D C ソフト	5,900	927.00	5,469,300		
Zホールディングス	918,300	658.00	604,241,400		
ビー・エム・エル	8,300	2,826.00	23,455,800		
ワタベウェディング	1,000	270.00	270,000	貸付株式数	200株
トレンドマイクロ	35,700	6,480.00	231,336,000	貸付株式数	11,500株
りらいあコミュニケーショ	11,700	1,260.00	14,742,000		
I Dホールディングス	2,500	1,372.00	3,430,000		
リソー教育	29,600	286.00	8,465,600		
日本オラクル	13,600	11,730.00	159,528,000	貸付株式数	5,200株

早稲田アカデミー	2,800	958.00	2,682,400	貸付株式数	1,100株
アルファシステムズ	2,100	3,660.00	7,686,000	貸付株式数	700株
フューチャー	8,000	1,899.00	15,192,000	貸付株式数	3,200株
CAC HOLDINGS	4,400	1,306.00	5,746,400	貸付株式数	700株
S Bテクノロジー	2,400	3,020.00	7,248,000		
トーセ	1,800	892.00	1,605,600	貸付株式数	300株
ユー・エス・エス	72,900	1,791.00	130,563,900		
オービックビジネスC	6,800	6,130.00	41,684,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	30,400	3,755.00	114,152,000		
アイティフォー	8,100	796.00	6,447,600	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	2,300	556.00	1,278,800		
東計電算	1,000	4,425.00	4,425,000	貸付株式数	100株
サイバーエージェント	40,100	5,580.00	223,758,000		
楽天	303,500	982.00	298,037,000	貸付株式数	121,400株
エクスネット	1,100	968.00	1,064,800		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,244.00	4,229,600	貸付株式数	1,300株 (1,200株)
テー・オー・ダブリュー	10,400	313.00	3,255,200		
大塚商会	36,200	5,050.00	182,810,000	貸付株式数	14,400株
サイボウズ	7,800	3,050.00	23,790,000	貸付株式数	3,100株
ソフトブレイン	4,100	866.00	3,550,600	貸付株式数	1,600株
山田コンサルティンググループ	4,100	1,062.00	4,354,200		
セントラルスポーツ	2,400	2,375.00	5,700,000	貸付株式数	900株
パラカ	1,700	1,723.00	2,929,100	貸付株式数	600株
電通国際情報サービス	4,100	5,840.00	23,944,000	貸付株式数	1,600株
ACCESS	6,100	925.00	5,642,500	貸付株式数	1,100株
デジタルガレージ	12,000	3,180.00	38,160,000		
イーエムシステムズ	9,300	831.00	7,728,300	貸付株式数	3,600株
ウェザーニューズ	2,300	4,890.00	11,247,000	貸付株式数	800株
CIJ	4,900	841.00	4,120,900	貸付株式数	800株
ビジネスエンジニアリング	800	2,968.00	2,374,400	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	7,300	315.00	2,299,500	貸付株式数	2,800株
WOWOW	3,200	2,776.00	8,883,200	貸付株式数	1,200株
スカラ	4,600	806.00	3,707,600	貸付株式数	1,800株 (100株)
インテリジェントウェイブ	3,700	767.00	2,837,900	貸付株式数	700株
フルキャストホールディングス	6,400	1,667.00	10,668,800	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	11,500	2,963.00	34,074,500		

富士フイルムHLDGS	130,700	4,985.00	651,539,500		
コニカミノルタ	148,900	329.00	48,988,100	貸付株式数	59,500株
資生堂	135,400	6,013.00	814,160,200	貸付株式数	54,000株
ライオン	88,600	2,195.00	194,477,000	貸付株式数	35,400株
高砂香料	4,300	2,037.00	8,759,100		
マンダム	15,300	1,775.00	27,157,500		
ミルボン	9,100	5,630.00	51,233,000	貸付株式数	3,500株
ファンケル	27,600	3,560.00	98,256,000		
コーセー	12,800	12,230.00	156,544,000		
コタ	3,900	1,220.00	4,758,000		
シーボン	800	1,854.00	1,483,200	貸付株式数	300株
ポーラ・オルビスHD	29,100	1,945.00	56,599,500	貸付株式数	11,600株
ノエビアホールディングス	5,800	5,030.00	29,174,000	貸付株式数	2,300株
アジュバンコスメジャパン	1,400	972.00	1,360,800		
エステー	4,400	2,041.00	8,980,400		
アグロカネショウ	2,800	1,547.00	4,331,600		
コニシ	11,200	1,450.00	16,240,000		
長谷川香料	11,700	2,069.00	24,207,300		
星光PMC	3,800	643.00	2,443,400	貸付株式数	700株
小林製薬	19,100	9,370.00	178,967,000	貸付株式数	7,600株
荒川化学工業	6,100	1,219.00	7,435,900		
メック	4,600	1,790.00	8,234,000	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,582.00	4,647,600	貸付株式数	300株
タカラバイオ	17,800	2,796.00	49,768,800		
JCU	8,200	3,370.00	27,634,000		
新田ゼラチン	4,000	681.00	2,724,000		
OATアグリオ	1,200	1,128.00	1,353,600	貸付株式数	200株
デクセリアルズ	17,600	1,079.00	18,990,400		
アース製薬	5,100	7,740.00	39,474,000	貸付株式数	1,800株
北興化学	6,800	699.00	4,753,200	貸付株式数	2,700株
大成ラミック	2,200	2,725.00	5,995,000		
クミアイ化学	28,100	979.00	27,509,900	貸付株式数	4,700株
日本農薬	12,000	502.00	6,024,000	貸付株式数	100株
富士興産	2,200	639.00	1,405,800		
ニチレキ	8,000	1,612.00	12,896,000	貸付株式数	1,300株
ユシロ化学	3,700	1,245.00	4,606,500		
ビーピー・カストロール	2,400	1,179.00	2,829,600		
富士石油	17,700	185.00	3,274,500		
MORESCO	2,300	921.00	2,118,300	貸付株式数	900株

出光興産	75,600	2,318.00	175,240,800	
ENEOSホールディングス	1,025,700	408.20	418,690,740	
コスモエネルギーHLDGS	19,700	1,601.00	31,539,700	貸付株式数 2,300株
横浜ゴム	39,500	1,731.00	68,374,500	貸付株式数 15,400株
TOYO TIRE	39,100	1,799.00	70,340,900	貸付株式数 15,100株
ブリヂストン	181,100	3,368.00	609,944,800	貸付株式数 76,200株
住友ゴム	61,200	1,020.00	62,424,000	貸付株式数 24,400株
藤倉コンポジット	6,200	355.00	2,201,000	
オカモト	4,100	4,135.00	16,953,500	
アキレス	4,700	1,744.00	8,196,800	
フコク	3,000	636.00	1,908,000	貸付株式数 1,200株
ニッタ	7,700	2,265.00	17,440,500	
クリエートメディック	2,100	993.00	2,085,300	貸付株式数 400株
住友理工	13,300	557.00	7,408,100	
三ツ星ベルト	9,000	1,648.00	14,832,000	
バンドー化学	12,000	584.00	7,008,000	
AGC	67,400	3,015.00	203,211,000	貸付株式数 26,100株
日本板硝子	32,300	413.00	13,339,900	貸付株式数 12,900株 (200株)
石塚硝子	1,200	1,853.00	2,223,600	
有沢製作所	10,700	931.00	9,961,700	貸付株式数 700株
日本山村硝子	2,800	871.00	2,438,800	
日本電気硝子	27,400	2,026.00	55,512,400	貸付株式数 10,600株
オハラ	2,700	1,014.00	2,737,800	貸付株式数 1,000株
住友大阪セメント	12,900	3,510.00	45,279,000	
太平洋セメント	43,100	2,834.00	122,145,400	
リソルホールディングス	700	3,425.00	2,397,500	
日本ヒュ-ム	6,700	780.00	5,226,000	貸付株式数 2,600株
日本コンクリ-ト	14,600	299.00	4,365,400	
三谷セキサン	3,200	5,690.00	18,208,000	
アジアパイルHD	9,600	474.00	4,550,400	
東海カーボン	71,400	1,036.00	73,970,400	貸付株式数 27,800株
日本カーボン	3,500	3,535.00	12,372,500	貸付株式数 1,400株
東洋炭素	4,000	1,685.00	6,740,000	
ノリタケ	3,800	3,270.00	12,426,000	
TOTO	48,700	4,740.00	230,838,000	
日本碍子	81,900	1,519.00	124,406,100	
日本特殊陶業	51,900	1,869.00	97,001,100	

ダントーホールディングス	8,100	321.00	2,600,100	貸付株式数	1,700株
MARUWA	2,600	9,170.00	23,842,000		
品川リフラクトリーズ	1,800	2,298.00	4,136,400		
黒崎播磨	1,400	3,120.00	4,368,000		
ヨータイ	5,300	706.00	3,741,800	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,400	436.00	1,482,400		
東京窯業	8,400	345.00	2,898,000		
ニッカトー	3,000	631.00	1,893,000		
フジミインコーポレーテッド	6,100	3,465.00	21,136,500		
クニミネ工業	2,800	976.00	2,732,800		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,039.00	1,142,900		
ニチアス	18,600	2,441.00	45,402,600		
日本製鉄	301,700	1,108.00	334,283,600		
神戸製鋼所	123,200	428.00	52,729,600	貸付株式数	1,200株
中山製鋼所	9,400	346.00	3,252,400		
合同製鐵	3,600	2,042.00	7,351,200		
JFEホールディングス	182,000	851.00	154,882,000	貸付株式数	68,500株
東京製鐵	32,800	719.00	23,583,200		
共英製鋼	7,600	1,310.00	9,956,000		
大和工業	14,300	2,591.00	37,051,300		
東京鐵鋼	2,700	1,557.00	4,203,900		
大阪製鐵	3,600	1,042.00	3,751,200		
淀川製鋼所	9,100	1,847.00	16,807,700		
丸一鋼管	21,900	2,805.00	61,429,500	貸付株式数	8,700株
モリ工業	2,000	2,212.00	4,424,000		
大同特殊鋼	11,100	3,390.00	37,629,000		
日本高周波	2,400	337.00	808,800		
日本冶金工	5,500	1,563.00	8,596,500		
山陽特殊製鋼	4,600	942.00	4,333,200		
愛知製鋼	3,800	2,536.00	9,636,800		
日立金属	72,600	1,634.00	118,628,400		
日本金属	1,600	623.00	996,800	貸付株式数	500株
大平洋金属	4,500	1,819.00	8,185,500	貸付株式数	1,700株
新日本電工	43,600	211.00	9,199,600	貸付株式数	7,300株
栗本鉄工所	3,300	1,844.00	6,085,200		
虹技	1,000	1,302.00	1,302,000	貸付株式数	300株
日本鑄鉄管	800	1,200.00	960,000		
日本製鋼所	20,400	1,537.00	31,354,800		
三菱製鋼	4,900	560.00	2,744,000		

日亜鋼業	9,700	272.00	2,638,400	
日本精線	1,100	3,300.00	3,630,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,000	543.00	1,629,000	貸付株式数 1,200株 (100株)
大紀アルミニウム	11,100	543.00	6,027,300	
日本軽金属HD	170,800	191.00	32,622,800	
三井金属	18,200	2,711.00	49,340,200	
東邦亜鉛	3,400	1,992.00	6,772,800	
三菱マテリアル	44,500	2,263.00	100,703,500	
住友鉱山	86,200	3,444.00	296,872,800	
DOWAホールディングス	17,100	3,345.00	57,199,500	
古河機金	12,000	1,087.00	13,044,000	
エス・サイエンス	37,600	45.00	1,692,000	
大阪チタニウム	6,900	965.00	6,658,500	貸付株式数 2,700株
東邦チタニウム	12,000	708.00	8,496,000	貸付株式数 4,700株 (2,800株)
UACJ	10,200	2,058.00	20,991,600	
CKサンエツ	1,400	3,295.00	4,613,000	貸付株式数 500株
古河電工	20,900	2,498.00	52,208,200	
住友電工	252,100	1,233.50	310,965,350	
フジクラ	81,200	309.00	25,090,800	
昭和電線HLDGS	7,800	1,105.00	8,619,000	
東京特殊電線	1,000	2,300.00	2,300,000	貸付株式数 400株
タツタ電線	13,300	617.00	8,206,100	
カナレ電気	1,100	1,640.00	1,804,000	貸付株式数 300株
平河ヒューテック	3,300	932.00	3,075,600	
リョービ	8,300	1,171.00	9,719,300	
アーステイ	8,600	332.00	2,855,200	
アサヒHD	11,800	3,515.00	41,477,000	
東洋製罐グループHD	42,900	1,167.00	50,064,300	
ホッカンホールディングス	3,700	1,472.00	5,446,400	
コロナ	3,700	1,011.00	3,740,700	
横河ブリッジHLDGS	12,600	1,930.00	24,318,000	
OSJBHD	33,300	236.00	7,858,800	
駒井ハルテック	1,200	1,428.00	1,713,600	
高田機工	600	2,411.00	1,446,600	
三和ホールディングス	63,600	1,140.00	72,504,000	
文化シャッタ-	19,800	755.00	14,949,000	
三協立山	8,700	931.00	8,099,700	
アルインコ	4,900	918.00	4,498,200	

東洋シヤツタ -	1,700	739.00	1,256,300		
L I X I Lグループ	99,500	1,979.00	196,910,500	貸付株式数	39,700株
日本ファイルコン	5,000	550.00	2,750,000	貸付株式数	800株
ノーリツ	14,000	1,341.00	18,774,000	貸付株式数	2,300株
長府製作所	6,900	2,067.00	14,262,300	貸付株式数	1,100株
リンナイ	13,100	9,510.00	124,581,000		
ユニプレス	13,200	895.00	11,814,000		
ダイニチ工業	3,500	687.00	2,404,500		
日東精工	9,200	441.00	4,057,200	貸付株式数	1,400株
三洋工業	800	1,918.00	1,534,400		
岡 部	13,700	789.00	10,809,300	貸付株式数	3,700株
ジーテクト	8,400	1,255.00	10,542,000	貸付株式数	2,900株
東 プ レ	12,600	1,226.00	15,447,600		
高周波熱錬	12,900	502.00	6,475,800		
東京製綱	4,700	530.00	2,491,000		
サンコール	4,900	431.00	2,111,900		
モリテックスチル	5,400	285.00	1,539,000	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,900	1,584.00	15,681,600	貸付株式数	3,700株
エイチワン	6,400	552.00	3,532,800		
日本発条	72,500	685.00	49,662,500		
中央発條	800	2,660.00	2,128,000		
アドバネクス	900	1,397.00	1,257,300	貸付株式数	300株
三浦工業	29,200	4,210.00	122,932,000		
タ ク マ	22,800	1,657.00	37,779,600		
テクノプロ・ホールディング グ	13,000	5,830.00	75,790,000	貸付株式数	5,200株
アトラ	1,700	281.00	477,700	貸付株式数	600株
インターワークス	1,600	340.00	544,000		
アイ・アールジャパンHD	2,600	13,210.00	34,346,000		
K e e P e r 技研	2,400	2,765.00	6,636,000		
ファーストロジック	1,400	782.00	1,094,800	貸付株式数	500株
三機サービス	1,300	1,053.00	1,368,900	貸付株式数	200株
G u n o s y	4,000	906.00	3,624,000	貸付株式数	1,500株
デザインワン・ジャパン	1,500	285.00	427,500	貸付株式数	600株
イー・ガーディアン	3,200	3,100.00	9,920,000		
リブセンス	4,500	283.00	1,273,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ジャパンマテリアル	20,000	1,400.00	28,000,000	貸付株式数	8,000株
ベクトル	8,200	905.00	7,421,000	貸付株式数	2,900株
ウチヤマホールディングス	3,200	302.00	966,400		

チャームケアコーポレーション	5,500	1,068.00	5,874,000	貸付株式数	1,100株 (200株)
キャリアリンク	2,400	784.00	1,881,600	貸付株式数	100株
I B J	4,500	1,043.00	4,693,500	貸付株式数	1,600株
アサンテ	2,700	1,525.00	4,117,500	貸付株式数	1,000株
N・フィールド	4,300	641.00	2,756,300		
バリューHR	2,600	1,508.00	3,920,800	貸付株式数	1,000株
M & Aキャピタルパートナー	5,300	3,755.00	19,901,500		
ライドオンエクスプレスHD	2,500	2,198.00	5,495,000	貸付株式数	900株 (900株)
E R Iホールディングス	1,800	602.00	1,083,600	貸付株式数	700株
アビスト	900	3,035.00	2,731,500	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクス	4,400	1,498.00	6,591,200	貸付株式数	1,700株
ウィルグループ	4,300	784.00	3,371,200	貸付株式数	1,600株
エスクローAJ	9,000	312.00	2,808,000	貸付株式数	3,600株
リクルートホールディングス	466,500	3,971.00	1,852,471,500		
エラン	3,800	2,446.00	9,294,800	貸付株式数	1,500株
ツガミ	13,900	1,180.00	16,402,000	貸付株式数	4,100株
オークマ	7,900	5,250.00	41,475,000		
芝浦機械	7,600	2,185.00	16,606,000		
アマダ	83,700	989.00	82,779,300		
アイダエンジニア	17,800	695.00	12,371,000		
滝澤鉄工所	2,000	1,011.00	2,022,000		
F U J I	29,000	1,879.00	54,491,000	貸付株式数	11,600株
牧野フライス	7,900	3,830.00	30,257,000		
オーエスジー	31,200	1,643.00	51,261,600	貸付株式数	12,400株
ダイジェット	700	1,400.00	980,000		
旭ダイヤモンド	17,600	509.00	8,958,400		
D M G 森精機	42,600	1,510.00	64,326,000	貸付株式数	17,000株
ソディック	15,800	733.00	11,581,400	貸付株式数	6,100株
ディスコ	9,100	23,610.00	214,851,000		
日東工器	3,700	1,996.00	7,385,200		
日進工具	2,600	2,267.00	5,894,200	貸付株式数	700株
パンチ工業	5,900	410.00	2,419,000	貸付株式数	2,300株
富士ダイス	2,900	647.00	1,876,300	貸付株式数	1,100株
土木管理総合試験	2,900	359.00	1,041,100	貸付株式数	500株
ネットマーケティング	2,300	603.00	1,386,900	貸付株式数	500株

日本郵政	534,000	761.10	406,427,400	
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,733.00	18,889,700	
鎌倉新書	4,900	894.00	4,380,600	貸付株式数 1,500株
SMN	1,300	902.00	1,172,600	
一蔵	700	359.00	251,300	貸付株式数 200株
LITALICO	2,200	2,676.00	5,887,200	貸付株式数 800株
グローバルキッズCOMP	1,000	699.00	699,000	貸付株式数 200株
エアトリ	3,300	1,351.00	4,458,300	貸付株式数 1,300株 (200株)
アトラエ	1,900	3,255.00	6,184,500	貸付株式数 100株
ストライク	2,400	4,640.00	11,136,000	貸付株式数 900株
ソラスト	18,000	1,303.00	23,454,000	
セラク	2,200	1,666.00	3,665,200	貸付株式数 800株
インソース	3,200	2,656.00	8,499,200	貸付株式数 1,200株 (900株)
豊田自動織機	55,200	6,330.00	349,416,000	
豊和工業	3,900	828.00	3,229,200	
OKK	2,700	370.00	999,000	
石川製作所	1,700	1,841.00	3,129,700	貸付株式数 600株 (600株)
東洋機械金属	4,600	402.00	1,849,200	
津田駒工業	1,200	777.00	932,400	貸付株式数 400株
エンシュウ	1,500	920.00	1,380,000	
島精機製作所	10,600	1,552.00	16,451,200	
オプトラン	7,500	2,089.00	15,667,500	貸付株式数 100株
NCホールディングス	2,000	593.00	1,186,000	貸付株式数 700株
イワキポンプ	4,200	933.00	3,918,600	
フリーー	6,500	1,036.00	6,734,000	貸付株式数 2,400株
ヤマシンフィルタ	14,600	1,205.00	17,593,000	貸付株式数 300株
日阪製作所	8,400	805.00	6,762,000	
やまびこ	13,000	1,205.00	15,665,000	
平田機工	3,200	5,820.00	18,624,000	貸付株式数 1,200株
ペガサスミシン製造	6,600	283.00	1,867,800	
マルマエ	2,700	886.00	2,392,200	貸付株式数 900株
タツモ	3,100	1,343.00	4,163,300	貸付株式数 1,200株 (500株)
ナプテスコ	39,700	3,375.00	133,987,500	貸付株式数 15,800株
三井海洋開発	7,100	1,779.00	12,630,900	貸付株式数 1,200株
レオン自動機	6,600	1,083.00	7,147,800	

S M C	21,400	57,710.00	1,234,994,000	
ホソカワミクロン	2,400	5,540.00	13,296,000	
ユニオンツール	2,500	2,781.00	6,952,500	貸付株式数 900株
オイレス工業	8,800	1,430.00	12,584,000	
日精エーエスビー	2,100	4,010.00	8,421,000	
サト - ホールディングス	9,600	2,032.00	19,507,200	
技研製作所	5,900	3,825.00	22,567,500	貸付株式数 700株
日本エアテック	2,300	1,299.00	2,987,700	貸付株式数 900株
カワタ	1,900	894.00	1,698,600	貸付株式数 700株
日精樹脂工業	5,600	862.00	4,827,200	
オカダアイヨン	2,000	980.00	1,960,000	貸付株式数 700株
ワイエイシイホールディングス	2,800	641.00	1,794,800	貸付株式数 1,100株
小松製作所	308,700	2,326.50	718,190,550	貸付株式数 108,900株
住友重機械	39,000	2,394.00	93,366,000	
日立建機	27,300	3,715.00	101,419,500	
日工	9,200	641.00	5,897,200	
巴工業	2,900	1,883.00	5,460,700	貸付株式数 400株
井関農機	6,800	1,275.00	8,670,000	
T O W A	6,800	1,066.00	7,248,800	
丸山製作所	1,800	1,266.00	2,278,800	
北川鉄工所	3,000	1,403.00	4,209,000	貸付株式数 500株
シンニッタン	10,400	213.00	2,215,200	
ローツェ	3,000	4,630.00	13,890,000	
タカキタ	2,500	661.00	1,652,500	貸付株式数 900株
クボタ	361,600	1,929.00	697,526,400	貸付株式数 144,500株
荏原実業	1,700	2,804.00	4,766,800	貸付株式数 500株
東洋エンジニア	8,700	319.00	2,775,300	
三菱化工機	2,300	1,724.00	3,965,200	
月島機械	12,600	1,186.00	14,943,600	
帝国電機製作所	5,600	1,114.00	6,238,400	
東京機械	3,100	282.00	874,200	貸付株式数 1,200株
新東工業	16,200	694.00	11,242,800	貸付株式数 6,400株
渋谷工業	6,000	3,210.00	19,260,000	貸付株式数 1,000株
アイチ コーポレーション	11,800	825.00	9,735,000	
小森コーポレーション	17,300	721.00	12,473,300	
鶴見製作所	5,200	1,834.00	9,536,800	
住友精密	1,000	2,295.00	2,295,000	貸付株式数 200株
日本ギア工業	2,400	278.00	667,200	貸付株式数 700株
酒井重工業	1,200	2,340.00	2,808,000	

荏原製作所	28,200	2,695.00	75,999,000	貸付株式数	11,200株
石井鉄工所	900	2,605.00	2,344,500		
西島製作所	6,800	825.00	5,610,000		
北越工業	7,000	1,037.00	7,259,000		
ダイキン工業	86,800	19,900.00	1,727,320,000		
オルガノ	2,400	5,520.00	13,248,000		
ト - ヨ - カネツ	3,000	2,237.00	6,711,000		
栗田工業	36,900	3,330.00	122,877,000		
椿本チエイン	9,800	2,384.00	23,363,200		
大同工業	3,200	574.00	1,836,800		
日 機 装	20,400	1,077.00	21,970,800	貸付株式数	3,700株
木村化工機	5,700	411.00	2,342,700	貸付株式数	300株
レイズネクスト	11,500	1,268.00	14,582,000		
アネスト岩田	10,600	820.00	8,692,000		
ダイフク	34,800	9,220.00	320,856,000		
サムコ	1,900	2,583.00	4,907,700	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,700	1,118.00	4,136,600		
油研工業	1,100	1,455.00	1,600,500		
タダノ	32,800	839.00	27,519,200	貸付株式数	13,000株
フジテック	24,800	2,173.00	53,890,400		
C K D	18,700	1,495.00	27,956,500		
キトー	5,200	1,183.00	6,151,600		
平和	19,100	1,805.00	34,475,500		
理想科学工業	6,000	1,421.00	8,526,000		
S A N K Y O	15,200	2,979.00	45,280,800		
日本金銭機械	7,300	537.00	3,920,100	貸付株式数	2,900株
マースグループH L D G S	4,400	1,654.00	7,277,600		
フクシマガリレイ	4,200	3,375.00	14,175,000		
オーイズミ	2,800	366.00	1,024,800		
ダイコク電機	3,100	1,025.00	3,177,500	貸付株式数	1,200株
竹内製作所	11,400	2,245.00	25,593,000	貸付株式数	4,500株
ア マ ノ	17,900	2,247.00	40,221,300		
J U K I	9,300	454.00	4,222,200	貸付株式数	1,600株
サンデンホールディングス	9,000	312.00	2,808,000	貸付株式数	3,600株
蛇の目ミシン	6,000	631.00	3,786,000		
ブラザー工業	83,200	1,712.00	142,438,400		
マックス	10,400	1,575.00	16,380,000		
モリタホールディングス	12,000	1,864.00	22,368,000		
グローリー	17,500	2,325.00	40,687,500		
新晃工業	6,300	1,382.00	8,706,600	貸付株式数	2,200株

大和冷機工業	9,800	895.00	8,771,000	貸付株式数	3,800株
セガサミーホールディングス	67,600	1,196.00	80,849,600		
日本ピストンリング	2,400	1,045.00	2,508,000		
リケン	3,100	2,677.00	8,298,700		
T P R	9,100	1,366.00	12,430,600	貸付株式数	3,400株
ツバキ・ナカシマ	13,800	898.00	12,392,400	貸付株式数	800株
ホシザキ	19,900	7,980.00	158,802,000	貸付株式数	7,900株
大豊工業	5,400	534.00	2,883,600		
日本精工	128,400	853.00	109,525,200		
N T N	157,300	210.00	33,033,000		
ジェイテクト	65,500	865.00	56,657,500		
不二越	6,400	3,490.00	22,336,000		
ミネベアミツミ	126,600	1,881.00	238,134,600		
日本トムソン	19,900	378.00	7,522,200		
T H K	39,600	2,553.00	101,098,800	貸付株式数	15,800株
ユーシン精機	5,300	680.00	3,604,000		
前澤給装工業	2,500	2,095.00	5,237,500		
イーグル工業	8,500	786.00	6,681,000		
前澤工業	4,000	468.00	1,872,000		
日本ピラ - 工業	6,800	1,473.00	10,016,400		
キッツ	27,700	610.00	16,897,000		
日立	327,500	3,565.00	1,167,537,500		
三菱電機	681,700	1,467.50	1,000,394,750		
富士電機	41,100	3,385.00	139,123,500		
東洋電機製造	2,400	1,064.00	2,553,600	貸付株式数	500株
安川電機	73,400	3,955.00	290,297,000	貸付株式数	29,300株
シンフォニアテクノロジー	8,800	1,096.00	9,644,800		
明電舎	12,500	1,633.00	20,412,500		
オリジン	1,800	1,314.00	2,365,200		
山洋電気	3,300	4,690.00	15,477,000		
デンヨー	5,800	2,183.00	12,661,400		
ベイカレントコンサルティング	3,900	12,190.00	47,541,000		
ORCHESTRA HDGS	1,600	1,668.00	2,668,800	貸付株式数	500株
アイモバイル	2,200	879.00	1,933,800	貸付株式数	800株
キャリアインデックス	2,800	465.00	1,302,000	貸付株式数	1,100株
MS - Japan	2,200	803.00	1,766,600	貸付株式数	800株

船場	1,100	893.00	982,300	貸付株式数	200株
グレイステクノロジー	3,000	4,420.00	13,260,000	貸付株式数	1,200株
ジャパンエレベーターSHD	6,800	3,660.00	24,888,000	貸付株式数	2,700株
フルテック	900	1,304.00	1,173,600	貸付株式数	200株
グリーンズ	1,800	508.00	914,400	貸付株式数	300株
ツナググループHLDGS	900	485.00	436,500	貸付株式数	200株
GAMEWITH	1,700	653.00	1,110,100	貸付株式数	200株
ソウルドアウト	1,300	1,535.00	1,995,500	貸付株式数	400株
MS&CONSULTING	1,000	778.00	778,000	貸付株式数	300株
ミダック	800	2,126.00	1,700,800		
日総工産	4,500	794.00	3,573,000		
キュービーネットHLDGS	2,900	1,947.00	5,646,300	貸付株式数	1,000株
RPAホールディングス	4,800	811.00	3,892,800	貸付株式数	1,900株
三桜工業	8,600	644.00	5,538,400	貸付株式数	3,300株
マキタ	88,900	4,935.00	438,721,500		
東芝テック	8,500	4,545.00	38,632,500		
芝浦メカトロニクス	1,200	2,989.00	3,586,800		
マブチモーター	18,900	3,680.00	69,552,000	貸付株式数	7,200株
日本電産	164,000	8,896.00	1,458,944,000		
ユーエムシーエレクトロニクス	4,200	335.00	1,407,000	貸付株式数	1,600株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,149.00	4,481,100		
東光高岳	3,700	998.00	3,692,600		
ダブル・スコープ	10,700	807.00	8,634,900	貸付株式数	4,200株
宮越ホールディングス	2,900	666.00	1,931,400	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,500	3,960.00	29,700,000		
ヤーマン	11,100	1,455.00	16,150,500	貸付株式数	4,400株
JVCケンウッド	55,100	160.00	8,816,000		
ミマキエンジニアリング	6,000	390.00	2,340,000		
I-PEX	2,800	2,153.00	6,028,400	貸付株式数	1,100株 (500株)
日新電機	16,000	1,106.00	17,696,000		
大崎電気	13,300	581.00	7,727,300		
オムロン	61,100	7,920.00	483,912,000		
日東工業	10,000	1,908.00	19,080,000		
IDEC	9,800	1,826.00	17,894,800	貸付株式数	2,400株

正興電機製作所	1,800	975.00	1,755,000	貸付株式数	600株
不二電機工業	1,000	1,320.00	1,320,000	貸付株式数	400株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,700	1,768.00	40,133,600		
サクサホールディングス	1,500	1,390.00	2,085,000	貸付株式数	300株
メルコホールディングス	2,300	2,504.00	5,759,200		
テクノメディカ	1,500	1,748.00	2,622,000	貸付株式数	300株
ダイヤモンドエレクトリク HD	1,400	524.00	733,600		
日本電気	82,700	5,270.00	435,829,000		
富士通	65,700	13,490.00	886,293,000		
沖電気	27,700	998.00	27,644,600		
岩崎通信機	2,900	836.00	2,424,400		
電気興業	3,300	2,411.00	7,956,300		
サンケン電気	7,400	2,245.00	16,613,000	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,300	1,364.00	1,773,200		
アイホン	3,800	1,337.00	5,080,600		
ルネサスエレクトロニクス	326,600	689.00	225,027,400	貸付株式数	126,800株
セイコーエプソン	84,500	1,251.00	105,709,500		
ワコム	45,800	677.00	31,006,600		
アルバック	12,500	3,860.00	48,250,000	貸付株式数	4,800株
アクセル	2,700	862.00	2,327,400		
E I Z O	5,300	3,870.00	20,511,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	51.00	3,146,700		
日本信号	17,400	1,023.00	17,800,200		
京三製作所	15,800	487.00	7,694,600	貸付株式数	6,200株
能美防災	9,000	2,100.00	18,900,000		
ホーチキ	4,900	1,190.00	5,831,000		
星和電機	3,500	575.00	2,012,500		
エレコム	7,600	4,880.00	37,088,000		
パナソニック	778,800	951.50	741,028,200		
シャープ	78,800	1,373.00	108,192,400	貸付株式数	31,500株
アンリツ	43,900	2,255.00	98,994,500	貸付株式数	17,500株
富士通ゼネラル	18,500	2,861.00	52,928,500		
ソニー	426,900	8,198.00	3,499,726,200		
T D K	32,900	11,350.00	373,415,000		
帝国通信工業	3,000	1,178.00	3,534,000		
タムラ製作所	22,700	535.00	12,144,500		
アルプスアルパイン	60,300	1,652.00	99,615,600		
池上通信機	2,100	802.00	1,684,200		

日本電波工業	6,300	357.00	2,249,100	貸付株式数	2,400株
鈴木	3,300	672.00	2,217,600		
日本トリム	900	3,815.00	3,433,500		
ローランド ディー . ジー .	3,700	1,315.00	4,865,500	貸付株式数	1,400株
フオスタ - 電機	7,100	1,200.00	8,520,000		
S M K	1,700	2,578.00	4,382,600		
ヨコオ	4,400	2,635.00	11,594,000		
ティアック	4,900	111.00	543,900	貸付株式数	900株
ホシデン	18,600	916.00	17,037,600		
ヒロセ電機	10,600	12,270.00	130,062,000		
日本航空電子	15,600	1,366.00	21,309,600		
T O A	7,300	768.00	5,606,400		
マクセルホールディングス	14,600	1,072.00	15,651,200		
古野電気	8,700	945.00	8,221,500	貸付株式数	1,000株
ユニデンホールディングス	1,900	1,551.00	2,946,900	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	5,200	651.00	3,385,200	貸付株式数	100株 (100株)
アイコム	3,800	2,659.00	10,104,200		
リオン	2,800	2,236.00	6,260,800		
本多通信工業	5,800	435.00	2,523,000	貸付株式数	2,300株
船井電機	6,800	491.00	3,338,800	貸付株式数	800株
横河電機	62,500	1,755.00	109,687,500		
新電元工業	2,400	2,012.00	4,828,800		
アズビル	43,000	3,380.00	145,340,000		
東亜ディーケーケー	3,300	850.00	2,805,000	貸付株式数	1,300株
日本光電工業	28,200	3,480.00	98,136,000		
チ ノ ー	2,300	1,335.00	3,070,500	貸付株式数	700株
共和電業	6,900	419.00	2,891,100	貸付株式数	1,200株
日本電子材料	2,700	2,132.00	5,756,400	貸付株式数	1,000株
堀場製作所	13,500	5,820.00	78,570,000	貸付株式数	5,400株
アドバンテスト	50,700	5,020.00	254,514,000		
小野測器	2,700	490.00	1,323,000		
エスベック	6,000	1,780.00	10,680,000		
キーエンス	61,800	43,470.00	2,686,446,000		
日置電機	3,600	3,715.00	13,374,000	貸付株式数	200株
シスメックス	48,700	9,137.00	444,971,900		
日本マイクロニクス	11,800	1,059.00	12,496,200	貸付株式数	1,500株
メガチップス	6,300	2,163.00	13,626,900	貸付株式数	2,500株 (2,100株)

O B A R A G R O U P	4,000	3,665.00	14,660,000	貸付株式数	1,600株
I M A G I C A G R O U P	5,700	391.00	2,228,700	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
澤藤電機	900	1,636.00	1,472,400		
デンソー	150,100	4,493.00	674,399,300		
原田工業	3,200	863.00	2,761,600	貸付株式数	1,100株
コーセル	9,000	866.00	7,794,000		
イリソ電子工業	5,700	4,125.00	23,512,500	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	11,200	1,353.00	15,153,600	貸付株式数	4,300株
千代田インテグレ	3,100	1,568.00	4,860,800		
アイ・オー・データ	2,300	1,006.00	2,313,800	貸付株式数	800株
レーザーテック	29,900	7,690.00	229,931,000	貸付株式数	11,900株
スタンレー電気	47,800	3,050.00	145,790,000		
岩崎電気	2,600	1,415.00	3,679,000		
ウシオ電機	37,600	1,359.00	51,098,400	貸付株式数	15,000株
岡谷電機	5,200	328.00	1,705,600		
ヘリオステクノH	6,300	291.00	1,833,300		
エノモト	2,000	994.00	1,988,000		
日本セラミック	6,900	2,523.00	17,408,700	貸付株式数	1,200株
遠藤照明	3,300	629.00	2,075,700		
古河電池	4,800	1,059.00	5,083,200	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	413.00	1,362,900	貸付株式数	600株
山一電機	4,900	1,377.00	6,747,300		
函 研	4,400	2,532.00	11,140,800	貸付株式数	1,700株
日本電子	13,400	2,946.00	39,476,400		
カ シ オ	60,300	1,763.00	106,308,900	貸付株式数	24,100株
ファナック	64,100	20,640.00	1,323,024,000		
日本シイエムケイ	15,900	474.00	7,536,600	貸付株式数	6,300株
エンプラス	3,500	2,153.00	7,535,500		
大真空	2,500	1,677.00	4,192,500		
ロ ー ム	30,300	7,110.00	215,433,000		
浜松ホトニクス	48,900	4,905.00	239,854,500		
三井ハイテック	7,500	1,647.00	12,352,500	貸付株式数	2,900株
新光電気工業	22,900	1,578.00	36,136,200		
京 セ ラ	95,900	6,115.00	586,428,500		
協栄産業	700	1,276.00	893,200		
太陽誘電	30,300	2,984.00	90,415,200	貸付株式数	400株
村田製作所	200,200	6,507.00	1,302,701,400		
双葉電子工業	10,800	852.00	9,201,600		
日東電工	47,000	6,490.00	305,030,000		

北陸電気工業	2,700	893.00	2,411,100	
東海理化電機	18,100	1,560.00	28,236,000	
ニチコン	23,100	783.00	18,087,300	
日本ケミコン	5,100	1,448.00	7,384,800	
K O A	10,200	1,060.00	10,812,000	
三井E & S H D	21,700	425.00	9,222,500	
日立造船	54,100	423.00	22,884,300	
三菱重工業	114,300	2,605.00	297,751,500	
川崎重工業	53,000	1,490.00	78,970,000	
I H I	49,100	1,572.00	77,185,200	貸付株式数 19,600株
名村造船所	22,200	154.00	3,418,800	
サノヤスホールディングス	9,400	158.00	1,485,200	
スプリックス	2,200	885.00	1,947,000	貸付株式数 500株
マネジメントソリューションズ	2,800	1,312.00	3,673,600	貸付株式数 1,100株
プロレド・パートナーズ	900	5,510.00	4,959,000	貸付株式数 100株
A N D F A C T O R Y	500	923.00	461,500	貸付株式数 200株
ギークス	600	1,264.00	758,400	貸付株式数 200株
カーブスホールディングス	17,800	681.00	12,121,800	貸付株式数 7,100株
フォーラムエンジニアリング	3,300	733.00	2,418,900	
日本車輛	2,500	2,580.00	6,450,000	貸付株式数 900株
三菱ロジスネクスト	9,000	987.00	8,883,000	貸付株式数 1,500株
近畿車輛	1,000	1,237.00	1,237,000	貸付株式数 200株
F P G	20,600	605.00	12,463,000	貸付株式数 8,200株 (200株)
島根銀行	1,500	679.00	1,018,500	
じもとホールディングス	45,000	115.00	5,175,000	
全国保証	18,900	3,915.00	73,993,500	貸付株式数 7,500株
めぶきフィナンシャルG	349,300	259.00	90,468,700	
東京きらぼしF G	9,000	1,158.00	10,422,000	
九州フィナンシャルG	146,900	488.00	71,687,200	
かんぼ生命保険	23,800	1,653.00	39,341,400	
ゆうちょ銀行	190,700	848.00	161,713,600	貸付株式数 76,000株
富山第一銀行	15,700	298.00	4,678,600	
コンコルディア・フィナンシャル	384,100	373.00	143,269,300	
ジェイリース	2,500	572.00	1,430,000	貸付株式数 800株
西日本フィナンシャルH D	44,800	732.00	32,793,600	

マーキュリアインベストメント	2,800	657.00	1,839,600	貸付株式数	1,100株
イントラスト	2,500	841.00	2,102,500	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	2,800	1,101.00	3,082,800	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
C a s a	2,300	1,147.00	2,638,100	貸付株式数	800株
アルヒ	10,700	1,656.00	17,719,200	貸付株式数	4,200株
プレミアグループ	3,600	1,956.00	7,041,600		
日産自動車	803,700	419.90	337,473,630		
いすゞ自動車	197,600	1,024.50	202,441,200		
トヨタ自動車	760,500	6,966.00	5,297,643,000		
日野自動車	85,100	700.00	59,570,000		
三菱自動車工業	252,400	258.00	65,119,200		
エフテック	4,800	500.00	2,400,000	貸付株式数	1,800株
レシップホールディングス	2,600	581.00	1,510,600		
G M B	1,500	625.00	937,500	貸付株式数	200株
ファルテック	1,400	601.00	841,400		
武蔵精密工業	15,100	1,091.00	16,474,100		
日産車体	13,300	983.00	13,073,900	貸付株式数	3,100株
新明和工業	18,300	921.00	16,854,300		
極東開発工業	12,600	1,270.00	16,002,000		
日信工業	13,300	2,246.00	29,871,800		
トピー工業	5,600	1,149.00	6,434,400		
ティラド	2,400	1,261.00	3,026,400		
タチエス	11,100	878.00	9,745,800		
N O K	36,700	1,154.00	42,351,800		
フタバ産業	18,900	548.00	10,357,200		
K Y B	7,600	2,122.00	16,127,200	貸付株式数	2,500株
市光工業	10,200	483.00	4,926,600	貸付株式数	1,700株
大同メタル工業	13,100	522.00	6,838,200	貸付株式数	800株
プレス工業	33,600	303.00	10,180,800		
ミクニ	8,400	264.00	2,217,600		
太平洋工業	14,300	1,048.00	14,986,400		
ケーヒン	15,000	2,595.00	38,925,000		
河西工業	9,200	374.00	3,440,800	貸付株式数	3,400株
アイシン精機	56,100	3,645.00	204,484,500		
マ ッ ダ	200,500	680.00	136,340,000	貸付株式数	79,800株
今仙電機製作所	6,100	641.00	3,910,100		
本田技研	536,700	2,743.50	1,472,436,450		
スズキ	135,100	4,668.00	630,646,800		

S U B A R U	211,600	2,247.50	475,571,000	
安永	3,300	1,033.00	3,408,900	
ヤマハ発動機	88,900	1,700.00	151,130,000	貸付株式数 35,500株
ショーワ	15,400	2,295.00	35,343,000	
小糸製作所	40,800	5,350.00	218,280,000	
T B K	7,900	414.00	3,270,600	
エクセディ	9,300	1,421.00	13,215,300	貸付株式数 2,400株
ミツバ	12,400	377.00	4,674,800	
豊田合成	22,000	2,376.00	52,272,000	
愛三工業	10,600	472.00	5,003,200	
盟和産業	1,000	897.00	897,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	5,000	438.00	2,190,000	
ヨ ロ ズ	6,400	1,000.00	6,400,000	貸付株式数 1,100株
エフ・シー・シー	11,200	2,083.00	23,329,600	
新家工業	1,500	1,040.00	1,560,000	
シマノ	25,500	21,790.00	555,645,000	貸付株式数 10,200株
テイ・エス テック	15,800	3,235.00	51,113,000	貸付株式数 5,500株
関西みらいF G	39,600	463.00	18,334,800	
3 3 F G	6,200	1,384.00	8,580,800	貸付株式数 2,400株
第四北越フィナンシャルG	11,700	2,106.00	24,640,200	貸付株式数 100株
ジャムコ	3,300	685.00	2,260,500	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
小 野 建	6,000	1,126.00	6,756,000	
はるやまH L D G S	3,100	715.00	2,216,500	貸付株式数 1,000株
南 陽	1,400	1,556.00	2,178,400	
ノ ジ マ	12,000	3,010.00	36,120,000	
佐島電機	4,500	827.00	3,721,500	貸付株式数 1,500株
カッパ・クリエイト	9,400	1,502.00	14,118,800	貸付株式数 3,700株
エコートレーディング	1,500	552.00	828,000	貸付株式数 500株
伯東	4,100	1,106.00	4,534,600	
コンドーテック	5,200	1,189.00	6,182,800	貸付株式数 1,800株
中山福	3,700	469.00	1,735,300	
ライトオン	4,900	559.00	2,739,100	貸付株式数 1,700株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,900	2,685.00	23,896,500	貸付株式数 1,500株
ジーンズメイト	2,700	209.00	564,300	貸付株式数 700株
三菱食品	7,400	2,711.00	20,061,400	
良品計画	89,100	1,778.00	158,419,800	貸付株式数 35,600株
三城ホールディングス	6,900	283.00	1,952,700	貸付株式数 2,700株
松田産業	4,900	1,497.00	7,335,300	

第一興商	10,000	3,435.00	34,350,000	貸付株式数	3,700株
メディアパルHD	72,500	2,050.00	148,625,000		
アドヴァン	10,300	1,259.00	12,967,700		
S P K	2,800	1,375.00	3,850,000		
萩原電気HLDGS	2,500	2,087.00	5,217,500		
アルビス	2,500	2,676.00	6,690,000		
アズワン	4,400	13,880.00	61,072,000	貸付株式数	400株
スズデン	2,300	1,140.00	2,622,000	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,469.00	2,791,100		
シモジマ	4,100	1,253.00	5,137,300		
ドウシヤ	6,300	2,038.00	12,839,400		
小津産業	1,500	1,777.00	2,665,500	貸付株式数	200株
コナカ	7,700	291.00	2,240,700	貸付株式数	3,000株
高速	4,000	1,484.00	5,936,000	貸付株式数	1,500株
ハウス ローゼ	800	1,599.00	1,279,200		
G - 7ホールディングス	3,900	2,963.00	11,555,700		
たけびし	2,400	1,475.00	3,540,000	貸付株式数	900株
イオン北海道	9,100	785.00	7,143,500	貸付株式数	200株
コジマ	11,400	564.00	6,429,600	貸付株式数	4,500株
ヒマラヤ	2,200	919.00	2,021,800	貸付株式数	400株
コーナン商事	9,500	3,735.00	35,482,500	貸付株式数	300株
ネットワンシステムズ	25,500	4,060.00	103,530,000		
エコス	2,400	2,116.00	5,078,400	貸付株式数	400株
ワタミ	7,900	1,070.00	8,453,000	貸付株式数	3,100株
マルシェ	1,500	598.00	897,000	貸付株式数	600株
リックス	1,500	1,478.00	2,217,000	貸付株式数	500株
システムソフト	22,400	93.00	2,083,200		
パンパシフィックHD	147,500	2,400.00	354,000,000	貸付株式数	57,200株
丸文	5,600	475.00	2,660,000		
西松屋チェーン	14,700	1,241.00	18,242,700	貸付株式数	5,800株
ゼンショーホールディングス	32,200	2,522.00	81,208,400	貸付株式数	12,800株 (700株)
ハピネット	5,500	1,306.00	7,183,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,727.00	7,253,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,300	980.00	1,274,000	貸付株式数	500株
橋本総業HLDGS	1,300	2,196.00	2,854,800		
日本ライフライン	19,900	1,416.00	28,178,400		
サイゼリヤ	10,000	2,009.00	20,090,000	貸付株式数	4,000株
タカショー	3,900	620.00	2,418,000		

V Tホールディングス	27,600	385.00	10,626,000		
マルカ	2,300	1,991.00	4,579,300	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,700	3,450.00	19,665,000		
魚力	1,900	1,850.00	3,515,000	貸付株式数	700株
I D O M	18,000	572.00	10,296,000	貸付株式数	2,000株
日本エム・ディ・エム	3,900	2,060.00	8,034,000	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,800	401.00	721,800	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	1,800	2,101.00	3,781,800		
ユナイテッドアローズ	7,000	1,568.00	10,976,000	貸付株式数	2,400株
進和	4,000	2,057.00	8,228,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	291.00	465,600	貸付株式数	200株
ダイトロン	2,800	1,403.00	3,928,400	貸付株式数	1,100株
ハイデイ日高	9,700	1,794.00	17,401,800	貸付株式数	3,800株 (900株)
シークス	8,500	941.00	7,998,500		
京都市もの友禅	3,900	232.00	904,800	貸付株式数	1,600株
コロワイド	22,300	1,700.00	37,910,000	貸付株式数	8,900株
ピーシーデポコーポ	8,800	688.00	6,054,400	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	714.00	1,499,400		
オーハシテクニカ	3,700	1,442.00	5,335,400		
壱番屋	4,700	5,340.00	25,098,000	貸付株式数	1,400株
白銅	2,300	1,225.00	2,817,500	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	420.00	1,008,000	貸付株式数	400株
P L A N T	1,600	785.00	1,256,000	貸付株式数	600株
スギホールディングス	13,400	7,510.00	100,634,000	貸付株式数	5,300株
ダイコー通産	400	1,208.00	483,200	貸付株式数	100株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,418.00	7,012,200	貸付株式数	1,100株
島津製作所	81,500	3,300.00	268,950,000		
J M S	5,700	869.00	4,953,300		
クボテック	1,900	337.00	640,300	貸付株式数	600株 (100株)
長野計器	5,000	842.00	4,210,000		
ブイ・テクノロジー	3,200	3,935.00	12,592,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	10,500	1,349.00	14,164,500	貸付株式数	600株
東京計器	4,200	921.00	3,868,200	貸付株式数	700株
愛知時計	900	4,405.00	3,964,500		
インターアクション	3,600	1,780.00	6,408,000	貸付株式数	1,400株
オーバル	6,400	219.00	1,401,600	貸付株式数	1,200株
東京精密	12,400	3,175.00	39,370,000		
マニー	27,100	2,709.00	73,413,900	貸付株式数	10,800株

ニコン	104,100	783.00	81,510,300	貸付株式数	39,600株
トプコン	34,300	929.00	31,864,700	貸付株式数	12,500株
オリンパス	377,100	2,051.50	773,620,650		
理研計器	6,000	2,525.00	15,150,000		
S C R E E Nホールディングス	11,800	5,180.00	61,124,000		
キヤノン電子	7,200	1,451.00	10,447,200	貸付株式数	2,700株
タムロン	5,500	1,701.00	9,355,500		
HOYA	135,200	10,500.00	1,419,600,000		
シード	2,900	701.00	2,032,900		
ノーリツ鋼機	4,600	1,522.00	7,001,200		
エー・アンド・デイ	6,100	646.00	3,940,600		
朝日インテック	77,200	3,055.00	235,846,000	貸付株式数	30,800株
キヤノン	338,400	1,750.00	592,200,000	貸付株式数	142,300株
リコー	173,400	777.00	134,731,800		
シチズン時計	79,600	322.00	25,631,200	貸付株式数	31,800株
リズム時計	2,100	625.00	1,312,500		
大研医器	5,100	548.00	2,794,800		
メニコン	9,600	6,580.00	63,168,000	貸付株式数	2,400株
シンシア	900	391.00	351,900	貸付株式数	100株
中本パックス	1,600	1,508.00	2,412,800	貸付株式数	600株
スノーピーク	3,500	1,603.00	5,610,500	貸付株式数	1,400株
パラマウントベッドHD	7,200	4,210.00	30,312,000		
トランザクション	4,400	1,128.00	4,963,200		
粧美堂	2,000	392.00	784,000	貸付株式数	700株
ニホンフラッシュ	6,300	1,395.00	8,788,500		
前田工織	7,500	2,534.00	19,005,000		
永大産業	8,600	294.00	2,528,400		
アートネイチャー	7,200	614.00	4,420,800		
バンダイナムコHLDGS	70,500	6,609.00	465,934,500		
アイフィスジャパン	1,800	772.00	1,389,600		
共立印刷	11,300	132.00	1,491,600		
SHOEI	6,200	3,185.00	19,747,000		
フランスベッドHLDGS	9,700	866.00	8,400,200	貸付株式数	3,600株
マーベラス	10,000	779.00	7,790,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	11,100	3,085.00	34,243,500	貸付株式数	4,300株
萩原工業	3,700	1,489.00	5,509,300	貸付株式数	1,400株 (300株)

エイベックス	11,500	899.00	10,338,500		
トッパン・フォームズ	14,600	965.00	14,089,000		
フジシールインターナショナル	15,300	1,891.00	28,932,300	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	30,500	845.00	25,772,500		
廣済堂	4,900	671.00	3,287,900		
エステールホールディングス	2,200	642.00	1,412,400	貸付株式数	700株
レック	7,200	1,582.00	11,390,400		
タカノ	2,600	620.00	1,612,000	貸付株式数	1,000株
三光合成	7,500	265.00	1,987,500	貸付株式数	1,300株
プロネクサス	5,800	1,093.00	6,339,400		
ホクシン	5,700	112.00	638,400		
ウッドワン	2,400	1,181.00	2,834,400		
大建工業	4,600	1,712.00	7,875,200		
きもと	12,400	160.00	1,984,000		
凸版印刷	96,200	1,525.00	146,705,000		
大日本印刷	89,200	2,147.00	191,512,400		
共同印刷	2,100	2,583.00	5,424,300		
N I S S H A	13,900	1,197.00	16,638,300		
光村印刷	600	1,589.00	953,400	貸付株式数	200株
藤森工業	6,100	3,925.00	23,942,500		
ヴィア・ホールディングス	8,100	340.00	2,754,000	貸付株式数	3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	2,770.00	9,141,000	貸付株式数	1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,300	1,050.00	4,515,000	貸付株式数	1,600株
未来工業	3,700	1,920.00	7,104,000		
アシックス	56,200	1,496.00	84,075,200	貸付株式数	22,800株
ツツミ	2,200	2,028.00	4,461,600		
ウェーブロックHLDGS	2,300	768.00	1,766,400		
ジェイエスピー	4,000	1,600.00	6,400,000	貸付株式数	1,400株
ニチハ	9,500	2,657.00	25,241,500		
エフピコ	7,500	7,970.00	59,775,000		
小松ウオール工業	2,100	1,732.00	3,637,200		
ヤマハ	40,500	5,000.00	202,500,000		
河合楽器	2,100	2,664.00	5,594,400		
クリナップ	6,300	507.00	3,194,100		
ピジョン	41,200	4,855.00	200,026,000	貸付株式数	16,400株
天馬	4,500	1,951.00	8,779,500		
オリバー	1,400	2,453.00	3,434,200	貸付株式数	200株

兼松サステック	400	1,614.00	645,600	
キングジム	5,700	895.00	5,101,500	
象印マホービン	20,000	1,576.00	31,520,000	貸付株式数 5,000株
リンテック	16,300	2,483.00	40,472,900	
信越ポリマー	12,200	878.00	10,711,600	
東リ	16,800	242.00	4,065,600	
イトーキ	14,400	358.00	5,155,200	貸付株式数 1,500株
任天堂	41,800	58,950.00	2,464,110,000	
三菱鉛筆	11,300	1,275.00	14,407,500	貸付株式数 300株
松風	3,000	1,437.00	4,311,000	貸付株式数 1,100株
タカラスタンダード	14,100	1,301.00	18,344,100	
コクヨ	32,700	1,225.00	40,057,500	貸付株式数 12,500株
ナカバヤシ	6,600	625.00	4,125,000	貸付株式数 300株
ニフコ	25,100	2,869.00	72,011,900	
立川ブラインド	3,000	1,226.00	3,678,000	貸付株式数 500株
グローブライド	3,000	3,210.00	9,630,000	
オカムラ	23,800	742.00	17,659,600	
バルカー	5,500	1,860.00	10,230,000	
MUTOHホールディングス	1,000	1,508.00	1,508,000	
伊藤忠	469,600	2,802.00	1,315,819,200	
丸紅	698,900	652.30	455,892,470	
スクロール	10,100	877.00	8,857,700	貸付株式数 4,000株
高島	1,000	1,789.00	1,789,000	
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,799.00	12,233,200	貸付株式数 500株
三陽商会	3,500	601.00	2,103,500	貸付株式数 1,400株
長瀬産業	37,900	1,369.00	51,885,100	
ナイガイ	2,500	370.00	925,000	貸付株式数 400株
蝶理	4,300	1,560.00	6,708,000	
豊田通商	74,900	3,160.00	236,684,000	
オンワードホールディングス	40,100	271.00	10,867,100	貸付株式数 16,000株
三共生興	10,000	400.00	4,000,000	貸付株式数 1,700株
兼松	25,000	1,347.00	33,675,000	
美津濃	6,200	1,938.00	12,015,600	
ツカモトコーポレーション	1,300	1,160.00	1,508,000	
ファミリーマート	53,600	2,364.00	126,710,400	
ルックホールディングス	2,100	848.00	1,780,800	
三井物産	581,300	1,953.00	1,135,278,900	

日本紙パルプ	3,800	3,675.00	13,965,000	
東京エレクトロン	43,200	26,400.00	1,140,480,000	
カメイ	8,800	996.00	8,764,800	
東都水産	800	3,060.00	2,448,000	貸付株式数 300株
OUGホールディングス	1,100	2,822.00	3,104,200	貸付株式数 400株
スターゼン	2,500	4,035.00	10,087,500	貸付株式数 300株
セイコーHD	9,600	1,508.00	14,476,800	貸付株式数 3,800株
山 善	26,200	998.00	26,147,600	
椿本興業	1,200	3,120.00	3,744,000	
住友商事	423,600	1,380.00	584,568,000	
日本ユニシス	20,900	2,945.00	61,550,500	
内田洋行	2,700	5,150.00	13,905,000	貸付株式数 1,000株
三菱商事	440,200	2,589.00	1,139,677,800	
第一実業	3,300	3,650.00	12,045,000	
キャノンマーケティングJ PN	16,700	1,875.00	31,312,500	貸付株式数 6,400株
西華産業	3,700	1,306.00	4,832,200	
佐藤商事	5,600	893.00	5,000,800	
菱洋エレクトロ	6,800	2,657.00	18,067,600	貸付株式数 2,700株
東京産業	6,000	516.00	3,096,000	
ユアサ商事	6,400	3,110.00	19,904,000	
神鋼商事	1,600	1,775.00	2,840,000	
トルク	3,900	299.00	1,166,100	貸付株式数 700株
阪和興業	12,500	2,138.00	26,725,000	
正栄食品	4,300	4,230.00	18,189,000	
カナデン	5,400	1,382.00	7,462,800	貸付株式数 1,900株
菱電商事	4,800	1,438.00	6,902,400	貸付株式数 1,600株
ニプロ	47,200	1,211.00	57,159,200	貸付株式数 500株
フルサト工業	3,700	1,333.00	4,932,100	貸付株式数 1,300株
岩谷産業	14,900	4,040.00	60,196,000	貸付株式数 5,900株
ナイス	2,500	1,275.00	3,187,500	
昭光通商	2,300	578.00	1,329,400	貸付株式数 400株
ニチモウ	1,000	1,905.00	1,905,000	
極東貿易	1,900	1,318.00	2,504,200	貸付株式数 600株
イ ワ キ	8,700	479.00	4,167,300	貸付株式数 3,400株
兼松エレクトロニクス	3,600	3,980.00	14,328,000	
三愛石油	16,500	952.00	15,708,000	
稲畑産業	14,800	1,325.00	19,610,000	貸付株式数 5,900株
G S Iクレオス	1,600	1,821.00	2,913,600	
明和産業	6,300	488.00	3,074,400	貸付株式数 2,500株

クワザワ	2,400	516.00	1,238,400	
ヤマエ久野	4,900	1,152.00	5,644,800	貸付株式数 800株
ゴ - ルドウイン	12,100	7,790.00	94,259,000	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ユニ・チャ - ム	144,500	4,456.00	643,892,000	貸付株式数 57,800株
デサント	13,000	1,857.00	24,141,000	
キ ン グ	3,000	557.00	1,671,000	
ワ キ タ	14,200	941.00	13,362,200	
ヤマトインタ - ナショナル	5,700	340.00	1,938,000	貸付株式数 100株
東邦ホールディングス	21,600	2,138.00	46,180,800	
サンゲツ	18,300	1,604.00	29,353,200	
ミツウロコグループ	9,900	1,170.00	11,583,000	貸付株式数 1,000株
シナネンホールディングス	2,800	3,015.00	8,442,000	
伊藤忠エネクス	15,100	949.00	14,329,900	
サンリオ	18,800	1,795.00	33,746,000	貸付株式数 7,500株
サンワ テクノス	4,700	850.00	3,995,000	貸付株式数 1,700株
リョーサン	7,400	1,958.00	14,489,200	
新光商事	10,500	820.00	8,610,000	
トーホー	3,000	1,804.00	5,412,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	3,600	1,825.00	6,570,000	
東陽テクニカ	7,600	944.00	7,174,400	
モスフード サービス	8,800	2,881.00	25,352,800	貸付株式数 3,500株
加賀電子	6,700	2,129.00	14,264,300	
三益半導体	5,300	2,140.00	11,342,000	貸付株式数 400株
ソーダニツカ	6,800	520.00	3,536,000	貸付株式数 2,200株
立花エレテック	5,000	1,700.00	8,500,000	貸付株式数 1,600株
木曽路	8,800	2,450.00	21,560,000	貸付株式数 3,500株
S R S ホールディングス	8,100	973.00	7,881,300	貸付株式数 3,100株
千 趣 会	12,200	347.00	4,233,400	貸付株式数 3,800株
タカキュー	6,100	131.00	799,100	貸付株式数 1,800株 (1,600株)
リテールパートナーズ	8,900	1,738.00	15,468,200	貸付株式数 3,500株
ケーヨー	13,700	817.00	11,192,900	貸付株式数 2,900株
上新電機	7,900	2,333.00	18,430,700	貸付株式数 2,800株
日本瓦斯	10,600	4,400.00	46,640,000	
ロイヤルホールディングス	11,700	1,855.00	21,703,500	貸付株式数 4,600株
東 天 紅	500	999.00	499,500	貸付株式数 100株
いなげや	8,300	1,793.00	14,881,900	
島 忠	12,600	2,811.00	35,418,600	貸付株式数 5,000株

チヨダ	7,100	967.00	6,865,700	貸付株式数	500株
ライフコーポレーション	5,100	4,510.00	23,001,000	貸付株式数	1,300株
リンガーハット	8,300	2,503.00	20,774,900	貸付株式数	3,100株 (1,700株)
MrMaxHD	9,200	817.00	7,516,400		
テナアライド	5,900	393.00	2,318,700	貸付株式数	2,300株
AOKIホールディングス	13,500	579.00	7,816,500		
オークワ	10,500	1,340.00	14,070,000		
コメリ	10,400	3,150.00	32,760,000		
青山商事	13,800	605.00	8,349,000	貸付株式数	5,200株
しまむら	7,800	8,550.00	66,690,000	貸付株式数	3,100株
はせがわ	3,400	286.00	972,400	貸付株式数	300株
高島屋	48,900	845.00	41,320,500	貸付株式数	19,500株
松屋	13,500	623.00	8,410,500	貸付株式数	3,900株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	31,800	724.00	23,023,200	貸付株式数	12,700株
近鉄百貨店	2,600	2,819.00	7,329,400	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	61,500	1,885.00	115,927,500		
クレディセゾン	47,000	1,188.00	55,836,000		
アクシアルリテイリング	5,600	4,635.00	25,956,000		
井筒屋	4,000	171.00	684,000	貸付株式数	600株
イオン	258,300	2,646.50	683,590,950	貸付株式数	103,200株
イズミ	13,700	3,840.00	52,608,000	貸付株式数	5,400株
フォーバル	2,900	945.00	2,740,500		
平和堂	13,700	2,127.00	29,139,900	貸付株式数	5,400株
フジ	8,100	1,780.00	14,418,000	貸付株式数	3,200株
ヤオコー	7,600	7,770.00	59,052,000	貸付株式数	3,000株
ゼビオホールディングス	8,200	748.00	6,133,600	貸付株式数	3,200株
ケーズホールディングス	64,800	1,443.00	93,506,400		
PALTAC	10,800	5,790.00	62,532,000		
三谷産業	8,700	350.00	3,045,000		
OLYMPICグループ	3,400	843.00	2,866,200	貸付株式数	600株
日産東京販売HD	9,700	251.00	2,434,700		
新生銀行	49,300	1,345.00	66,308,500		
あおぞら銀行	40,000	1,910.00	76,400,000	貸付株式数	15,900株
三菱UFJフィナンシャル G	4,598,500	443.40	2,038,974,900		
りそなホールディングス	737,600	394.60	291,056,960		
三井住友トラストHD	127,100	3,061.00	389,053,100		
三井住友フィナンシャルG	465,000	3,140.00	1,460,100,000		

千葉銀行	224,500	578.00	129,761,000	
群馬銀行	129,200	357.00	46,124,400	
武蔵野銀行	10,000	1,616.00	16,160,000	
千葉興業銀行	18,000	272.00	4,896,000	
筑波銀行	28,100	222.00	6,238,200	
七十七銀行	22,800	1,594.00	36,343,200	
青森銀行	5,200	2,374.00	12,344,800	
秋田銀行	4,300	1,622.00	6,974,600	貸付株式数 1,700株
山形銀行	7,500	1,332.00	9,990,000	貸付株式数 1,000株
岩手銀行	4,400	2,546.00	11,202,400	貸付株式数 1,600株
東邦銀行	59,800	229.00	13,694,200	
東北銀行	3,100	1,035.00	3,208,500	
みちのく銀行	4,400	1,154.00	5,077,600	
ふくおかフィナンシャルG	56,700	1,856.00	105,235,200	
静岡銀行	163,800	755.00	123,669,000	
十六銀行	8,400	1,964.00	16,497,600	貸付株式数 3,300株
スルガ銀行	63,000	397.00	25,011,000	
八十二銀行	162,400	416.00	67,558,400	
山梨中央銀行	7,800	833.00	6,497,400	
大垣共立銀行	13,300	2,210.00	29,393,000	貸付株式数 5,300株
福井銀行	5,700	1,695.00	9,661,500	
北國銀行	6,700	2,999.00	20,093,300	
清水銀行	2,700	1,779.00	4,803,300	
富山銀行	1,300	2,439.00	3,170,700	
滋賀銀行	13,500	2,507.00	33,844,500	
南都銀行	11,200	1,951.00	21,851,200	
百五銀行	60,700	319.00	19,363,300	
京都銀行	24,100	4,735.00	114,113,500	
紀陽銀行	23,800	1,569.00	37,342,200	貸付株式数 2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,800	992.00	44,441,600	貸付株式数 17,800株
広島銀行	99,400	560.00	55,664,000	貸付株式数 1,300株
山陰合同銀行	39,900	542.00	21,625,800	
中国銀行	57,900	976.00	56,510,400	
鳥取銀行	2,200	1,185.00	2,607,000	
伊予銀行	96,000	682.00	65,472,000	
百十四銀行	7,100	1,808.00	12,836,800	貸付株式数 2,000株
四国銀行	10,200	770.00	7,854,000	貸付株式数 2,700株
阿波銀行	11,000	2,439.00	26,829,000	
大分銀行	3,900	2,508.00	9,781,200	
宮崎銀行	4,500	2,397.00	10,786,500	

佐賀銀行	4,000	1,336.00	5,344,000	
沖縄銀行	6,200	2,946.00	18,265,200	
琉球銀行	15,500	884.00	13,702,000	
セブン銀行	224,600	261.00	58,620,600	
みずほフィナンシャルG	9,134,900	143.00	1,306,290,700	
高知銀行	2,500	769.00	1,922,500	
山口フィナンシャルG	84,000	713.00	59,892,000	
芙蓉総合リース	7,100	6,620.00	47,002,000	
みずほリース	10,400	2,701.00	28,090,400	
東京センチュリー	13,500	5,640.00	76,140,000	
SBIホールディングス	75,100	2,683.00	201,493,300	貸付株式数 30,000株
日本証券金融	29,500	549.00	16,195,500	
アイフル	102,000	256.00	26,112,000	
日本アジア投資	6,300	228.00	1,436,400	
長野銀行	2,100	1,184.00	2,486,400	貸付株式数 800株
名古屋銀行	5,300	2,421.00	12,831,300	
北洋銀行	101,300	232.00	23,501,600	
愛知銀行	2,400	3,020.00	7,248,000	
中京銀行	2,700	2,041.00	5,510,700	
大光銀行	2,200	1,304.00	2,868,800	
愛媛銀行	9,400	1,155.00	10,857,000	貸付株式数 2,900株
トマト銀行	2,500	1,030.00	2,575,000	
京葉銀行	28,700	501.00	14,378,700	貸付株式数 11,400株
栃木銀行	31,600	205.00	6,478,000	
北日本銀行	2,000	1,745.00	3,490,000	
東和銀行	11,700	721.00	8,435,700	
福島銀行	7,300	258.00	1,883,400	貸付株式数 2,500株
大東銀行	3,300	670.00	2,211,000	
リコーリース	5,300	2,726.00	14,447,800	貸付株式数 2,100株
イオンフィナンシャルサービス	41,100	953.00	39,168,300	貸付株式数 16,400株
アコム	135,100	413.00	55,796,300	
ジャックス	7,400	1,751.00	12,957,400	
オリコ	181,600	117.00	21,247,200	
日立キャピタル	15,900	2,550.00	40,545,000	
アプラスフィナンシャル	34,100	73.00	2,489,300	貸付株式数 12,900株
オリックス	416,900	1,364.50	568,860,050	
三菱UFJリース	170,700	510.00	87,057,000	
ジャフコ	10,300	4,275.00	44,032,500	
九州リースサービス	2,900	593.00	1,719,700	貸付株式数 1,200株

トモニホールディングス	51,800	339.00	17,560,200	
大和証券G本社	539,500	470.70	253,942,650	
野村ホールディングス	1,182,600	539.70	638,249,220	貸付株式数 472,700株
岡三証券グループ	57,300	331.00	18,966,300	
丸三証券	19,700	428.00	8,431,600	貸付株式数 7,700株 (1,400株)
東洋証券	24,300	110.00	2,673,000	
東海東京HD	76,900	263.00	20,224,700	
光世証券	1,800	580.00	1,044,000	貸付株式数 600株
水戸証券	19,100	200.00	3,820,000	
いちよし証券	12,200	454.00	5,538,800	
松井証券	38,400	953.00	36,595,200	
SOMPOホールディングス	126,400	3,877.00	490,052,800	
日本取引所グループ	192,900	2,795.00	539,155,500	
マネックスG	50,000	267.00	13,350,000	
極東証券	8,700	579.00	5,037,300	
岩井コスモホールディング	6,300	1,262.00	7,950,600	
藍澤証券	12,000	691.00	8,292,000	
フィデアホール	64,400	114.00	7,341,600	
池田泉州HD	76,900	176.00	13,534,400	
アニコムホールディングス	5,500	4,230.00	23,265,000	
MS&AD	175,800	2,929.00	514,918,200	
マネーパートナーズGP	6,600	210.00	1,386,000	
スパークス・グループ	30,800	198.00	6,098,400	
小林洋行	2,800	254.00	711,200	貸付株式数 700株
第一生命HLDGS	380,300	1,576.50	599,542,950	
東京海上HD	237,700	4,817.00	1,145,000,900	
アドバンテッジリスクマネ	3,300	738.00	2,435,400	貸付株式数 1,300株
イー・ギャランティ	7,200	2,186.00	15,739,200	貸付株式数 400株
アサクス	3,600	716.00	2,577,600	貸付株式数 1,200株
NECキャピタルソリューション	2,700	1,845.00	4,981,500	
T&Dホールディングス	200,800	1,120.00	224,896,000	
アドバンスクリエイト	1,600	2,170.00	3,472,000	貸付株式数 500株
三井不動産	331,200	1,926.50	638,056,800	
三菱地所	470,700	1,650.50	776,890,350	
平和不動産	12,200	2,788.00	34,013,600	
東京建物	70,300	1,327.00	93,288,100	貸付株式数 27,100株

ダイビル	17,000	1,130.00	19,210,000	
京阪神ビルディング	10,600	1,532.00	16,239,200	
住友不動産	150,900	3,175.00	479,107,500	
太平洋興発	2,600	616.00	1,601,600	貸付株式数 600株
テーオーシー	12,900	669.00	8,630,100	貸付株式数 4,900株
東京楽天地	1,200	4,020.00	4,824,000	貸付株式数 200株
スターツコーポレーション	9,000	2,238.00	20,142,000	
フジ住宅	8,400	514.00	4,317,600	貸付株式数 2,200株
空港施設	7,200	431.00	3,103,200	
明和地所	5,100	534.00	2,723,400	
ゴールドクレスト	5,000	1,461.00	7,305,000	貸付株式数 2,000株
リログループ	35,500	2,323.00	82,466,500	
エスリード	2,700	1,301.00	3,512,700	
日神グループHLDGS	10,300	401.00	4,130,300	貸付株式数 3,700株
日本エスコ	12,200	789.00	9,625,800	貸付株式数 2,100株
タカラレーベン	30,200	344.00	10,388,800	
AVANTIA	3,800	770.00	2,926,000	貸付株式数 1,200株
イオンモール	33,400	1,403.00	46,860,200	貸付株式数 13,300株
毎日コムネット	2,000	761.00	1,522,000	貸付株式数 300株
ファースト住建	3,100	1,005.00	3,115,500	貸付株式数 1,000株
ランド	378,100	9.00	3,402,900	
カチタス	16,600	2,868.00	47,608,800	貸付株式数 6,400株
東祥	4,000	1,384.00	5,536,000	貸付株式数 1,600株
トーセイ	9,400	976.00	9,174,400	貸付株式数 3,500株
穴吹興産	1,700	1,475.00	2,507,500	貸付株式数 200株
サンフロンティア不動産	9,500	822.00	7,809,000	
インテリックス	2,900	491.00	1,423,900	貸付株式数 400株
ランドビジネス	3,000	363.00	1,089,000	
サンネクスタグループ	1,900	910.00	1,729,000	貸付株式数 300株
グランディハウス	5,800	357.00	2,070,600	
東武鉄道	71,000	3,345.00	237,495,000	
相鉄ホールディングス	21,800	2,920.00	63,656,000	
東急	171,900	1,423.00	244,613,700	
京浜急行	87,500	1,601.00	140,087,500	貸付株式数 12,300株
小田急電鉄	101,300	2,601.00	263,481,300	
京王電鉄	35,400	6,450.00	228,330,000	
京成電鉄	47,400	3,100.00	146,940,000	
富士急行	9,300	3,520.00	32,736,000	貸付株式数 3,700株
新京成電鉄	1,700	2,255.00	3,833,500	貸付株式数 600株
東日本旅客鉄道	120,000	6,866.00	823,920,000	

西日本旅客鉄道	60,700	5,614.00	340,769,800	
東海旅客鉄道	56,700	15,815.00	896,710,500	
西武ホールディングス	88,900	1,257.00	111,747,300	貸付株式数 29,600株
鴻池運輸	11,000	1,099.00	12,089,000	
西日本鉄道	18,900	3,020.00	57,078,000	貸付株式数 3,500株
ハマキョウレックス	5,200	3,365.00	17,498,000	
サカイ引越センター	3,600	4,800.00	17,280,000	
近鉄グループHLDGS	64,500	4,690.00	302,505,000	
阪急阪神HLDGS	86,100	3,445.00	296,614,500	
南海電鉄	30,600	2,331.00	71,328,600	
京阪ホールディングス	28,700	4,575.00	131,302,500	
神戸電鉄	1,500	3,730.00	5,595,000	貸付株式数 600株
名古屋鉄道	53,100	2,976.00	158,025,600	貸付株式数 14,600株
山陽電鉄	4,700	2,088.00	9,813,600	貸付株式数 1,800株
トランコム	1,800	7,070.00	12,726,000	
日本通運	22,400	6,190.00	138,656,000	
ヤマトホールディングス	113,100	2,725.00	308,197,500	
山 九	18,000	4,320.00	77,760,000	
日 新	5,600	1,542.00	8,635,200	
丸 運	3,500	232.00	812,000	
丸全昭和運輸	5,200	3,295.00	17,134,000	
センコーグループHLDGS	35,700	943.00	33,665,100	
トナミホールディングス	1,600	5,760.00	9,216,000	
ニッコンホールディングス	23,200	2,253.00	52,269,600	
日石輸送	700	2,640.00	1,848,000	
福山通運	8,300	5,110.00	42,413,000	貸付株式数 100株
セイノーホールディングス	48,400	1,492.00	72,212,800	
エスライン	1,900	926.00	1,759,400	貸付株式数 100株
神奈川中央交通	1,600	4,005.00	6,408,000	貸付株式数 600株
日立物流	11,900	3,640.00	43,316,000	
丸和運輸機関	6,800	3,985.00	27,098,000	貸付株式数 2,700株
C & F ロジホールディングス	6,500	1,570.00	10,205,000	
日本郵船	54,000	1,700.00	91,800,000	
商船三井	40,800	2,014.00	82,171,200	
川崎汽船	19,800	1,162.00	23,007,600	
NSユニテッド海運	3,600	1,424.00	5,126,400	
明治海運	6,600	321.00	2,118,600	
飯野海運	30,200	353.00	10,660,600	貸付株式数 3,700株

共栄タンカー	1,200	770.00	924,000		
九州旅客鉄道	56,500	2,346.00	132,549,000		
S Gホールディングス	67,800	4,825.00	327,135,000		
日本航空	114,100	2,224.00	253,758,400		
A N Aホールディングス	118,000	2,709.50	319,721,000		
パスコ	1,300	1,380.00	1,794,000	貸付株式数	200株
西本W I S M E T T A C H D	1,200	1,889.00	2,266,800	貸付株式数	400株
シルバーライフ	900	2,092.00	1,882,800	貸付株式数	200株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	700	1,512.00	1,058,400	貸付株式数	100株
一家ダイニングプロジ	500	598.00	299,000	貸付株式数	200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,900	3,510.00	10,179,000		
国際紙パルプ商事	15,900	274.00	4,356,600		
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	1,400	570.00	798,000	貸付株式数	300株
ブックオフG H D	3,900	859.00	3,350,100	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,400	3,180.00	64,872,000		
三井倉庫H O L D	7,400	1,787.00	13,223,800		
住友倉庫	23,300	1,310.00	30,523,000		
渋沢倉庫	3,500	1,994.00	6,979,000	貸付株式数	700株
ヤマタネ	3,300	1,269.00	4,187,700		
東陽倉庫	11,300	318.00	3,593,400		
乾汽船	3,700	814.00	3,011,800	貸付株式数	100株
日本トランスシティ	14,200	503.00	7,142,600		
ケイヒン	1,200	1,290.00	1,548,000		
中央倉庫	3,900	1,030.00	4,017,000		
川西倉庫	1,100	1,115.00	1,226,500	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,200	934.00	4,856,800		
ファイズホールディングス	1,400	1,094.00	1,531,600	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,409.00	2,818,000		
宇徳	5,500	470.00	2,585,000		
上 組	36,100	2,127.00	76,784,700		
サンリツ	1,500	612.00	918,000	貸付株式数	300株
キムラユニティー	1,600	1,074.00	1,718,400	貸付株式数	600株
キューソー流通システム	1,600	1,505.00	2,408,000		
近鉄エクスプレス	13,700	2,151.00	29,468,700		
東海運	3,600	285.00	1,026,000	貸付株式数	1,300株
エーアイティー	4,500	996.00	4,482,000	貸付株式数	500株

内外トランスライン	2,100	1,131.00	2,375,100		
ショーエイコーポ	900	1,193.00	1,073,700	貸付株式数	300株
日本コンセプト	2,000	1,315.00	2,630,000	貸付株式数	300株
東京放送HD	40,700	1,755.00	71,428,500	貸付株式数	16,000株
日本テレビHLD S	55,900	1,197.00	66,912,300	貸付株式数	9,300株
朝日放送グループHD	6,400	708.00	4,531,200	貸付株式数	2,500株
テレビ朝日HD	18,400	1,610.00	29,624,000	貸付株式数	7,300株
スカパーJ S A T H D	44,100	461.00	20,330,100		
テレビ東京HD	5,500	2,298.00	12,639,000		
日本BS放送	2,100	1,084.00	2,276,400	貸付株式数	800株
ビジョン	6,100	884.00	5,392,400	貸付株式数	2,400株
スマートバリュー	1,800	1,069.00	1,924,200	貸付株式数	700株
USEN-NEXT H L D G S	2,600	1,183.00	3,075,800	貸付株式数	700株
ワイヤレスゲート	3,200	823.00	2,633,600	貸付株式数	1,200株
コネクシオ	3,800	1,232.00	4,681,600		
日本通信	51,700	230.00	11,891,000	貸付株式数	20,200株 (1,000株)
クロップス	1,300	780.00	1,014,000		
日本電信電話	894,000	2,370.50	2,119,227,000		
K D D I	487,600	2,910.00	1,418,916,000		
ソフトバンク	607,900	1,353.00	822,488,700		
光通信	6,900	24,550.00	169,395,000		
N T T ドコモ	478,300	2,825.00	1,351,197,500		
エムティーアイ	6,400	673.00	4,307,200		
GMOインターネット	26,300	2,651.00	69,721,300		
ファイバーゲート	2,100	1,820.00	3,822,000	貸付株式数	800株
アйдママーケティングコ ミュ	2,100	451.00	947,100		
K A D O K A W A	18,000	2,475.00	44,550,000	貸付株式数	7,100株
学研ホールディングス	8,900	1,572.00	13,990,800		
ゼンリン	13,300	1,140.00	15,162,000		
昭文社ホールディングス	3,100	464.00	1,438,400	貸付株式数	1,100株
インプレスホールディング ス	5,300	157.00	832,100	貸付株式数	2,100株
東京電力HD	544,100	310.00	168,671,000	貸付株式数	1,900株
中部電力	208,500	1,303.00	271,675,500		
関西電力	258,300	1,047.50	270,569,250		
中国電力	98,400	1,293.00	127,231,200		
北陸電力	62,300	761.00	47,410,300		

東北電力	170,300	1,067.00	181,710,100	
四国電力	61,500	801.00	49,261,500	
九州電力	140,400	946.00	132,818,400	
北海道電力	63,700	450.00	28,665,000	
沖縄電力	13,200	1,669.00	22,030,800	
電源開発	54,300	1,600.00	86,880,000	
エフオン	3,700	644.00	2,382,800	貸付株式数 1,200株
イーレックス	9,700	1,267.00	12,289,900	
レノバ	11,300	1,158.00	13,085,400	貸付株式数 4,500株
東京瓦斯	131,100	2,330.50	305,528,550	
大阪瓦斯	132,300	2,028.00	268,304,400	
東邦瓦斯	33,500	4,520.00	151,420,000	
北海道瓦斯	3,700	1,585.00	5,864,500	
広島ガス	14,100	359.00	5,061,900	貸付株式数 4,500株
西部瓦斯	7,600	2,488.00	18,908,800	
静岡ガス	19,300	876.00	16,906,800	貸付株式数 3,200株
メタウォーター	3,300	4,550.00	15,015,000	
アイネット	3,400	1,518.00	5,161,200	
松竹	4,400	14,320.00	63,008,000	貸付株式数 1,600株
東宝	39,400	4,105.00	161,737,000	貸付株式数 15,700株
エイチ・アイ・エス	10,100	1,990.00	20,099,000	貸付株式数 4,000株
東映	2,500	16,510.00	41,275,000	貸付株式数 100株
ラックランド	1,500	2,255.00	3,382,500	貸付株式数 600株
NTTデータ	178,000	1,216.00	216,448,000	
共立メンテナンス	10,800	3,980.00	42,984,000	貸付株式数 4,300株 (200株)
イチネンホールディングス	7,200	1,208.00	8,697,600	
建設技術研究所	4,400	1,906.00	8,386,400	貸付株式数 700株
スペース	4,100	782.00	3,206,200	貸付株式数 700株
長大	2,500	1,288.00	3,220,000	
アインホールディングス	8,200	6,740.00	55,268,000	貸付株式数 3,200株
燦ホールディングス	2,800	1,107.00	3,099,600	
ピー・シー・エー	1,100	4,625.00	5,087,500	貸付株式数 400株 (400株)
スバル興業	400	7,740.00	3,096,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	3,100	1,280.00	3,968,000	貸付株式数 1,000株
タナベ経営	1,100	1,380.00	1,518,000	貸付株式数 400株
ビジネスB太田昭和	2,200	1,343.00	2,954,600	
ナガワ	2,100	6,780.00	14,238,000	
よみうりランド	1,400	3,980.00	5,572,000	貸付株式数 500株

東京都競馬	4,200	5,040.00	21,168,000	貸付株式数	700株
常磐興産	2,600	1,432.00	3,723,200	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,700	2,263.00	24,214,100	貸付株式数	4,200株
東京ドーム	26,400	807.00	21,304,800	貸付株式数	10,500株
D T S	14,900	2,188.00	32,601,200		
スクウェア・エニックス・HD	28,500	6,900.00	196,650,000	貸付株式数	11,000株
シーイーシー	7,100	1,549.00	10,997,900		
カプコン	31,500	5,230.00	164,745,000		
西尾レントオール	6,000	2,384.00	14,304,000		
アイ・エス・ビー	1,400	2,350.00	3,290,000	貸付株式数	500株
アゴーラ・ホスピタリティーG	47,500	29.00	1,377,500	貸付株式数	6,000株
日本空港ビルデング	21,400	4,870.00	104,218,000	貸付株式数	4,200株
トランス・コスモス	6,200	2,712.00	16,814,400		
乃村工藝社	27,800	782.00	21,739,600		
ジャステック	4,200	1,294.00	5,434,800		
S C S K	15,400	5,610.00	86,394,000		
藤田観光	2,900	1,579.00	4,579,100	貸付株式数	1,100株 (100株)
K N T - C Tホールディングス	3,900	1,173.00	4,574,700	貸付株式数	1,500株
日本管財	7,200	2,000.00	14,400,000	貸付株式数	2,700株
トーカイ	6,300	2,094.00	13,192,200		
白 洋 舎	800	2,492.00	1,993,600	貸付株式数	300株
セコム	69,100	9,835.00	679,598,500		
日本システムウエア	2,200	1,956.00	4,303,200		
セントラル警備保障	3,100	3,490.00	10,819,000	貸付株式数	200株
アイネス	6,500	1,460.00	9,490,000		
丹青社	12,200	716.00	8,735,200	貸付株式数	1,000株
メイテック	8,000	5,220.00	41,760,000		
T K C	5,600	5,960.00	33,376,000		
富士ソフト	8,500	4,685.00	39,822,500	貸付株式数	3,300株
応用地質	6,900	1,216.00	8,390,400	貸付株式数	1,300株
船井総研ホールディング	13,400	2,089.00	27,992,600	貸付株式数	2,200株
N S D	21,500	1,817.00	39,065,500		
進学会ホールディングス	2,500	431.00	1,077,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,711.00	1,197,700		
オ オ バ	4,800	740.00	3,552,000	貸付株式数	800株
コナミホールディングス	24,300	4,205.00	102,181,500		

いであ	1,500	1,904.00	2,856,000	貸付株式数	600株
学 究 社	1,800	1,086.00	1,954,800		
ベネッセホールディングス	21,700	2,639.00	57,266,300		
イオンディライト	8,000	2,991.00	23,928,000		
ナック	4,000	979.00	3,916,000		
福井コンピュータH L D S	2,600	2,760.00	7,176,000	貸付株式数	1,000株
ニチイ学館	6,200	1,662.00	10,304,400		
ダイセキ	10,900	2,591.00	28,241,900	貸付株式数	100株
ステップ	2,400	1,558.00	3,739,200	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,800	3,140.00	15,072,000		
泉州電業	2,000	2,860.00	5,720,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,700	2,426.00	4,124,200	貸付株式数	600株
トラスコ中山	14,000	2,445.00	34,230,000	貸付株式数	5,600株
ヤマダ電機	204,500	550.00	112,475,000	貸付株式数	73,400株
オートバックスセブン	25,000	1,380.00	34,500,000	貸付株式数	9,900株
モリト	4,900	593.00	2,905,700	貸付株式数	800株
アークランドサカモト	10,500	2,015.00	21,157,500		
ニトリホールディングス	29,100	21,325.00	620,557,500	貸付株式数	11,600株
グルメ杵屋	4,700	1,049.00	4,930,300	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛 眼	5,400	221.00	1,193,400	貸付株式数	2,100株
ケーユーホールディングス	3,600	798.00	2,872,800	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	22,000	2,101.00	46,222,000	貸付株式数	8,800株 (300株)
加藤産業	9,700	3,585.00	34,774,500		
北恵	1,600	1,031.00	1,649,600	貸付株式数	300株
イノテック	3,900	1,013.00	3,950,700		
イエローハット	12,700	1,717.00	21,805,900	貸付株式数	5,000株
松屋フーズH L D G S	3,200	3,580.00	11,456,000		
J B C Cホールディングス	4,500	1,627.00	7,321,500		
J Kホールディングス	6,000	717.00	4,302,000	貸付株式数	2,100株
サガミホールディングス	8,900	1,398.00	12,442,200	貸付株式数	3,500株
日 伝	6,100	2,093.00	12,767,300	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	5,500	1,243.00	6,836,500		
ミロク情報サービス	5,900	2,163.00	12,761,700	貸付株式数	1,300株 (400株)
北沢産業	5,200	260.00	1,352,000	貸付株式数	200株
杉本商事	3,600	1,861.00	6,699,600	貸付株式数	1,300株
因幡電機産業	19,100	2,603.00	49,717,300		
王将フードサービス	5,000	6,030.00	30,150,000	貸付株式数	1,900株

プレナス	7,600	1,750.00	13,300,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	5,000	1,458.00	7,290,000	貸付株式数 1,700株
アークス	13,700	2,498.00	34,222,600	
バローホールディングス	14,900	2,603.00	38,784,700	
東 テ ク	2,200	2,293.00	5,044,600	
ミスミグループ本社	84,200	2,798.00	235,591,600	貸付株式数 32,500株
藤 久	600	2,066.00	1,239,600	
アルテック	5,600	245.00	1,372,000	
ベ ル ク	3,300	7,010.00	23,133,000	
大 庄	3,500	1,203.00	4,210,500	貸付株式数 1,200株
タキヒヨー	2,000	1,614.00	3,228,000	貸付株式数 700株
ファーストリテイリング	9,000	66,070.00	594,630,000	
ソフトバンクグループ	530,600	5,881.00	3,120,458,600	
蔵王産業	1,200	1,436.00	1,723,200	
スズケン	28,400	4,005.00	113,742,000	
サンドラッグ	25,300	3,850.00	97,405,000	
サックスパーホールディング グ	5,500	537.00	2,953,500	
ジェコス	4,600	917.00	4,218,200	
ヤマザワ	1,600	1,751.00	2,801,600	貸付株式数 600株
や ま や	1,300	2,205.00	2,866,500	貸付株式数 500株
グローセル	6,700	400.00	2,680,000	
ベルーナ	14,400	953.00	13,723,200	
合計			153,692,856,715	

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

ソ ニ ー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	98,892,131	132,331,462
金銭信託	31,017,012	611,292,668
コール・ローン	629,279,068	3,574,103,988
株式	115,283,567,339	140,999,174,005
投資証券	3,552,371,525	3,625,827,420
派生商品評価勘定	52,887,665	227,988,720
未収入金	3,482,459	1,065,022
未収配当金	269,789,646	240,871,993
差入委託証拠金	580,569,760	1,735,126,167
流動資産合計	120,501,856,605	151,147,781,445
資産合計	120,501,856,605	151,147,781,445
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	84,480	66,923,811
未払株式払込金	-	1,527,118
未払解約金	39,091,700	127,076,000
その他未払費用	-	3,885
流動負債合計	39,176,180	195,530,814
負債合計	39,176,180	195,530,814
純資産の部		
元本等		
元本	1	47,561,732,616
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		72,900,947,809
元本等合計		120,462,680,425
純資産合計		120,462,680,425
負債純資産合計		151,147,781,445

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7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) 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。</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>(3) 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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	42,459,485,295円	47,561,732,616円
期中追加設定元本額	8,658,359,408円	17,696,118,320円
期中一部解約元本額	3,556,112,087円	12,084,092,621円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックス V A	457,582,978円	439,361,815円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	12,171,737円	8,557,277円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	152,670,861円	110,319,405円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	19,307,134円	14,001,565円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	504,911,584円	366,430,030円
外国株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	5,564,412円	18,593,234円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	540,017,142円	541,015,910円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,902,089,680円	2,242,049,126円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマーシングプラス(為替 ヘッジなし)	536,713,569円	606,153,675円
D-I's 外国株式インデッ クス	7,630,077円	10,398,463円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,026,256円	5,902,239円

i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,046,985,708円	1,799,731,151円
i F r e e 8資産バランス	767,747,981円	981,559,457円
i F r e e 年金バランス	22,278,762円	39,793,459円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	29,369,923,594円	32,722,733,370円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	582,738,617円	574,709,061円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	867,597,239円	958,205,575円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	670,142,079円	702,812,800円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,509,470,556円	1,560,012,347円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,181,354円	2,376,142円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	13,677,264円	11,395,420円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,740,264円	7,524,388円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	92,504,040円	398,276,470円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	39,782円	2,180,139円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	79,729円	1,816,146円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	104,999円	2,181,059円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	198,647,940円	163,437,118円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	338,775,177円	290,286,800円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	2,737,839,798円	2,354,743,632円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A(適格機関投資家専 用)	143,938,226円	116,241,855円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	- 円	271,255,135円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	683,982,082円	797,886,890円

ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	113,932,367円	179,112,353円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,397,078,388円	1,985,303,957円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,715,828,277円	2,754,569,782円
ダイワライフスタイル25	19,046,698円	18,766,733円
ダイワライフスタイル50	66,894,558円	64,142,004円
ダイワライフスタイル75	54,871,707円	49,922,333円
計	47,561,732,616円	53,173,758,315円
2. 期末日における受益権の総数	47,561,732,616口	53,173,758,315口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7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	8,444,540,003	7,024,537,187
投資証券	463,878,248	400,968,013
合計	8,908,418,251	6,623,569,174

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年12月1日から2019年9月9日まで、及び2019年12月3日から2020年9月7日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2019年9月9日 現在			2020年9月7日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
	(円)			うち		
		(円)	(円)	(円)	(円)	(円)

		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,561,667,857	-	1,609,895,622	48,227,765	6,218,212,122	-	6,369,614,446	151,402,324
合計	1,561,667,857	-	1,609,895,622	48,227,765	6,218,212,122	-	6,369,614,446	151,402,324

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	614,516,580	-	619,092,000	4,575,420	4,125,860,415	-	4,135,523,000	9,662,585
アメリカ・ドル	614,516,580	-	619,092,000	4,575,420	3,064,021,680	-	3,077,964,000	13,942,320
イギリス・ポ ンド	-	-	-	-	120,223,490	-	119,773,500	449,990
オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	128,690,925	-	127,858,500	832,425
カナダ・ドル	-	-	-	-	150,206,495	-	150,423,500	217,005
スイス・フラン	-	-	-	-	175,791,000	-	174,750,000	1,041,000
ユーロ	-	-	-	-	486,926,825	-	484,753,500	2,173,325

合計	614,516,580	-	619,092,000	4,575,420	4,125,860,415	-	4,135,523,000	9,662,585
----	-------------	---	-------------	-----------	---------------	---	---------------	-----------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.5328円	2.8388円
(1万口当たり純資産額)	(25,328円)	(28,388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	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	株 3,750	アメリカ・ドル 135.410	アメリカ・ドル 507,787.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,230	235.650	761,149.500	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,100	94.950	579,195.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	84.980	373,912.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,780	131.700	234,426.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	17,300	26.170	452,741.000	
	ABBOTT LABORATORIES	56,816	104.160	5,917,954.560	

HOWMET AEROSPACE INC	13,233	17.700	234,224.100	
VERISK ANALYTICS INC	4,950	182.770	904,711.500	
LAS VEGAS SANDS CORP	11,100	51.960	576,756.000	
AMPHENOL CORP-CL A	9,650	108.450	1,046,542.500	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	19,912	148.000	2,946,976.000	
QORVO INC	3,650	118.890	433,948.500	
AFLAC INC	21,650	37.860	819,669.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,150	89.280	370,512.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,050	57.580	290,779.000	
ADOBE INC	15,470	491.940	7,610,311.800	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,050	33.180	233,919.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,990	361.410	1,442,025.900	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,400	11.025	158,760.000	
GARMIN LTD	4,650	101.730	473,044.500	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,110	298.430	2,121,837.300	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,750	166.690	3,792,197.500	
WR BERKLEY CORP	4,575	62.940	287,950.500	
AUTOZONE INC	770	1,206.790	929,228.300	
DOLLAR TREE INC	7,721	91.230	704,386.830	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	36,650	9.190	336,813.500	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,500	72.400	253,400.000	
CELANESE CORP	3,750	106.180	398,175.000	
DR HORTON INC	11,316	68.230	772,090.680	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	44.760	313,320.000	
AUTODESK INC	7,130	233.880	1,667,564.400	
MOODY'S CORP	5,450	282.470	1,539,461.500	
ALBEMARLE CORP	3,550	94.720	336,256.000	
ATMOS ENERGY CORP	4,000	97.220	388,880.000	
ALLIANT ENERGY CORP	8,050	53.290	428,984.500	
CITIGROUP INC	67,473	52.520	3,543,681.960	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,870	138.530	1,921,411.100	
AMERICAN ELECTRIC POWER	15,950	79.050	1,260,847.500	
ALLEGHANY CORP	480	551.730	264,830.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,270	381.810	484,898.700	
HESS CORP	9,000	47.150	424,350.000	
DAVITA INC	2,750	87.060	239,415.000	
DANAHER CORP	20,500	196.580	4,029,890.000	

FORTIVE CORP	9,850	74.210	730,968.500	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	17,550	100.080	1,756,404.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17,800	46.490	827,522.000	
BUNGE LTD	4,450	46.480	206,836.000	
TE CONNECTIVITY LTD	10,675	98.750	1,054,156.250	
APPLE INC	560,000	120.960	67,737,600.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,700	57.120	554,064.000	
BOEING CO/THE	17,310	171.050	2,960,875.500	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,165	81.080	418,778.200	
BECTON DICKINSON AND CO	9,419	234.080	2,204,799.520	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	19.040	127,568.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,350	88.490	384,931.500	
CDK GLOBAL INC	4,000	45.410	181,640.000	
NISOURCE INC	12,600	22.280	280,728.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,450	97.900	435,655.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,021	37.500	975,787.500	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	133,104	60.480	8,050,129.920	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	44,700	218.320	9,758,904.000	
ANSYS INC	2,780	321.210	892,963.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	43,117	39.160	1,688,461.720	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	21,700	52.990	1,149,883.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,800	59.950	4,364,360.000	
JPMORGAN CHASE & CO	98,070	103.520	10,152,206.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,700	132.270	1,018,479.000	
LKQ CORP	9,150	31.800	290,970.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,660	179.780	298,434.800	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,062	80.120	806,167.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,050	105.880	958,214.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,010	156.540	627,725.400	
DOLLAR GENERAL CORP	8,100	195.720	1,585,332.000	
SERVICENOW INC	6,080	450.350	2,738,128.000	
CATERPILLAR INC	17,650	148.180	2,615,377.000	
BROWN & BROWN INC	7,950	45.250	359,737.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,300	41.590	303,607.000	
CMS ENERGY CORP	9,300	61.660	573,438.000	
MOSAIC CO/THE	10,950	18.530	202,903.500	
DELTA AIR LINES INC	5,150	31.770	163,615.500	

CORNING INC	24,600	32.050	788,430.000	
CISCO SYSTEMS INC	135,250	40.820	5,520,905.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,200	55.610	233,562.000	
MORGAN STANLEY	38,600	52.710	2,034,606.000	
MSCI INC	2,700	348.180	940,086.000	
FAIR ISAAC CORP	950	419.430	398,458.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,100	277.530	305,283.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,500	61.245	459,337.500	
BROADCOM INC	12,852	362.950	4,664,633.400	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,780	122.830	464,297.400	
ARAMARK	7,200	28.300	203,760.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,250	23.070	167,257.500	
DTE ENERGY COMPANY	6,250	118.810	742,562.500	
CENTENE CORP	18,987	59.670	1,132,954.290	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,500	91.030	318,605.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,450	27.360	367,992.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,150	103.680	637,632.000	
GARTNER INC	2,920	131.180	383,045.600	
SPLUNK INC	5,180	200.140	1,036,725.200	
DOMINION ENERGY INC	26,841	78.440	2,105,408.040	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,850	82.270	1,057,169.500	
SMITH (A.O.) CORP	4,250	48.610	206,592.500	
DEERE & CO	9,650	211.340	2,039,431.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,634	172.560	1,662,443.040	
VMWARE INC-CLASS A	2,680	137.470	368,419.600	
CABLE ONE INC	160	1,845.010	295,201.600	
BURLINGTON STORES INC	2,190	211.830	463,907.700	
NASDAQ INC	3,700	130.290	482,073.000	
VAIL RESORTS INC	1,360	219.720	298,819.200	
EAST WEST BANCORP INC	4,600	37.710	173,466.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,250	96.510	217,147.500	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,430	68.630	166,770.900	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,900	73.040	796,136.000	
COGNEX CORP	5,500	63.190	347,545.000	
TELEFLEX INC	1,500	389.390	584,085.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,800	136.620	382,536.000	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,400	263.660	632,784.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	710	484.230	343,803.300	
CATALENT INC	5,150	83.950	432,342.500	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,280	269.590	1,153,845.200	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	183.000	366,000.000	
IDEX CORP	2,400	177.620	426,288.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,100	77.210	2,015,181.000	
ROLLINS INC	4,925	54.590	268,855.750	
AMETEK INC	7,425	99.470	738,564.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,800	93.300	727,740.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,350	45.340	197,229.000	
HEICO CORP	1,400	111.440	156,016.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	87.470	271,157.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,240	332.470	412,262.800	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,600	72.060	619,716.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,300	329.810	428,753.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	14,190	346.570	4,917,828.300	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,600	115.610	300,586.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,800	316.300	569,340.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,100	84.480	346,368.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	850	1,313.730	1,116,670.500	
UGI CORP	7,050	34.170	240,898.500	
CUMMINS INC	4,850	204.360	991,146.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	24,700	79.010	1,951,547.000	
CDW CORP/DE	4,650	114.250	531,262.500	
SIGNATURE BANK	1,650	101.230	167,029.500	
COSTAR GROUP INC	1,260	826.890	1,041,881.400	
SVB FINANCIAL GROUP	1,710	259.730	444,138.300	
AMERCO	290	363.050	105,284.500	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,150	196.260	618,219.000	
MERCADOLIBRE INC	1,440	1,083.380	1,560,067.200	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,500	163.170	407,925.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,016	90.940	819,915.040	
IPG PHOTONICS CORP	1,170	162.650	190,300.500	
DEXCOM INC	3,000	398.240	1,194,720.000	
NORDSON CORP	1,730	186.880	323,302.400	

COPART INC	6,850	103.490	708,906.500	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,150	35.530	182,979.500	
SEATTLE GENETICS INC	3,950	149.210	589,379.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,420	309.000	747,780.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,650	503.320	830,478.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,800	110.060	308,168.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	11,100	15.280	169,608.000	
KINDER MORGAN INC	64,681	13.520	874,487.120	
HCA HEALTHCARE INC	8,600	137.050	1,178,630.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,220	454.450	554,429.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,400	18.330	227,292.000	
T-MOBILE US INC	17,827	114.290	2,037,447.830	
ZILLOW GROUP INC - C	4,550	83.880	381,654.000	
COCA-COLA CO/THE	131,300	51.040	6,701,552.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,500	44.340	288,210.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,550	87.800	487,290.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,500	21.300	202,350.000	
CSX CORP	24,850	75.510	1,876,423.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,130	175.720	550,003.600	
EXPEDIA GROUP INC	4,375	99.800	436,625.000	
AUTOLIV INC	2,750	77.830	214,032.500	
AMAZON.COM INC	13,640	3,294.620	44,938,616.800	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,240	83.710	1,694,290.400	
EXXON MOBIL CORP	135,905	39.080	5,311,167.400	
FLIR SYSTEMS INC	4,200	35.160	147,672.000	
AES CORP	21,900	17.570	384,783.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	215.550	290,992.500	
EOG RESOURCES INC	18,550	43.140	800,247.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,200	108.430	563,836.000	
ABIOMED INC	1,440	275.890	397,281.600	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,950	96.600	478,170.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,140	96.840	981,957.600	
FORD MOTOR CO	126,323	6.900	871,628.700	
DISCOVERY INC - A	4,690	22.810	106,978.900	
EXACT SCIENCES CORP	4,850	74.700	362,295.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.535	110,128.540	
LIBERTY BROADBAND-A	850	135.380	115,073.000	
DISCOVERY INC-C	10,389	20.440	212,351.160	

AERCAP HOLDINGS NV	4,000	29.870	119,480.000	
FORTINET INC	4,800	117.640	564,672.000	
MARKEL CORP	440	1,068.620	470,192.800	
NEXTERA ENERGY INC	15,700	277.320	4,353,924.000	
MASIMO CORP	1,700	213.720	363,324.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	47,208	16.020	756,272.160	
INSULET CORP	2,070	204.830	423,998.100	
US BANCORP	44,150	38.310	1,691,386.500	
UNITED RENTALS INC	2,350	176.430	414,610.500	
F5 NETWORKS INC	1,900	127.140	241,566.000	
FASTENAL CO	18,600	46.270	860,622.000	
FISERV INC	18,583	99.030	1,840,274.490	
GENERAL ELECTRIC CO	280,550	6.420	1,801,131.000	
GENERAL MOTORS CO	41,700	30.000	1,251,000.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,950	151.700	1,206,015.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,540	210.940	2,223,307.600	
ALPHABET INC-CL A	9,630	1,581.210	15,227,052.300	
ALPHABET INC-CL C	9,787	1,591.040	15,571,508.480	
OWENS CORNING	3,350	65.990	221,066.500	
GENERAL MILLS INC	19,650	63.150	1,240,897.500	
FIRSTENERGY CORP	17,168	29.400	504,739.200	
GENUINE PARTS CO	4,550	97.470	443,488.500	
IHS MARKIT LTD	12,134	79.190	960,891.460	
FIFTH THIRD BANCORP	23,000	21.630	497,490.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,160	181.730	1,301,186.800	
HALLIBURTON CO	27,600	15.990	441,324.000	
HOME DEPOT INC	34,800	269.660	9,384,168.000	
ASSURANT INC	1,900	122.670	233,073.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,800	9.935	315,933.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,290	147.510	190,287.900	
HERSHEY CO/THE	4,740	148.800	705,312.000	
HUMANA INC	4,250	413.190	1,756,057.500	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,000	126.330	1,136,970.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,360	266.450	628,822.000	
HENRY SCHEIN INC	4,500	65.640	295,380.000	
HP INC	45,300	19.230	871,119.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	41,900	9.590	401,821.000	

LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	35.480	212,099.440	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	6,500	37.980	246,870.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	35.670	105,226.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,200	31.870	420,684.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	21,753	33.470	728,072.910	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	28,400	122.300	3,473,320.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	12,200	39.030	476,166.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,350	82.560	359,136.000	
ZOETIS INC	15,250	157.240	2,397,910.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,779	117.770	916,132.830	
CHENIERE ENERGY INC	7,150	52.050	372,157.500	
ALLEGION PLC	2,900	99.670	289,043.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	22.010	285,535.730	
WASTE CONNECTIONS INC	8,507	99.220	844,064.540	
JUNIPER NETWORKS INC	10,500	23.240	244,020.000	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,400	132.750	318,600.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,670	117.560	431,445.200	
JOHNSON & JOHNSON	84,600	148.590	12,570,714.000	
ABBVIE INC	56,772	91.870	5,215,643.640	
HOLOGIC INC	8,350	58.240	486,304.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,000	152.230	1,674,530.000	
KROGER CO	25,500	35.470	904,485.000	
KLA CORP	5,030	193.370	972,651.100	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,080	385.020	3,110,961.600	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,780	238.040	661,751.200	
LOWE'S COS INC	24,450	156.390	3,823,735.500	
ELI LILLY & CO	27,585	150.910	4,162,852.350	
LAM RESEARCH CORP	4,700	333.120	1,565,664.000	
JONES LANG LASALLE INC	1,650	103.030	169,999.500	
LOEWS CORP	8,300	36.870	306,021.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,249	38.220	238,836.780	
MCDONALD'S CORP	23,900	211.730	5,060,347.000	
3M CO	18,500	165.770	3,066,745.000	
FACEBOOK INC-CLASS A	77,350	282.730	21,869,165.500	
S&P GLOBAL INC	7,800	345.180	2,692,404.000	

MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,960	215.110	421,615.600	
CONCHO RESOURCES INC	6,200	50.650	314,030.000	
PHILLIPS 66	14,150	58.980	834,567.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	23.520	358,680.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,050	201.850	817,492.500	
MYLAN NV	16,050	15.810	253,750.500	
METLIFE INC	24,800	39.150	970,920.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	21,700	37.360	810,712.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,870	211.100	394,757.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	37.290	178,992.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,458	153.040	835,292.320	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	780	949.260	740,422.800	
BAKER HUGHES CO	21,373	14.530	310,549.690	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,760	228.250	858,220.000	
MERCK & CO. INC.	81,171	85.240	6,919,016.040	
DUPONT DE NEMOURS INC	23,468	58.800	1,379,918.400	
MASCO CORP	8,700	56.420	490,854.000	
M & T BANK CORP	4,289	105.900	454,205.100	
MARSH & MCLENNAN COS	16,500	115.410	1,904,265.000	
BLACK KNIGHT INC	4,700	81.570	383,379.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,200	91.670	201,674.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	8,772	104.820	919,481.040	
WORKDAY INC-CLASS A	5,680	215.800	1,225,744.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,100	260.940	547,974.000	
SQUARE INC - A	11,800	146.390	1,727,402.000	
TRANSUNION	6,150	84.060	516,969.000	
VISTRA CORP	14,250	18.230	259,777.500	
BEIGENE LTD-ADR	1,450	240.170	348,246.500	
NETAPP INC	6,900	46.400	320,160.000	
NIKE INC -CL B	39,900	112.400	4,484,760.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,200	209.100	1,714,620.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,000	108.150	865,200.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,150	76.620	317,973.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,650	25.240	294,046.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,120	339.030	1,735,833.600	
APTIV PLC	8,700	86.210	750,027.000	

NEWMONT CORP	25,861	65.350	1,690,016.350	
MCKESSON CORP	5,250	152.430	800,257.500	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,700	68.680	597,516.000	
XYLEM INC	5,870	81.870	480,576.900	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	50,100	79.150	3,965,415.000	
NUCOR CORP	9,900	46.900	464,310.000	
WESTERN UNION CO	12,946	23.030	298,146.380	
GODADDY INC - CLASS A	5,700	79.520	453,264.000	
NEWELL BRANDS INC	12,542	16.320	204,685.440	
EVERGY INC	7,400	51.870	383,838.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,124	12.250	344,519.000	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	820	209.940	172,150.800	
OKTA INC	3,660	203.440	744,590.400	
COUPA SOFTWARE INC	2,180	285.810	623,065.800	
LIBERTY BROADBAND-C	3,350	136.800	458,280.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,405	28.100	348,580.500	
LINDE PLC	16,996	247.700	4,209,909.200	
WIX.COM LTD	1,780	258.490	460,112.200	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	20.970	278,901.000	
KKR & CO INC	16,300	35.700	581,910.000	
PAYCHEX INC	10,250	76.060	779,615.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,410	471.010	1,135,134.100	
ALTRIA GROUP INC	59,600	43.490	2,592,004.000	
P G & E CORP	35,500	9.190	326,245.000	
PFIZER INC	178,513	36.360	6,490,732.680	
CIGNA CORP	11,910	178.610	2,127,245.100	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,851	64.650	507,567.150	
ALTICE USA INC- A	10,900	26.650	290,485.000	
XCEL ENERGY INC	17,050	70.020	1,193,841.000	
STERIS PLC	2,650	157.920	418,488.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	27.760	150,820.080	
FOX CORP - CLASS A	10,849	27.660	300,083.340	
STRYKER CORP	10,820	197.620	2,138,248.400	
DOW INC	24,068	48.600	1,169,704.800	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,800	53.190	148,932.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,180	369.890	1,916,030.200	
PARKER HANNIFIN CORP	4,170	207.300	864,441.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	30,700	33.240	1,020,468.000	

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,350	99.100	530,185.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	79,417	137.960	10,956,369.320	
EXELON CORP	31,572	37.090	1,171,005.480	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,050	112.970	796,438.500	
TELADOC HEALTH INC	2,300	198.290	456,067.000	
INGERSOLL-RAND INC	11,358	35.310	401,050.980	
NVR INC	110	3,931.930	432,512.300	
CONOCOPHILLIPS	34,700	35.860	1,244,342.000	
TWILIO INC - A	3,850	233.500	898,975.000	
DOCUSIGN INC	5,550	216.260	1,200,243.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,610	270.750	435,907.500	
PEPSICO INC	44,600	138.760	6,188,696.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	101.980	132,574.000	
DROPBOX INC-CLASS A	8,000	19.750	158,000.000	
MONGODB INC	1,500	214.510	321,765.000	
SNAP INC - A	28,300	22.440	635,052.000	
CORTEVA INC	23,968	29.320	702,741.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,800	69.710	892,288.000	
AMCOR PLC	52,200	11.020	575,244.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,650	125.190	582,133.500	
ROKU INC	3,350	159.910	535,698.500	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,750	143.170	823,227.500	
ACCENTURE PLC-CL A	20,430	236.070	4,822,910.100	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	12,600	29.070	366,282.000	
PENTAIR PLC	5,505	44.870	247,009.350	
QUALCOMM INC	36,450	115.970	4,227,106.500	
INVESCO LTD	12,000	11.390	136,680.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,200	153.750	338,250.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,650	43.420	375,583.000	
DATADOG INC - CLASS A	4,350	79.570	346,129.500	
PINTEREST INC- CLASS A	13,100	34.380	450,378.000	
AVALARA INC	2,500	123.370	308,425.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,250	580.360	1,886,170.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,100	93.500	663,850.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,310	1,917.740	2,512,239.400	

ROSS STORES INC	11,450	93.320	1,068,514.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,100	106.550	330,305.000	
RESMED INC	4,700	173.560	815,732.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,350	108.890	473,671.500	
ROBERT HALF INTL INC	3,600	53.200	191,520.000	
MODERNA INC	8,800	62.600	550,880.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	74.050	107,372.500	
PERKINELMER INC	3,550	114.300	405,765.000	
CARRIER GLOBAL CORP	26,637	30.000	799,110.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	13,268	61.490	815,849.320	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	46.610	270,338.000	
AVANTOR INC	13,500	21.210	286,335.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,700	25.820	121,354.000	
DYNATRACE INC	6,100	39.990	243,939.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,330	441.260	586,875.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,235	11.800	356,773.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,530	126.200	319,286.000	
MATCH GROUP INC	7,920	105.940	839,044.800	
CHEVRON CORP	60,118	81.930	4,925,467.740	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	6,500	80.630	524,095.000	
ZSCALER INC	2,400	134.340	322,416.000	
EDISON INTERNATIONAL	12,350	52.260	645,411.000	
TESLA INC	23,850	418.320	9,976,932.000	
NORTONLIFELOCK INC	17,850	23.390	417,511.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,022	160.130	804,172.860	
SYNOPSIS INC	4,900	208.980	1,024,002.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,685	604.020	2,829,833.700	
CBRE GROUP INC - A	10,850	48.220	523,187.000	
TWITTER INC	25,250	39.870	1,006,717.500	
SOUTHERN CO/THE	33,850	52.290	1,770,016.500	
SYSCO CORP	15,400	60.140	926,156.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,153	116.570	950,395.210	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	51.800	222,740.000	
STEEL DYNAMICS INC	6,600	30.660	202,356.000	
SCHLUMBERGER LTD	44,302	19.310	855,471.620	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,050	42.530	214,776.500	

AT&T INC	228,791	29.420	6,731,031.220	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,700	39.390	185,133.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,900	22.680	292,572.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,690	679.620	1,828,177.800	
SEMPRA ENERGY	9,420	120.890	1,138,783.800	
TIFFANY & CO	3,470	121.790	422,611.300	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,650	47.010	359,626.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,750	140.470	4,178,982.500	
SALESFORCE.COM INC	28,821	254.700	7,340,708.700	
WESTROCK CO	8,530	32.540	277,566.200	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	24,484	41.310	1,011,434.040	
TERADYNE INC	5,500	78.600	432,300.000	
UNION PACIFIC CORP	21,980	191.140	4,201,257.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	20,588	33.640	692,580.320	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	48,729	61.170	2,980,752.930	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	22,550	160.780	3,625,589.000	
IQVIA HOLDINGS INC	6,244	160.210	1,000,351.240	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	50.780	220,893.000	
AMEREN CORPORATION	8,050	78.960	635,628.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	30,496	312.000	9,514,752.000	
VERISIGN INC	3,370	203.540	685,929.800	
VALERO ENERGY CORP	13,142	51.220	673,133.240	
ULTA BEAUTY INC	1,760	240.510	423,297.600	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,688	33.270	289,049.760	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	113.570	283,925.000	
ANTHEM INC	8,100	276.220	2,237,382.000	
WALT DISNEY CO/THE	58,062	131.990	7,663,603.380	
WELLS FARGO & CO	125,422	24.790	3,109,211.380	
WASTE MANAGEMENT INC	13,700	111.210	1,523,577.000	
WILLIAMS COS INC	38,900	20.690	804,841.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,700	142.080	525,696.000	
WHIRLPOOL CORP	1,950	168.000	327,600.000	
WALMART INC	45,500	142.830	6,498,765.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,750	139.800	943,650.000	
WYNN RESORTS LTD	3,050	87.720	267,546.000	
WABTEC CORP	5,861	69.040	404,643.440	
TJX COMPANIES INC	38,650	55.180	2,132,707.000	
WATERS CORP	2,050	206.070	422,443.500	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,760	260.550	458,568.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	23,900	36.890	881,671.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,173	208.430	869,778.390	
WESTERN DIGITAL CORP	9,750	38.160	372,060.000	
WEC ENERGY GROUP INC	9,980	96.490	962,970.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,100	52.520	845,572.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	54,400	204.660	11,133,504.000	
PPL CORP	24,800	28.290	701,592.000	
PULTEGROUP INC	8,900	43.210	384,569.000	
PPG INDUSTRIES INC	7,650	122.610	937,966.500	
NORTHERN TRUST CORP	6,400	84.450	540,480.000	
NVIDIA CORP	19,750	504.900	9,971,775.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,843	113.100	1,565,643.300	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	39.300	208,290.000	
TYSON FOODS INC-CL A	9,400	62.420	586,748.000	
NETFLIX INC	14,120	516.050	7,286,626.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,770	409.980	5,235,444.600	
NRG ENERGY INC	7,950	33.380	265,371.000	
GLOBE LIFE INC	3,225	83.890	270,545.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,400	114.530	618,462.000	
TEXTRON INC	7,150	38.940	278,421.000	
NEWS CORP - CLASS A	11,737	14.950	175,468.150	
OGE ENERGY CORP	6,750	31.540	212,895.000	
OMNICOM GROUP	7,150	54.080	386,672.000	
ORACLE CORP	72,033	55.730	4,014,399.090	
MASTERCARD INC - A	28,750	335.010	9,631,537.500	
ONEOK INC	14,400	26.760	385,344.000	
CENTURYLINK INC	28,852	10.760	310,447.520	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,420	422.530	1,445,052.600	
YUM! BRANDS INC	9,800	95.220	933,156.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,700	161.710	598,327.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,050	38.320	231,836.000	
BANK OF AMERICA CORP	251,401	26.540	6,672,182.540	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,210	318.070	384,864.700	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,850	76.000	444,600.000	
AMERICAN EXPRESS CO	21,900	105.670	2,314,173.000	
ANALOG DEVICES INC	11,899	117.440	1,397,418.560	
ADVANCED MICRO DEVICES	37,600	82.010	3,083,576.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,850	39.090	345,946.500	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	28,322	29.800	843,995.600	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,500	139.010	764,555.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,900	71.950	424,505.000	
AVERY DENNISON CORP	2,750	119.080	327,470.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,400	66.810	1,162,494.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,700	69.540	1,369,938.000	
AON PLC-CLASS A	7,370	202.740	1,494,193.800	
AMGEN INC	18,900	248.400	4,694,760.000	
EATON CORP PLC	13,086	102.580	1,342,361.880	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,330	191.520	1,020,801.600	
APPLIED MATERIALS INC	29,600	60.960	1,804,416.000	
CME GROUP INC	11,500	169.620	1,950,630.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	12.150	142,082.100	
ECOLAB INC	8,250	204.760	1,689,270.000	
EQUIFAX INC	3,900	166.390	648,921.000	
GILEAD SCIENCES INC	40,250	66.010	2,656,902.500	
KEURIG DR PEPPER INC	11,500	29.540	339,710.000	
HORMEL FOODS CORP	9,600	51.080	490,368.000	
STATE STREET CORP	11,193	68.350	765,041.550	
SCHWAB (CHARLES) CORP	37,300	36.200	1,350,260.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	16,500	82.300	1,357,950.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	47.580	285,480.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,200	77.350	324,870.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,450	49.720	469,854.000	
FEDEX CORP	8,050	226.120	1,820,266.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,804	73.990	1,095,347.960	
FMC CORP	4,200	108.480	455,616.000	
CERNER CORP	10,050	72.010	723,700.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,824	123.120	347,690.880	
CITRIX SYSTEMS INC	3,800	137.140	521,132.000	
INTEL CORP	136,400	50.080	6,830,912.000	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,400	17.840	221,216.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,650	40.940	476,951.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,300	193.900	1,997,170.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,600	5.720	197,912.000	
ILLUMINA INC	4,720	342.390	1,616,080.800	
SEALED AIR CORP	5,000	39.780	198,900.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,770	735.280	2,772,005.600	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	119.980	485,919.000	
SNAP-ON INC	1,630	151.220	246,488.600	
CARMAX INC	5,350	105.580	564,853.000	
COMERICA INC	4,500	41.470	186,615.000	
INGREDION INC	2,150	81.510	175,246.500	
DUKE ENERGY CORP	23,528	80.970	1,905,062.160	
TARGET CORP	16,280	147.230	2,396,904.400	
DOVER CORP	4,550	109.620	498,771.000	
WW GRAINGER INC	1,490	358.080	533,539.200	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,250	91.960	390,830.000	
CINTAS CORP	2,820	331.110	933,730.200	
CONAGRA BRANDS INC	15,800	37.130	586,654.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,750	62.440	296,590.000	
CLOROX COMPANY	4,050	212.520	860,706.000	
ENTERGY CORP	6,350	97.900	621,665.000	
MICROSOFT CORP	231,800	214.250	49,663,150.000	
INCYTE CORP	6,000	90.490	542,940.000	
CVS HEALTH CORP	42,069	60.240	2,534,236.560	
MEDTRONIC PLC	43,148	105.740	4,562,469.520	
MICRON TECHNOLOGY INC	35,800	46.480	1,663,984.000	
BLACKROCK INC	4,900	564.630	2,766,687.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,800	19.870	313,946.000	
HASBRO INC	4,050	79.055	320,172.750	
KELLOGG CO	8,400	69.220	581,448.000	
KEYCORP	30,600	12.890	394,434.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,150	188.000	592,200.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	46,011	57.880	2,663,116.680	
COOPER COS INC/THE	1,770	323.490	572,577.300	
CHUBB LTD	14,519	125.560	1,823,005.640	

ARROW ELECTRONICS INC	2,700	77.950	210,465.000	
ALLSTATE CORP	10,250	93.810	961,552.500	
EBAY INC	25,650	52.540	1,347,651.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	35,850	191.840	6,877,464.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,250	78.930	335,452.500	
XILINX INC	8,000	101.640	813,120.000	
DISH NETWORK CORP-A	7,500	33.780	253,350.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	33.680	175,136.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,300	216.220	1,578,406.000	
TRIMBLE INC	8,250	49.960	412,170.000	
LENNAR CORP-A	9,000	73.620	662,580.000	
LEAR CORP	1,800	120.450	216,810.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	54.530	381,710.000	
PROGRESSIVE CORP	18,900	92.940	1,756,566.000	
PACCAR INC	11,037	85.620	944,987.940	
BIOGEN INC	5,620	276.000	1,551,120.000	
IDEXX LABORATORIES INC	2,770	370.660	1,026,728.200	
STARBUCKS CORP	37,450	86.270	3,230,811.500	
PTC INC	3,400	87.690	298,146.000	
PERRIGO CO PLC	4,200	50.860	213,612.000	
EVERSOURCE ENERGY	10,980	86.080	945,158.400	
INTUIT INC	8,410	333.110	2,801,455.100	
BORGWARNER INC	6,500	42.070	273,455.000	
BEST BUY CO INC	7,600	106.310	807,956.000	
BALL CORP	10,584	82.470	872,862.480	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	46,297	41.480	1,920,399.560	
ELECTRONIC ARTS INC	9,250	130.130	1,203,702.500	
VULCAN MATERIALS CO	4,350	125.000	543,750.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,300	266.500	2,211,950.000	
VF CORP	10,900	68.220	743,598.000	
VIACOMCBS INC - CLASS B	18,375	28.750	528,281.250	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	92.430	175,617.000	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,850	173.850	495,472.500	
CARNIVAL CORP	15,300	18.530	283,509.000	
COMCAST CORP-CLASS A	146,390	44.430	6,504,107.700	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	7,200	20.170	145,224.000	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,500	40.190	301,425.000	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	4.060	36,540.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,300	3.890	156,767.000	

アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル	
				955,593,609.960	
				(101,636,936,355)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	653,000	2.575	1,681,475.000	
	UNILEVER PLC	37,710	44.260	1,669,044.600	
	BARCLAYS PLC	568,800	1.068	607,933.440	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	64,500	2.175	140,287.500	
	PRUDENTIAL PLC	84,900	11.350	963,615.000	
	NATWEST GROUP PLC	145,791	1.078	157,162.690	
	EVRAZ PLC	15,000	3.272	49,080.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	24.260	147,112.640	
	BAE SYSTEMS PLC	102,300	5.038	515,387.400	
	AVIVA PLC	128,966	2.736	352,850.970	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	47.180	94,360.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	161,600	14.352	2,319,283.200	
	INFORMA PLC	49,900	3.953	197,254.700	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	156,500	1.155	180,835.750	
	AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	5.410	172,579.000	
	DCC PLC	3,150	62.560	197,064.000	
	OCADO GROUP PLC	15,200	22.920	348,384.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,300	101.750	234,025.000	
	HALMA PLC	12,250	21.580	264,355.000	
	GVC HOLDINGS PLC	19,100	8.090	154,519.000	
	JD SPORTS FASHION PLC	13,000	7.150	92,950.000	
	M&G PLC	83,700	1.574	131,743.800	
	RELX PLC	63,146	16.945	1,070,008.970	
	DIAGEO PLC	75,400	24.965	1,882,361.000	
	RIO TINTO PLC	36,200	45.755	1,656,331.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	86,800	3.753	325,760.400	
	TESCO PLC	320,700	2.158	692,070.600	
	SMITH & NEPHEW PLC	27,950	14.920	417,014.000	
	GLENCORE PLC	319,725	1.714	548,136.540	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,250	15.395	157,798.750	
	SMITHS GROUP PLC	12,383	13.795	170,823.480	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	2.880	120,911.040	
	PEARSON PLC	23,563	5.210	122,763.230	

SAINSBURY (J) PLC	54,225	1.828	99,123.300	
NEXT PLC	4,200	56.980	239,316.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	117,700	1.148	135,178.450	
WHITBREAD PLC	6,861	25.260	173,308.860	
BUNZL PLC	10,405	23.640	245,974.200	
VODAFONE GROUP PLC	870,183	1.052	915,954.620	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,011	58.240	233,600.640	
KINGFISHER PLC	68,211	2.706	184,578.960	
WPP PLC	38,400	6.286	241,382.400	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,627	8.352	172,276.700	
SEVERN TRENT PLC	7,833	23.600	184,858.800	
RENTOKIL INITIAL PLC	61,200	5.096	311,875.200	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,950	71.040	1,630,368.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	16,550	9.234	152,822.700	
SCHRODERS PLC	4,150	27.010	112,091.500	
SSE PLC	33,900	12.025	407,647.500	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	31,000	5.018	155,558.000	
ASTRAZENECA PLC	42,000	79.700	3,347,400.000	
FERGUSON PLC	7,487	70.800	530,079.600	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	195,500	2.043	399,406.500	
3I GROUP PLC	31,391	8.704	273,227.260	
ASHTAD GROUP PLC	14,650	25.610	375,186.500	
SAGE GROUP PLC/THE	35,114	7.030	246,851.420	
NATIONAL GRID PLC	114,434	8.334	953,692.950	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,296,465	0.269	618,667.670	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	4.370	138,791.200	
IMPERIAL BRANDS PLC	30,400	13.040	396,416.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	44.750	185,712.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	74,310	25.545	1,898,248.950	
BHP GROUP PLC	68,727	16.554	1,137,706.750	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,500	20.270	233,105.000	
HSBC HOLDINGS PLC	657,650	3.197	2,102,835.870	
ANGLO AMERICAN PLC	40,383	18.326	740,058.850	
MONDI PLC	15,650	14.390	225,203.500	
WM MORRISON SUPERMARKETS	73,400	1.908	140,047.200	
COMPASS GROUP PLC	57,439	12.500	717,987.500	
PERSIMMON PLC	9,900	25.030	247,797.000	

	BT GROUP PLC	290,100	1.016	294,886.650	
	COCA-COLA HBC AG-DI	6,550	20.130	131,851.500	
	BURBERRY GROUP PLC	13,289	14.660	194,816.740	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,636	44.270	249,505.720	
	INTERTEK GROUP PLC	5,200	58.320	303,264.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	10,099	84.880	857,203.120	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	132,500	10.782	1,428,615.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	118,818	10.356	1,230,479.200	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	24.570	140,049.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,150	25.560	157,194.000	
	ANTOFAGASTA PLC	12,800	10.835	138,688.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.249	159,368.630	
	EXPERIAN PLC	29,654	26.700	791,761.800	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 44,417,303.110 (6,259,730,528)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,500	10.290	355,005.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,400	172.100	240,940.000	
	ICL GROUP LTD	23,600	12.110	285,796.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	750	431.700	323,775.000	
	BANK HAPOALIM BM	35,700	19.600	699,720.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,200	16.510	845,312.000	
	NICE LTD	2,050	746.000	1,529,300.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	66.600	273,060.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 4,552,908.000 (143,735,305)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	88,800	2.540	225,552.000	
	BHP GROUP LTD	93,750	36.190	3,392,812.500	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.150	325,940.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,550	18.970	579,533.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	54,000	17.520	946,080.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	102,450	17.350	1,777,507.500	
	WESTPAC BANKING CORP	114,948	17.060	1,961,012.880	
	SANTOS LTD	53,100	5.310	281,961.000	

AUSNET SERVICES	50,000	1.850	92,500.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	89,050	17.810	1,585,980.500	
RIO TINTO LTD	11,750	95.580	1,123,065.000	
ORIGIN ENERGY LTD	53,500	5.330	285,155.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	4.320	259,200.000	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	20.610	70,074.000	
COLES GROUP LTD	43,045	17.110	736,499.950	
WISETECH GLOBAL LTD	4,500	27.530	123,885.000	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	25,000	13.150	328,750.000	
EVOLUTION MINING LTD	53,000	5.520	292,560.000	
AFTERPAY LTD	7,000	78.200	547,400.000	
TPG TELECOM LTD	12,000	7.810	93,720.000	
OIL SEARCH LTD	64,200	3.110	199,662.000	
SEEK LTD	10,700	20.160	215,712.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	9.020	211,970.000	
NEWCREST MINING LTD	26,000	30.860	802,360.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	56,450	66.730	3,766,908.500	
AMPOL LTD	7,950	25.000	198,750.000	
ORICA LTD	13,100	17.040	223,224.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	46,450	9.820	456,139.000	
CIMIC GROUP LTD	2,800	20.820	58,296.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	39,700	38.010	1,508,997.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	15,700	9.070	142,399.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	72,763	3.550	258,308.650	
CROWN RESORTS LTD	11,600	9.160	106,256.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	24,000	3.890	93,360.000	
TELSTRA CORP LTD	134,500	2.840	381,980.000	
AMP LTD	102,000	1.630	166,260.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,250	30.140	429,495.000	
MACQUARIE GROUP LTD	10,684	126.200	1,348,320.800	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	18,450	29.060	536,157.000	
CSL LTD	14,500	279.050	4,046,225.000	
WESFARMERS LTD	36,000	46.740	1,682,640.000	
COCHLEAR LTD	2,050	190.040	389,582.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	12.920	210,596.000	
SUNCORP GROUP LTD	38,257	9.070	346,990.990	
ASX LTD	6,250	85.900	536,875.000	

	COMPUTERSHARE LTD	15,900	12.740	202,566.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	4.750	336,946.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	14,350	32.510	466,518.500	
	AGL ENERGY LTD	19,000	15.020	285,380.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	10.870	547,848.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,750	64.700	372,025.000	
	REA GROUP LTD	1,600	112.810	180,496.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	58.520	222,376.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 35,960,808.270 (2,786,962,642)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	20.910	173,553.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,472.810	883,686.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,287	73.180	679,622.660	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	14,400	67.400	970,560.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,650	136.820	636,213.000	
	BCE INC	4,930	55.840	275,291.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	6,200	190.110	1,178,682.000	
	SUNCOR ENERGY INC	48,530	20.240	982,247.200	
	METRO INC/CN	8,200	58.750	481,750.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	11,000	72.580	798,380.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	39,300	55.340	2,174,862.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,150	104.090	1,472,873.500	
	TORONTO-DOMINION BANK	58,400	63.420	3,703,728.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	25.760	213,808.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	45,850	96.910	4,443,323.500	
	TC ENERGY CORP	30,450	59.500	1,811,775.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,829	32.020	570,884.580	
	BARRICK GOLD CORP	57,700	37.900	2,186,830.000	
	CAE INC	7,900	19.860	156,894.000	
	THOMSON REUTERS CORP	5,512	99.290	547,286.480	
	EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	32.960	174,688.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	47.360	220,224.000	
	HYDRO ONE LTD	10,500	27.060	284,130.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	66.780	364,618.800	
	WSP GLOBAL INC	3,400	88.240	300,016.000	

PARKLAND CORP	4,400	35.630	156,772.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.520	172,356.000	
EMERA INC	7,700	53.120	409,024.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	32.350	129,400.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,200	55.520	621,824.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,800	102.870	802,386.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	18,900	17.890	338,121.000	
B2GOLD CORP	34,700	8.420	292,174.000	
AIR CANADA	4,100	18.630	76,383.000	
KINROSS GOLD CORP	40,300	11.270	454,181.000	
BANK OF MONTREAL	20,700	81.370	1,684,359.000	
POWER CORP OF CANADA	18,100	25.650	464,265.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,500	1,270.000	4,445,000.000	
NUTRIEN LTD	18,219	49.210	896,556.990	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	21.110	156,214.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	7.020	38,610.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	67.450	593,560.000	
CAMECO CORP	12,800	14.180	181,504.000	
TELUS CORP	10,800	23.800	257,040.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	15.350	231,785.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	134.930	242,874.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	37,600	25.710	966,696.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	399.400	359,460.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	63.590	585,028.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,537	93.890	238,198.930	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	45.010	315,070.000	
BLACKBERRY LTD	16,000	6.660	106,560.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	18,650	54.380	1,014,187.000	
ENBRIDGE INC	65,400	41.240	2,697,096.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,425	43.420	1,885,513.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	61,500	19.160	1,178,340.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,500	21.240	201,780.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,300	379.130	1,630,259.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	46.960	154,968.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	26.540	167,202.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,050	135.380	3,120,509.000	
CGI INC - CLASS A	7,900	91.040	719,216.000	

	ONEX CORPORATION	2,600	63.520	165,152.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	15,100	24.210	365,571.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,400	31.790	76,296.000	
	TMX GROUP LTD	1,900	134.650	255,835.000	
	OPEN TEXT CORP	8,700	56.900	495,030.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	18.340	128,380.000	
	SAPUTO INC	8,000	32.310	258,480.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	12.930	249,549.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	27,500	44.580	1,225,950.000	
	YAMANA GOLD INC	32,300	7.840	253,232.000	
	FORTIS INC	15,000	52.010	780,150.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	74.610	283,518.000	
	LUNDIN MINING CORP	19,400	8.230	159,662.000	
	CENOVUS ENERGY INC	31,400	6.060	190,284.000	
	DOLLARAMA INC	9,700	49.420	479,374.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	39.200	86,240.000	
	ALTAGAS LTD	9,100	16.780	152,698.000	
	KEYERA CORP	7,400	23.950	177,230.000	
	INTER PIPELINE LTD	12,800	14.200	181,760.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 59,634,790.340 (4,850,097,499)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	40,700	19.450	791,615.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	61,500	20.680	1,271,820.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,675	3.620	158,103.500	
	KEPPEL CORP LTD	51,300	4.360	223,668.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	6.550	91,700.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.950	127,995.000	
	CAPITALAND LTD	82,900	2.750	227,975.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	91,300	0.930	84,909.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	18.560	50,112.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	113,400	8.560	970,704.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.695	145,255.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	19.060	163,916.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	278,950	2.270	633,216.500	

	SINGAPORE TECH ENGINEERING	50,000	3.420	171,000.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,300	8.680	236,964.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	65,900	4.370	287,983.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,636,936.000 (439,230,053)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	117,400	11.140	1,307,836.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	260	811.000	210,860.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,650	47.340	220,131.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	22,630	317.250	7,179,367.500	
	SIKA AG-REG	4,560	213.100	971,736.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	80,100.000	240,300.000	
	ABB LTD-REG	60,100	23.230	1,396,123.000	
	SWISS RE AG	9,400	73.500	690,900.000	
	NESTLE SA-REG	95,900	108.320	10,387,888.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	590	868.000	512,120.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	241.100	303,786.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	77,570	9.940	771,045.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	41.580	307,692.000	
	SGS SA-REG	190	2,351.000	446,690.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	238.600	138,388.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,450	122.500	177,625.000	
	TEMENOS AG - REG	2,120	136.350	289,062.000	
	ALCON INC	16,130	50.520	814,887.600	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	199.650	169,702.500	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,862	334.700	1,627,311.400	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	140.400	220,428.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	18.915	107,815.500	
	NOVARTIS AG-REG	71,300	78.780	5,617,014.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	2,024.000	202,400.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT- REG	16,660	61.820	1,029,921.200	
	SWISSCOM AG-REG	830	502.600	417,158.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	1,010	95.800	96,758.000	
	GEBERIT AG-REG	1,190	509.400	606,186.000	
	GIVAUDAN-REG	300	3,799.000	1,139,700.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	886.200	301,308.000	

	SONOVA HOLDING AG-REG	1,822	207.600	378,247.200	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,500	62.740	345,070.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,400	539.200	1,294,080.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	37.960	57,699.200	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,290	42.070	727,390.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	368.500	383,240.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,670	171.750	286,822.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,330	81.800	190,594.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,585.000	257,890.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 41,823,173.700 (4,869,890,345)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	3,300	424.500	1,400,850.000	
	ERICSSON LM-B SHS	99,630	98.000	9,763,740.000	
	VOLVO AB-B SHS	50,850	171.150	8,702,977.500	
	SKF AB-B SHARES	12,200	179.650	2,191,730.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	7,600	185.450	1,409,420.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,450	655.800	3,574,110.000	
	TELE2 AB-B SHS	16,800	124.550	2,092,440.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	55,200	83.740	4,622,448.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	52,850	83.320	4,403,462.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	30,500	145.360	4,433,480.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,000	137.600	3,715,200.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	20,700	115.100	2,382,570.000	
	SKANSKA AB-B SHS	11,550	175.850	2,031,067.500	
	SANDVIK AB	38,450	172.900	6,648,005.000	
	INVESTOR AB-B SHS	15,600	549.200	8,567,520.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	22,950	397.600	9,124,920.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,550	121.250	1,157,937.500	
	TELIA CO AB	82,000	34.190	2,803,580.000	
	ALFA LAVAL AB	10,050	205.200	2,062,260.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,250	352.200	4,666,650.000	
	ASSA ABLOY AB-B	34,150	200.600	6,850,490.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,600	401.000	1,042,600.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	192.100	998,920.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10,400	227.600	2,367,040.000	

	LUNDIN ENERGY AB	6,350	201.400	1,278,890.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	20,600	295.000	6,077,000.000	
	BOLIDEN AB	9,300	263.800	2,453,340.000	
	EPIROC AB-A	22,250	128.600	2,861,350.000	
	EPIROC AB-B	13,500	124.150	1,676,025.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,150	91.540	1,295,291.000	
	NORDEA BANK ABP	111,100	69.290	7,698,119.000	
	EQT AB	8,100	159.050	1,288,305.000	
	EVOLUTION GAMING GROUP	4,400	573.600	2,523,840.000	
	KINNEVIK AB - B	8,300	318.700	2,645,210.000	
	HEXAGON AB-B SHS	9,300	631.800	5,875,740.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	229.800	1,309,860.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 133,996,387.500 (1,632,075,999)	
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	59,500	408.900	24,329,550.000	
	DANSKE BANK A/S	22,700	90.340	2,050,718.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	105	8,875.000	931,875.000	
	H LUNDBECK A/S	2,300	200.500	461,150.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,800	924.600	6,287,280.000	
	GN STORE NORD A/S	4,300	438.900	1,887,270.000	
	CARLSBERG AS-B	3,650	871.000	3,179,150.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,250	378.400	2,743,400.000	
	COLOPLAST-B	4,050	999.600	4,048,380.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,160	950.200	6,803,432.000	
	DEMANT A/S	3,425	184.650	632,426.250	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	200	9,606.000	1,921,200.000	
	TRYG A/S	4,000	186.800	747,200.000	
	PANDORA A/S	3,150	465.000	1,464,750.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,450	686.800	2,369,460.000	
	GENMAB A/S	2,210	2,178.000	4,813,380.000	
	ORSTED A/S	6,400	848.200	5,428,480.000	
	AMBU A/S-B	5,600	169.300	948,080.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 71,047,181.250 (1,202,118,306)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	

	MERIDIAN ENERGY LTD	41,500	4.945	205,217.500	
	MERCURY NZ LTD	23,000	5.190	119,370.000	
	A2 MILK CO LTD	24,600	18.270	449,442.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	62,089	4.810	298,648.090	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,900	7.085	275,606.500	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	19,400	34.250	664,450.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,000	13.880	194,320.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,207,054.090 (157,561,591)	
ノルウェー・ク ローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	41,700	27.590	1,150,503.000	
	DNB ASA	33,100	137.950	4,566,145.000	
	ORKLA ASA	24,450	89.120	2,178,984.000	
	TELENOR ASA	25,400	147.800	3,754,120.000	
	EQUINOR ASA	33,823	138.750	4,692,941.250	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,710	360.700	2,059,597.000	
	MOWI ASA	14,100	173.800	2,450,580.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	183.400	1,347,990.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	334.600	1,037,260.000	
	ADEVINTA ASA	8,100	150.600	1,219,860.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 24,457,980.250 (291,294,544)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	31,670	54.280	1,719,047.600	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,500	23.230	150,995.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	63,950	8.136	520,297.200	
	COMMERZBANK AG	32,935	5.150	169,615.250	
	VOLKSWAGEN AG	1,010	151.200	152,712.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	5,920	143.000	846,560.000	
	SIEMENS AG-REG	24,550	115.700	2,840,435.000	
	E.ON SE	71,600	9.792	701,107.200	
	UNIPER SE	6,650	25.960	172,634.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,600	61.380	650,628.000	
	GEA GROUP AG	4,500	31.000	139,500.000	
	CONTINENTAL AG	3,590	94.120	337,890.800	
	BASF SE	29,570	52.120	1,541,188.400	

ALLIANZ SE-REG	13,470	178.680	2,406,819.600	
THYSSENKRUPP AG	11,450	6.124	70,119.800	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,800	85.360	495,088.000	
RWE AG	19,000	31.290	594,510.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	9.096	87,776.400	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	37.400	44,132.000	
BRENNTAG AG	5,000	52.720	263,600.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	13,550	38.130	516,661.500	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	39.630	131,571.600	
HOCHTIEF AG	710	73.450	52,149.500	
SAP SE	33,442	132.860	4,443,104.120	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,610	241.300	1,112,393.000	
ZALANDO SE	4,950	71.740	355,113.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	52.760	258,524.000	
KION GROUP AG	2,100	70.380	147,798.000	
COVESTRO AG	5,600	43.300	242,480.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,150	324.400	373,060.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,000	52.280	261,400.000	
DELIVERY HERO SE	4,150	86.960	360,884.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	93.500	116,875.000	
METRO AG	5,000	8.380	41,900.000	
NEMETSCHKE SE	2,000	61.400	122,800.000	
SCOUT24 AG	3,600	75.050	270,180.000	
AROUNDTOWN SA	37,000	4.702	173,974.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,900	36.690	179,781.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	108.660	157,557.000	
TEAMVIEWER AG	4,450	40.560	180,492.000	
BEIERSDORF AG	3,290	96.920	318,866.800	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,950	38.280	74,646.000	
MERCK KGAA	4,250	115.300	490,025.000	
ADIDAS AG	6,170	262.700	1,620,859.000	
PUMA SE	2,710	68.340	185,201.400	
HENKEL AG & CO KGAA	3,400	74.250	252,450.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	107,350	14.975	1,607,566.250	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,920	70.660	488,967.200	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	27,700	43.480	1,204,396.000	

QIAGEN N.V.	7,298	39.540	288,562.920	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	40,500	22.780	922,590.000	
HANNOVER RUECK SE	1,850	140.000	259,000.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	31,500	37.680	1,186,920.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,060	148.700	901,122.000	
LANXESS AG	2,500	49.040	122,600.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,710	158.950	271,804.500	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,000	43.490	478,390.000	
SYMRISE AG	4,220	113.550	479,181.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.291	77,435.800	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,550	47.180	73,129.000	
VONOVIA SE	16,450	57.560	946,862.000	
LEG IMMOBILIEN AG	2,300	119.000	273,700.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	29,410	39.145	1,151,254.450	
NN GROUP NV	9,050	32.750	296,387.500	
ARCELORMITTAL	23,300	10.748	250,428.400	
HEINEKEN NV	8,200	76.760	629,432.000	
AEGON NV	58,244	2.332	135,825.000	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	35,033	24.860	870,920.380	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	81.660	533,893.080	
KONINKLIJKE DSM NV	5,450	132.750	723,487.500	
WOLTERS KLUWER	8,900	68.200	606,980.000	
ING GROEP NV	126,250	6.970	879,962.500	
KONINKLIJKE KPN NV	114,650	2.166	248,331.900	
ASML HOLDING NV	13,720	304.800	4,181,856.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	8.244	107,584.200	
GALAPAGOS NV	1,390	102.450	142,405.500	
ADYEN NV	590	1,311.500	773,785.000	
UNILEVER NV	47,150	48.820	2,301,863.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,000	88.760	355,040.000	
PROSUS NV	15,500	80.200	1,243,100.000	
VOPAK	2,300	46.190	106,237.000	
RANDSTAD NV	3,700	43.980	162,726.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,750	68.750	257,812.500	
ALTICE EUROPE NV	20,500	3.421	70,130.500	
JCDECAUX SA	2,700	16.160	43,632.000	

TOTAL SE	79,650	32.965	2,625,662.250	
MICHELIN (CGDE)	5,450	95.300	519,385.000	
AIR LIQUIDE SA	15,277	138.800	2,120,447.600	
KERING	2,460	555.000	1,365,300.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	17,900	103.100	1,845,490.000	
BOUYGUES SA	7,400	33.620	248,788.000	
BNP PARIBAS	36,450	37.225	1,356,851.250	
PEUGEOT SA	19,150	15.145	290,026.750	
NATIXIS	29,550	2.378	70,269.900	
THALES SA	3,500	65.340	228,690.000	
DANONE	20,000	56.180	1,123,600.000	
CARREFOUR SA	19,800	14.315	283,437.000	
SUEZ	11,225	15.125	169,778.120	
VIVENDI	26,891	23.850	641,350.350	
L'OREAL	8,070	273.900	2,210,373.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	16,850	34.240	576,944.000	
LEGRAND SA	8,517	69.320	590,398.440	
PERNOD RICARD SA	6,937	141.300	980,198.100	
EURAZEO SE	1,254	46.120	57,834.480	
SOCIETE GENERALE SA	25,750	13.674	352,105.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	8,900	402.850	3,585,365.000	
ACCOR SA	6,150	27.110	166,726.500	
CAPGEMINI SE	5,120	117.000	599,040.000	
VALEO SA	7,150	28.310	202,416.500	
PUBLICIS GROUPE	7,050	30.120	212,346.000	
BUREAU VERITAS SA	9,700	18.595	180,371.500	
EIFFAGE	2,740	78.300	214,542.000	
SODEXO SA	2,700	63.840	172,368.000	
IPSEN	1,150	85.950	98,842.500	
INGENICO GROUP	1,970	137.000	269,890.000	
ORPEA	1,800	97.860	176,148.000	
AMUNDI SA	1,950	63.600	124,020.000	
TELEPERFORMANCE	1,920	249.900	479,808.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,750	65.660	180,565.000	
FAURECIA	2,250	40.880	91,980.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	420	647.600	271,992.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	900	277.000	249,300.000	
SEB SA	650	144.000	93,600.000	

ESSILORLUXOTTICA	9,250	111.100	1,027,675.000	
DASSAULT AVIATION SA	100	785.500	78,550.000	
WORLDLINE SA	4,514	73.800	333,133.200	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,000	30.280	90,840.000	
AXA SA	62,550	17.180	1,074,609.000	
EDENRED	7,950	42.290	336,205.500	
RENAULT SA	5,800	24.450	141,810.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,020	738.200	752,964.000	
STMICROELECTRONICS NV	20,150	23.640	476,346.000	
REMY COINTREAU	630	142.400	89,712.000	
ATOS SE	3,200	71.080	227,456.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,180	152.100	635,778.000	
WENDEL	780	84.250	65,715.000	
ORANGE	63,300	9.218	583,499.400	
ALSTOM	6,300	47.090	296,667.000	
CNP ASSURANCES	4,850	11.030	53,495.500	
SANOFI	36,175	83.570	3,023,144.750	
VINCI SA	16,650	79.620	1,325,673.000	
AIRBUS SE	18,950	69.780	1,322,331.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,500	19.545	342,037.500	
CREDIT AGRICOLE SA	37,600	8.670	325,992.000	
BIOMERIEUX	1,340	113.200	151,688.000	
ENGIE	58,023	11.640	675,387.720	
EDF	20,250	8.644	175,041.000	
SES	11,000	6.188	68,068.000	
SAFRAN SA	10,420	97.240	1,013,240.800	
ILIAD SA	490	169.350	82,981.500	
ARKEMA	2,220	93.620	207,836.400	
ADP	910	88.550	80,580.500	
SCOR SE	4,950	22.240	110,088.000	
GETLINK SE	14,200	12.590	178,778.000	
BOLLORE	28,600	3.184	91,062.400	
UCB SA	4,130	96.160	397,140.800	
KBC GROUP NV	7,700	47.710	367,367.000	
COLRUYT SA	1,600	53.000	84,800.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,600	78.040	280,944.000	
SOLVAY SA	2,200	76.380	168,036.000	
UMICORE	6,350	38.930	247,205.500	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	24,400	49.210	1,200,724.000	

AGEAS	5,790	35.800	207,282.000	
PROXIMUS	4,950	16.445	81,402.750	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	31.520	45,704.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	84.300	88,515.000	
SOFINA	550	234.000	128,700.000	
ARGENX SE	1,450	183.200	265,640.000	
PRYSMIAN SPA	7,850	23.490	184,396.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	35,743	12.820	458,225.260	
MEDIOBANCA SPA	18,865	7.168	135,224.320	
TENARIS SA	13,300	4.827	64,199.100	
UNICREDIT SPA	69,656	8.122	565,746.030	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.393	103,509.710	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.390	67,094.890	
INTESA SANPAOLO	534,737	1.778	951,083.220	
ATLANTIA SPA	15,457	14.210	219,643.970	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	7.692	123,072.000	
MONCLER SPA	6,300	33.770	212,751.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,050	44.380	135,359.000	
ENI SPA	81,300	7.645	621,538.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	8.780	171,210.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	3.698	40,678.000	
DIASORIN SPA	850	141.800	120,530.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	8,300	8.200	68,060.000	
NEXI SPA	12,050	14.205	171,170.250	
LEONARDO SPA	13,175	5.660	74,570.500	
ENEL SPA	262,134	7.412	1,942,937.200	
SNAM SPA	66,600	4.309	286,979.400	
TERNA SPA	46,300	5.964	276,133.200	
EXOR NV	3,530	49.200	173,676.000	
CNH INDUSTRIAL NV	32,800	6.868	225,270.400	
FINECOBANK SPA	19,700	12.145	239,256.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	34,100	9.431	321,597.100	
FERRARI NV	4,145	160.700	666,101.500	
TELEFONICA SA	157,227	3.296	518,220.190	
ENDESA SA	10,350	22.910	237,118.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	213,012	2.557	544,671.680	

IBERDROLA SA	191,234	10.465	2,001,263.810	
BANKINTER SA	21,500	4.515	97,072.500	
REPSOL SA	49,400	6.448	318,531.200	
GRIFOLS SA	9,200	21.680	199,456.000	
BANCO SANTANDER SA	527,750	1.905	1,005,680.400	
AMADEUS IT GROUP SA	14,600	50.300	734,380.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	16.445	154,583.000	
MAPFRE SA	30,650	1.561	47,844.650	
CAIXABANK SA	109,300	2.040	222,972.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	20.680	183,555.680	
AENA SME SA	2,250	126.100	283,725.000	
CELLNEX TELECOM SA	10,105	51.240	517,780.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	34,700	23.040	799,488.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	7,700	20.830	160,391.000	
ENAGAS SA	7,950	20.010	159,079.500	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	15.965	221,913.500	
FERROVIAL SA	16,270	22.750	370,142.500	
UPM-KYMMENE OYJ	16,900	26.300	444,470.000	
NOKIA OYJ	181,400	3.764	682,880.300	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	6.960	83,520.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	18,850	13.200	248,820.000	
ELISA OYJ	4,600	48.550	223,330.000	
SAMPO OYJ-A SHS	15,300	33.610	514,233.000	
FORTUM OYJ	13,850	16.935	234,549.750	
KONE OYJ-B	10,950	70.300	769,785.000	
NESTE OYJ	13,900	44.960	624,944.000	
ORION OYJ-CLASS B	3,200	37.820	121,024.000	
VERBUND AG	2,000	44.540	89,080.000	
OMV AG	4,450	27.020	120,239.000	
ERSTE GROUP BANK AG	9,450	20.280	191,646.000	
VOESTALPINE AG	4,250	21.630	91,927.500	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	15.050	66,220.000	
ANDRITZ AG	2,100	27.800	58,380.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,800	30.460	207,128.000	
KINGSPAN GROUP PLC	5,000	67.350	336,750.000	
JERONIMO MARTINS	7,700	13.755	105,913.500	

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	88,300	4.136	365,208.800	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,050	8.886	133,734.300	
	KERRY GROUP PLC-A	5,150	112.800	580,920.000	
	CRH PLC	25,350	30.540	774,189.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,960	125.000	620,000.000	
ユーロ 小計				ユーロ 121,115,576.220 (15,244,817,578)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	47,500	42.650	2,025,875.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	73,000	59.800	4,365,400.000	
	MTR CORP	52,500	40.050	2,102,625.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,500	99.500	4,427,750.000	
	SINO LAND CO	104,000	9.050	941,200.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	91,669	50.000	4,583,450.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	41.600	644,800.000	
	CLP HOLDINGS LTD	56,000	75.300	4,216,800.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,507	29.300	1,421,255.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	362,358	11.100	4,022,173.800	
	HANG SENG BANK LTD	26,100	119.100	3,108,510.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	52,500	39.400	2,068,500.000	
	WH GROUP LTD	321,000	6.620	2,125,020.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	40,500	380.600	15,414,300.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	66,000	20.950	1,382,700.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,800	82.300	888,840.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	20.250	455,625.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	17.180	777,223.200	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	26,000	37.200	967,200.000	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	10.540	611,320.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	20.250	773,550.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	41.100	3,747,045.900	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	39.300	786,000.000	
	PCCW LTD	147,000	4.520	664,440.000	
	AIA GROUP LTD	406,600	78.000	31,714,800.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	57,000	32.100	1,829,700.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,900	25.300	1,363,670.000	

PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVE	15,876	1.790	28,418.040	
SANDS CHINA LTD	82,400	33.500	2,760,400.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	47,000	95.600	4,493,200.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	125,500	21.700	2,723,350.000	
WYNN MACAU LTD	54,000	14.460	780,840.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 108,215,981.040 (1,484,723,260)	
合計			140,999,174,005 [140,999,174,005]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,587	743,552.700	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	9,687	680,414.880	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,600	403,926.000	
		VORNADO REALTY TRUST	5,397	198,501.660	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,650	1,096,058.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	11,850	688,603.500	
		EQUINIX INC	2,868	2,157,252.240	
		AMERICAN TOWER CORP	14,250	3,562,215.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	22,243	265,581.420	
		INVITATION HOMES INC	17,700	507,459.000	
		VICI PROPERTIES INC	15,400	352,352.000	
		VENTAS INC	12,200	543,632.000	
		WEYERHAEUSER CO	24,114	700,270.560	
		AGNC INVESTMENT CORP	18,100	250,504.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	13,350	2,143,876.500	
		IRON MOUNTAIN INC	8,910	268,725.600	
		VEREIT INC	33,500	232,825.000	
		SUN COMMUNITIES INC	3,250	473,492.500	
		PROLOGIS INC	23,702	2,388,213.520	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,120	685,691.600	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,200	298,208.000	
		DUKE REALTY CORP	12,150	463,765.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,170	486,644.200	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,360	193,661.600	

	WELLTOWER INC	13,350	815,952.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17,650	500,377.500	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,750	443,812.500	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,400	354,348.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45,100	330,132.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5,350	200,357.500	
	REALTY INCOME CORP	11,200	720,944.000	
	PUBLIC STORAGE	5,090	1,079,792.600	
	REGENCY CENTERS CORP	5,300	220,109.000	
	UDR INC	9,750	344,272.500	
	WP CAREY INC	5,400	378,270.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7,600	241,680.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,700	1,263,066.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,250	460,487.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,250	317,400.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 27,456,428.580 (2,920,265,744)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	117,862.940	
	SEGRO PLC	38,450	352,817.200	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	90,140.400	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 560,820.540 (79,036,439)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	21,500	262,515.000	
	TRANSURBAN GROUP	86,300	1,220,282.000	
	SYDNEY AIRPORT	42,500	249,475.000	
	APA GROUP	38,100	399,288.000	
	SCENTRE GROUP	159,922	348,629.960	
	DEXUS	33,150	300,007.500	
	GPT GROUP	63,160	238,744.800	
	MIRVAC GROUP	126,100	266,071.000	
	STOCKLAND	72,000	264,240.000	
	GOODMAN GROUP	52,900	960,135.000	
	VICINITY CENTRES	123,273	170,733.100	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル	

			4,680,121.360 (362,709,406)
カナダ・ドル	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,800	カナダ・ドル 65,616.000
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	44,016.000
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	105,240.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	70,218.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 285,090.000 (23,186,370)
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	95,600	シンガポール・ドル 157,740.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,000	331,280.000
	CAPITALAND MALL TRUST	89,200	172,156.000
	SUNTEC REIT	63,000	88,830.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91,800	188,190.000
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	129,690.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,067,886.000 (83,209,678)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	ユーロ 162,414.000
	ICADE	950	49,970.000
	GECINA SA	1,400	155,540.000
	KLEPIERRE	6,250	86,343.750
	COVIVIO	1,500	90,975.000
ユーロ 小計			ユーロ 545,242.750 (68,629,705)
香港・ドル	LINK REIT	70,500	香港・ドル 4,441,500.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	729,560.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122,000	1,300,520.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 6,471,580.000 (88,790,078)
投資証券 合計			3,625,827,420 [3,625,827,420]
合計			3,625,827,420 [3,625,827,420]

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 591銘柄 投資証券 39銘柄	97.2%	2.8%	72.2%
イギリス・ポンド	株式 83銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	4.4%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄 投資証券 11銘柄	88.5%	11.5%	2.2%
カナダ・ドル	株式 81銘柄 投資証券 4銘柄	99.5%	0.5%	3.4%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 6銘柄	84.1%	15.9%	0.4%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100%	-%	3.4%
スウェーデン・クローナ	株式 36銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 239銘柄 投資証券 5銘柄	99.6%	0.4%	10.6%
香港・ドル	株式 32銘柄 投資証券 3銘柄	94.4%	5.6%	1.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	60,092,275	92,213,639
金銭信託	3,297,002	32,279,180
コール・ローン	66,890,215	188,729,807
株式	7,236,096,701	9,155,472,087
投資証券	207,899,214	375,678,602
派生商品評価勘定	3,709,707	359,289
未収入金	27,360	365,610
未収配当金	14,572,223	18,693,171
差入委託証拠金	19,426,434	61,686,016
流動資産合計	7,612,011,131	9,925,477,401
資産合計	7,612,011,131	9,925,477,401
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25	3,893,840
未払金	43,813,817	51,805
未払解約金	420,000	2,431,968
その他未払費用	43,154	144,685
流動負債合計	44,276,996	6,522,298
負債合計	44,276,996	6,522,298
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,076,199,923	7,158,803,351
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,491,534,212	2,760,151,752
元本等合計	7,567,734,135	9,918,955,103
純資産合計	7,567,734,135	9,918,955,103
負債純資産合計	7,612,011,131	9,925,477,401

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7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	受取配当金

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	3,687,560,092円	5,076,199,923円
期中追加設定元本額	1,684,523,074円	2,509,494,287円
期中一部解約元本額	295,883,243円	426,890,859円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	10,054,295円	21,826,760円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	233,719,694円	274,516,559円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	231,269,037円	308,729,983円
D - I ' s 新興国株式インデックス	109,213,035円	125,778,044円
i F r e e 新興国株式インデックス	1,780,582,027円	2,590,686,978円
i F r e e 8 資産バランス	1,317,325,324円	1,979,363,769円

新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド (為替ヘッジなし/適格機関投資家専用)	- 円	288,114,239円
DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	945,942,382円	1,082,447,903円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	380,133,311円	395,548,435円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	67,960,818円	91,790,681円
計	5,076,199,923円	7,158,803,351円
2. 期末日における受益権の総数	5,076,199,923口	7,158,803,351口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7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	267,979,995	35,338,865
投資証券	3,754,859	5,006,821
合計	264,225,136	30,332,044

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年7月6日から2019年9月9日まで、及び2020年7月7日から2020年9月7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

	2019年9月9日 現在	2020年9月7日 現在

種 類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	104,192,829	-	107,901,856	3,709,027	382,635,418	-	378,888,887	3,746,531
合計	104,192,829	-	107,901,856	3,709,027	382,635,418	-	378,888,887	3,746,531

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	237,459	-	236,779	680	-	-	-	-
タイ・パーツ	237,459	-	236,779	680	-	-	-	-
買 建	237,459	-	237,434	25	209,247,420	-	209,459,400	211,980
アメリカ・ドル	237,459	-	237,434	25	209,247,420	-	209,459,400	211,980
合計	474,918	-	474,213	655	209,247,420	-	209,459,400	211,980

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4908円 (14,908円)	1.3856円 (13,856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	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	33,700	4.800	161,760.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	7,800	281.390	2,194,842.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	5,300	122.870	651,211.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,100	16.980	171,498.000	
	CANADIAN SOLAR INC	3,600	30.300	109,080.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,000	33.270	99,810.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	19,950	8.950	178,552.500	
	JD.COM INC-ADR	9,900	80.000	792,000.000	
	NETEASE INC-ADR	500	485.250	242,625.000	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	7,000	30.660	214,620.000		

	VTB BANK JSC -GDR-REG S	211,098	0.881	185,977.330	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	6,760	21.480	145,204.800	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	6,550	42.340	277,327.000	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	42,400	4.590	194,616.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,310	26.330	297,792.300	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	24,970	14.450	360,816.500	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	83,995	0.913	76,687.430	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	93,900	11.625	1,091,587.500	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,420	149.200	211,864.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	19,030	64.100	1,219,823.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	63,800	4.872	310,833.600	
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	395,390	4.685	1,852,402.150	
	SEVERSTAL - GDR REG S	14,270	12.190	173,951.300	
	TATNEFT PJSC - PREF	12,010	6.997	84,036.340	
	SISTEMA PJSFC	426,500	0.276	117,976.720	
	ROSSETI PJSC	3,728,000	0.019	71,849.740	
	INTER RAO UES PJSC	1,268,000	0.071	90,738.080	
	ALROSA PJSC	133,260	0.906	120,839.100	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	45,529	1.803	82,108.680	
	AEROFLOT PJSC	54,450	1.092	59,464.950	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 11,841,895.020 (1,259,503,954)	
インド・ルピー	株		インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	22,340	421.300	9,411,842.000	
	AXIS BANK LTD	29,890	455.200	13,605,928.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,650	7,190.100	11,863,665.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	4,230	2,124.650	8,987,269.500	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	52,840	197.100	10,414,764.000	
	STATE BANK OF INDIA	70,070	206.600	14,476,462.000	
	NTPC LTD	105,100	94.700	9,952,970.000	
	POWER FINANCE CORPORATION	35,940	92.500	3,324,450.000	
	JSW STEEL LTD	39,320	282.350	11,102,002.000	
	INDIAN OIL CORP LTD	115,870	83.900	9,721,493.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50,705	403.350	20,451,861.750	
	VODAFONE IDEA LTD	1,421,490	12.050	17,128,954.500	

JINDAL STEEL & POWER LTD	34,990	210.650	7,370,643.500	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,050	687.450	2,096,722.500	
TECH MAHINDRA LTD	5,820	748.200	4,354,524.000	
YES BANK LTD	17,640	14.250	251,370.000	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	61,120	56.100	3,428,832.000	
REC LTD	53,060	109.950	5,833,947.000	
COAL INDIA LTD	93,510	132.450	12,385,399.500	
BHARTI INFRATEL LTD	28,880	214.850	6,204,868.000	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	29,840	192.750	5,751,660.000	
GAIL INDIA LTD	37,866	98.050	3,712,761.300	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	60,000	188.300	11,298,000.000	
GRASIM INDUSTRIES LTD	12,880	706.500	9,099,720.000	
WIPRO LTD	26,423	276.000	7,292,748.000	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,116	2,288.800	23,153,500.800	
INFOSYS LTD	56,940	919.150	52,336,401.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	6,972	942.500	6,571,110.000	
TATA MOTORS LTD	120,180	147.800	17,762,604.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	17,790	1,769.700	31,482,963.000	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	48,340	2,077.250	100,414,265.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	156,725	77.900	12,208,877.500	
ITC LTD	49,290	186.700	9,202,443.000	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	19,150	632.000	12,102,800.000	
HERO MOTOCORP LTD	3,110	2,915.200	9,066,272.000	
BHARTI AIRTEL LTD	26,342	523.150	13,780,817.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,340	512.450	9,398,333.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	17,540	700.800	12,292,032.000	
VEDANTA LTD	159,260	125.950	20,058,797.000	
インド・ルピー 小計			インド・ルピー 549,354,073.150 (802,056,947)	
インドネシア・ ルピア		株	インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	317,100		5,050.000	1,601,355,000.000
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,109,200		2,860.000	3,172,312,000.000
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	221,400		5,225.000	1,156,815,000.000
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	69,100		31,900.000	2,204,290,000.000
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	434,200		5,925.000	2,572,635,000.000

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	937,700	3,550.000	3,328,835,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 14,036,242,000.000 (101,060,942)	
オフショア・人 民元		株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	81,500	16.120	1,313,780.000	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION- A	86,807	8.750	759,561.250	
	PING AN INSURANCE GROUP CO- A	16,700	74.820	1,249,494.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	294,000	4.900	1,440,600.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	22.230	122,265.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-A	6,000	42.500	255,000.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	8,400	15.890	133,476.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	1,770.000	1,062,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	7,100	59.450	422,095.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK- A	124,400	10.070	1,252,708.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	40,400	3.890	157,156.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	14,600	31.040	453,184.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	44,000	36.800	1,619,200.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	45,500	14.960	680,680.000	
	GF SECURITIES CO LTD-A	9,800	16.300	159,740.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	268,200	5.050	1,354,410.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	43,700	19.260	841,662.000	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	23,800	3.440	81,872.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO- A	29,100	6.060	176,346.000	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN- A	84,500	2.790	235,755.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD- A	62,100	3.060	190,026.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	9,600	15.450	148,320.000	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	4,900	9.190	45,031.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,300	6.110	185,133.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA- A	615,800	3.160	1,945,928.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	332,100	3.200	1,062,720.000	

	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	197,600	3.980	786,448.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	227,300	4.650	1,056,945.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	33,200	16.170	536,844.000	
	CHINA VANKE CO LTD -A	24,800	28.070	696,136.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	12,200	30.180	368,196.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	41,200	5.150	212,180.000	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	199,100	5.520	1,099,032.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	182,900	3.770	689,533.000	
	CRRC CORP LTD-A	55,200	5.700	314,640.000	
	CHINA UNITED NETWORK-A	120,000	5.090	610,800.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	9,000	21.270	191,430.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	12,300	14.670	180,441.000	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	26,800	7.810	209,308.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	111,800	5.010	560,118.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,500	58.100	203,350.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	84,000	6.230	523,320.000	
	AIR CHINA LTD-A	14,800	7.420	109,816.000	
	BYD CO LTD -A	1,800	90.000	162,000.000	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	4,400	10.120	44,528.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	9,800	15.000	147,000.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	25,900	7.000	181,300.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	38,600	5.540	213,844.000	
	オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 26,445,351.250 (411,489,665)	
サウジアラビア・リアル		株	サウジアラビア・リアル	サウジアラビア・リアル	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	25,923	88.100	2,283,816.300	
	SAUDI TELECOM CO	9,042	97.500	881,595.000	
	AL RAJHI BANK	20,809	66.000	1,373,394.000	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	14,808	27.350	404,998.800	
	RIYAD BANK	20,666	18.600	384,387.600	
	ETIHAD ETISALAT CO	14,210	27.100	385,091.000	
	SAVOLA	8,373	48.300	404,415.900	

	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,707	55.200	425,426.400	
	ALINMA BANK	22,704	15.540	352,820.160	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	14,683	36.950	542,536.850	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	11,639	35.850	417,258.150	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	40,017	9.300	372,158.100	
サウジアラビア・リアル 小計				サウジアラビア・リアル 8,227,898.260 (233,672,310)	
シンガポール・ ドル	株 YANGZIJIANG SHIPBUILDING	121,700	シンガポール・ドル 0.930	シンガポール・ドル 113,181.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 113,181.000 (8,819,063)	
タイ・パーツ	株 BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,600	タイ・パーツ 105.500	タイ・パーツ 2,911,800.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	37,500	369.000	13,837,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	28,100	82.500	2,318,250.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	11,600	82.250	954,100.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	131,300	71.000	9,322,300.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	37,200	31.750	1,181,100.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	68,500	23.300	1,596,050.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	24,900	183.500	4,569,150.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	347,000	9.550	3,313,850.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	445,500	5.750	2,561,625.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	43,700	88.000	3,845,600.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,166,100	2.260	2,635,386.000	
	PTT PCL-NVDR	717,300	36.000	25,822,800.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	82,200	39.250	3,226,350.000	
	CP ALL PCL-NVDR	87,800	63.750	5,597,250.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	146,000	31.750	4,635,500.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	147,900	45.250	6,692,475.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 95,021,086.000 (321,171,271)	
チリ・ペソ	株		チリ・ペソ	チリ・ペソ	

	ENEL CHILE SA	987,867	57.900	57,197,499.300	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,479,580	30.620	75,924,739.600	
	ENEL AMERICAS SA	1,107,863	112.790	124,955,867.770	
	FALABELLA SA	26,600	2,520.000	67,032,000.000	
	BANCO DE CHILE	1,637,092	66.000	108,048,072.000	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 433,158,178.670 (59,602,565)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	119,720	6.800	814,096.000	
	AKBANK T.A.S.	181,672	4.920	893,826.240	
	TURKIYE IS BANKASI-C	160,500	5.000	802,500.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	87,760	14.800	1,298,848.000	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	10,390	80.150	832,758.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	99,181	8.780	870,809.180	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	93,990	7.810	734,061.900	
	TURKIYE HALK BANKASI	129,130	5.080	655,980.400	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T- D	134,820	4.110	554,110.200	
	KOC HOLDING AS	50,915	14.770	752,014.550	
	TURK HAVA YOLLARI AO	66,080	10.540	696,483.200	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,840	67.750	802,160.000		
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 9,707,648.170 (138,916,446)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	600	62.450	37,470.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	14,600	6.950	101,470.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,600	79.500	286,200.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	30,500	22.380	682,590.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	7,800	63.270	493,506.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	154,800	22.920	3,548,016.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	167,126	21.970	3,671,758.220	
ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	221,436	24.960	5,527,042.560		

CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	33,100	14.970	495,507.000	
VALE SA	124,090	60.490	7,506,204.100	
GERDAU SA-PREF	41,800	19.920	832,656.000	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	103,700	23.330	2,419,321.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER- PRF	50,804	10.790	548,175.160	
BRASKEM SA-PREF A	12,500	21.880	273,500.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,200	37.140	304,548.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	56,500	33.950	1,918,175.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	14,700	36.450	535,815.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI- PFB	3,300	63.960	211,068.000	
EMBRAER SA	37,700	7.410	279,357.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	86,400	9.070	783,648.000	
CCR SA	34,400	14.400	495,360.000	
BRF SA	25,800	19.980	515,484.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,200	49.160	452,272.000	
TIM PARTICIPACOES SA	19,426	14.740	286,339.240	
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	19,600	48.800	956,480.000	
LOJAS RENNER S.A.	7,205	46.300	333,591.500	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,584	30.840	264,730.560	
JBS SA	52,000	21.870	1,137,240.000	
SUZANO SA	11,345	47.540	539,341.300	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	26,700	16.720	446,424.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	17,600	58.330	1,026,608.000	
CIELO SA	99,728	4.680	466,727.040	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	12,600	23.780	299,628.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	3,331	11.110	37,007.410	
BANCO SANTANDER BRASIL- UNIT	17,500	30.410	532,175.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	1,000	48.980	48,980.000	
KLABIN SA - UNIT	19,100	24.950	476,545.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	68,400	21.490	1,469,916.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	24,100	23.760	572,616.000	
LOJAS AMERICANAS SA	2,293	26.350	60,420.550	
COGNA EDUCACAO	47,500	6.010	285,475.000	
BANCO BRADESCO S.A.	53,941	20.320	1,096,081.120	

	AMBEV SA	106,100	12.600	1,336,860.000	
ブラジル・リアル 小計				ブラジル・リアル 43,592,328.760 (874,462,115)	
マレーシア・リンギット		株	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	MISC BHD	54,900	7.620	418,338.000	
	MALAYAN BANKING BHD	76,500	7.210	551,565.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	44,900	16.000	718,400.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	69,100	3.260	225,266.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	41,700	11.160	465,372.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 2,378,941.000 (60,996,047)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	13,400	88.510	1,186,034.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	938,100	13.160	12,345,396.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	89,500	28.800	2,577,600.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,212,219	6.870	8,327,944.530	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	51,800	122.290	6,334,622.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	29,623	35.700	1,057,541.100	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	79,400	59.480	4,722,712.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	113,900	51.850	5,905,715.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	78,700	74.720	5,880,464.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 48,338,028.630 (238,789,860)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	159,000	5.780	919,020.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	346,000	3.800	1,314,800.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	8.760	350,400.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	94,000	16.340	1,535,960.000	
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	145,000	4.560	661,200.000	

JIANGXI COPPER CO LTD-H	88,000	9.210	810,480.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	140,000	3.030	424,200.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	27,000	22.100	596,700.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL- H	2,107,800	3.430	7,229,754.000	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15,500	24.750	383,625.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	138,000	5.360	739,680.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI- H	132,000	5.080	670,560.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	13,500	35.250	475,875.000	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	105,500	8.550	902,025.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	21,900	518.000	11,344,200.000	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	832,000	2.520	2,096,640.000	
AIR CHINA LTD-H	86,000	5.480	471,280.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	402,000	5.290	2,126,580.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	57,000	34.950	1,992,150.000	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	172,000	4.800	825,600.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	70,000	8.880	621,600.000	
PETROCHINA CO LTD-H	1,518,000	2.570	3,901,260.000	
CNOOC LTD	715,000	8.360	5,977,400.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	114,000	6.510	742,140.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	422,000	3.150	1,329,300.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	58.200	1,280,400.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP- H	149,000	4.900	730,100.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,608,000	5.440	25,067,520.000	
CHINA MOBILE LTD	259,000	53.150	13,765,850.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	74,000	12.200	902,800.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	667,000	3.190	2,127,730.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	43,800	9.610	420,918.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	40,400	13.340	538,936.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	16,000	61.100	977,600.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI- H	334,000	3.540	1,182,360.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO- H	70,000	4.310	301,700.000	

HUADIAN POWER INTL CORP-H	142,000	2.110	299,620.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	203,000	13.360	2,712,080.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	31,200	16.120	502,944.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	57,600	18.060	1,040,256.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	84,000	36.900	3,099,600.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	31,000	27.200	843,200.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	128,000	5.900	755,200.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	82,500	9.090	749,925.000	
BYD CO LTD-H	12,000	81.950	983,400.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA- H	1,747,000	2.510	4,384,970.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C- H	25,900	30.200	782,180.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU- H	277,000	2.480	686,960.000	
CITIC LTD	104,000	6.830	710,320.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,710,000	4.260	15,804,600.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	664,000	1.480	982,720.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	109,800	24.500	2,690,100.000	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	12,800	261.800	3,351,040.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	12.100	677,600.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN- H	215,000	1.370	294,550.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	149,000	21.550	3,210,950.000	
CRRC CORP LTD - H	171,000	3.210	548,910.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONST- H	386,000	4.120	1,590,320.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO- H	109,500	80.500	8,814,750.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	33,000	32.150	1,060,950.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR- H	454,580	4.640	2,109,251.200	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	269,000	9.680	2,603,920.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	9,000	76.550	688,950.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	45,900	24.350	1,117,665.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM- H	194,000	1.560	302,640.000	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	6.640	371,840.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,800	126.000	856,800.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	250,000	5.900	1,475,000.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	125,500	8.990	1,128,245.000	
WEICHAO POWER CO LTD-H	51,000	16.000	816,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	350,000	1.900	665,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	80,800	21.200	1,712,960.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	46,900	13.740	644,406.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	149,000	18.400	2,741,600.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	90.550	1,086,600.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	82,000	9.240	757,680.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	162,000	5.270	853,740.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	93,600	10.040	939,744.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	146,000	5.750	839,500.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	278,000	11.140	3,096,920.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	531,100	3.940	2,092,534.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	98,000	16.940	1,660,120.000	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	68,000	10.420	708,560.000	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,226,000	0.270	331,020.000	
CHINA MERCHANTS BANK-H	109,500	37.250	4,078,875.000	
BANK OF CHINA LTD-H	4,056,000	2.490	10,099,440.000	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	33,500	18.500	619,750.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	217,000	2.710	588,070.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	83,600	6.940	580,184.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	38,000	42.850	1,628,300.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 199,510,802.200 (2,737,288,206)	
台湾・ドル				
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	株 24,000	台湾・ドル 144.500	台湾・ドル 3,468,000.000	
TAIWAN CEMENT	161,145	42.200	6,800,319.000	
ASIA CEMENT CORP	73,000	41.700	3,044,100.000	

ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	114,000	59.500	6,783,000.000	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	52,000	41.500	2,158,000.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	100,112	63.600	6,367,123.200	
FORMOSA PLASTICS CORP	64,600	78.500	5,071,100.000	
NAN YA PLASTICS CORP	52,140	60.500	3,154,470.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	51,390	67.700	3,479,103.000	
CHINA STEEL CORP	97,686	20.000	1,953,720.000	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	605.000	3,025,000.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	72,616	45.950	3,336,705.200	
DELTA ELECTRONICS INC	57,000	186.000	10,602,000.000	
YAGEO CORPORATION	8,000	340.000	2,720,000.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	30,000	52.500	1,575,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	103,000	76.800	7,910,400.000	
AU OPTRONICS CORP	898,000	12.400	11,135,200.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	104,400	108.500	11,327,400.000	
MEDIATEK INC	33,003	603.000	19,900,809.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	27,000	194.500	5,251,500.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	152,411	42.450	6,469,846.950	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	192,838	39.450	7,607,459.100	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	300,000	8.580	2,574,000.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	173,505	26.650	4,623,908.250	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	182,381	18.200	3,319,334.200	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	195,993	28.650	5,615,199.450	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	131,747	13.000	1,712,711.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	511,334	8.380	4,284,978.920	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	227,000	10.800	2,451,600.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	337,028	18.800	6,336,126.400	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	155,747	20.700	3,223,962.900	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,655.000	3,655,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	14,000	243.000	3,402,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	35,000	101.000	3,535,000.000	
WISTRON CORP	144,110	31.750	4,575,492.500	
INNOLUX CORP	1,165,000	10.450	12,174,250.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	60.800	2,553,600.000	

	PEGATRON CORP	84,000	63.600	5,342,400.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	19,000	128.000	2,432,000.000	
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	25,471	129.000	3,285,759.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	19,400	86.600	1,680,040.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	39,000	81.000	3,159,000.000	
	COMPAL ELECTRONICS	107,000	19.200	2,054,400.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	321,000	429.000	137,709,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	444,902	76.900	34,212,963.800	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	263.000	2,630,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	16,760	248.500	4,164,860.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	69,000	26.900	1,856,100.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	552,000	21.450	11,840,400.000	
台湾・ドル	小計			台湾・ドル 407,544,341.870 (1,475,310,518)	
南アフリカ・ランド		株	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	GOLD FIELDS LTD	18,720	201.150	3,765,528.000	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	7,500	74.800	561,000.000	
	MULTICHOICE GROUP LTD	15,130	94.490	1,429,633.700	
	OLD MUTUAL LTD	190,440	10.800	2,056,752.000	
	VODACOM GROUP LTD	19,320	124.520	2,405,726.400	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	28,320	116.460	3,298,147.200	
	NEDBANK GROUP LTD	14,100	90.800	1,280,280.000	
	BIDVEST GROUP LTD	10,770	133.830	1,441,349.100	
	BID CORP LTD	8,310	268.610	2,232,149.100	
	NETCARE LTD	56,690	12.880	730,167.200	
	STANDARD BANK GROUP LTD	43,220	100.780	4,355,711.600	
	SASOL LTD	28,540	143.000	4,081,220.000	
	REMGRO LTD	16,410	85.000	1,394,850.000	
	DISCOVERY LTD	11,940	121.230	1,447,486.200	
	EXXARO RESOURCES LTD	10,630	131.360	1,396,356.800	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	21,020	31.950	671,589.000	
	SANLAM LTD	53,120	52.000	2,762,240.000	
	TIGER BRANDS LTD	8,780	169.260	1,486,102.800	
	FIRSTRAND LTD	107,230	36.140	3,875,292.200	

WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	47,860	30.600	1,464,516.000	
THE FOSCHINI GROUP LTD	12,640	74.610	943,070.400	
ABSA GROUP LTD	32,960	80.400	2,649,984.000	
NASPERS LTD-N SHS	2,129	2,933.420	6,245,251.180	
MTN GROUP LTD	48,590	57.800	2,808,502.000	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,730	159.290	1,390,601.700	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	15,180	133.940	2,033,209.200	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	6,050	463.040	2,801,392.000	
SAPPI LIMITED	56,180	21.750	1,221,915.000	
TELKOM SA SOC LTD	47,800	22.800	1,089,840.000	
SPAR GROUP LIMITED/THE	9,970	162.540	1,620,523.800	
MR PRICE GROUP LTD	5,900	117.290	692,011.000	
SIBANYE STILLWATER LTD	34,100	53.200	1,814,120.000	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 67,446,517.580 (432,332,178)	
合計			9,155,472,087 [9,155,472,087]	

## (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	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	186,000	アメリカ・ドル 3,398,220.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 3,398,220.000 (361,434,679)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	100,400	メキシコ・ペソ 1,651,580.000	
	メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 1,651,580.000 (8,158,806)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	76,930	南アフリカ・ランド 949,316.200	
	南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 949,316.200 (6,085,117)	
投資証券 合計			375,678,602 [375,678,602]		

合計		375,678,602	
		[375,678,602]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 30銘柄 投資証券 1銘柄	77.7%	22.3%	17.0%
インド・ルピー	株式 39銘柄	100%	-%	8.4%
インドネシア・ルピア	株式 6銘柄	100%	-%	1.1%
オフショア・人民元	株式 48銘柄	100%	-%	4.3%
サウジアラビア・リアル	株式 12銘柄	100%	-%	2.5%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 17銘柄	100%	-%	3.4%
チリ・ペソ	株式 5銘柄	100%	-%	0.6%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	100%	-%	1.5%
ブラジル・レアル	株式 43銘柄	100%	-%	9.2%
マレーシア・リングgit	株式 5銘柄	100%	-%	0.6%
メキシコ・ペソ	株式 9銘柄 投資証券 1銘柄	96.7%	3.3%	2.6%
香港・ドル	株式 90銘柄	100%	-%	28.6%
台湾・ドル	株式 49銘柄	100%	-%	15.5%
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄 投資証券 1銘柄	98.6%	1.4%	4.6%

## 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。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,831,732	24,200,578
コール・ローン	98,027,094	141,495,862
国債証券	15,914,984,650	19,490,511,720
地方債証券	1,142,973,100	1,559,737,800
特殊債券	837,702,600	833,384,100
社債券	942,445,100	728,591,200
未収利息	51,637,826	55,401,337
前払費用	1,477,533	2,984,725
流動資産合計	18,994,079,635	22,836,307,322
資産合計	18,994,079,635	22,836,307,322
負債の部		
流動負債		
未払金	-	76,184,100
未払解約金	23,664,512	11,318
その他未払費用	-	120
流動負債合計	23,664,512	76,195,538
負債合計	23,664,512	76,195,538
純資産の部		
元本等		
元本	1 14,329,790,025	17,672,155,283
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,640,625,098	5,087,956,501
元本等合計	18,970,415,123	22,760,111,784
純資産合計	18,970,415,123	22,760,111,784
負債純資産合計	18,994,079,635	22,836,307,322

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
-----	-----------------------------

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	13,184,411,625円	14,329,790,025円
期中追加設定元本額	2,344,325,780円	5,448,716,965円
期中一部解約元本額	1,198,947,380円	2,106,351,707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 ド（FOFs用）（適格機関投資 家専用）	73,808,571円	277,774,351円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	291,049円	2,129,262円
iFree 日本債券イン デックス	124,730,662円	133,413,372円
iFree 8資産バランス	1,420,958,920円	2,155,267,221円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	6,023,850,370円	6,778,854,869円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,316,782,480円	4,039,023,893円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,004,425,513円	1,234,024,213円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	813,657,901円	1,023,865,794円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6分散コー ス）	634,676,503円	765,579,968円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	207,511,133円	247,347,157円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	51,154,325円	52,751,675円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	54,486,367円	64,915,732円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	6,169,702円	14,439,445円
ダイワつみたてインデックス日本債券	98,049,539円	346,605,713円
ダイワつみたてインデックスバランス30	419,453円	25,222,208円
ダイワつみたてインデックスバランス50	305,057円	7,852,221円
ダイワつみたてインデックスバランス70	155,916円	3,762,294円
ダイワ世界バランスファンド40VA	307,394,817円	304,558,160円
ダイワ世界バランスファンド60VA	188,704,674円	194,767,735円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	2,257,073円	-円
計	14,329,790,025円	17,672,155,283円
2. 期末日における受益権の総数	14,329,790,025口	17,672,155,283口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあり得ます。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7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	581,998,540	317,831,200
地方債証券	4,540,300	5,542,100
特殊債券	1,193,800	4,715,400
社債券	2,705,300	4,428,400
合計	590,437,940	332,517,100

(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(2018年12月1日から2019年9月9日まで、及び2019年12月3日から2020年9月7日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3238円 (13,238円)	1.2879円 (12,879円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 0 6 2年国債	180,000,000	180,516,600	
	4 0 7 2年国債	30,000,000	30,092,400	
	4 0 8 2年国債	160,000,000	160,526,400	
	4 0 9 2年国債	40,000,000	40,140,000	
	4 1 3 2年国債	120,000,000	120,540,000	
	4 1 4 2年国債	170,000,000	170,754,800	
	4 1 5 2年国債	100,000,000	100,456,000	
	1 3 0 5年国債	247,000,000	247,760,760	
	1 3 1 5年国債	190,000,000	190,697,300	
	1 3 2 5年国債	170,000,000	170,712,300	
	1 3 3 5年国債	230,000,000	231,076,400	
	1 3 4 5年国債	170,000,000	170,873,800	
	1 3 5 5年国債	260,000,000	261,482,000	
	1 3 6 5年国債	150,000,000	150,940,500	
	1 3 7 5年国債	410,000,000	412,804,400	
	1 3 8 5年国債	280,000,000	282,027,200	
	1 3 9 5年国債	240,000,000	241,869,600	
	1 4 0 5年国債	140,000,000	141,169,000	
	1 4 1 5年国債	190,000,000	191,692,900	
	1 4 2 5年国債	20,000,000	20,185,000	
	1 4 3 5年国債	200,000,000	201,818,000	
	1 4 4 5年国債	200,000,000	201,776,000	
	1 4 0年国債	30,000,000	43,952,400	
	2 4 0年国債	38,000,000	54,061,080	
	3 4 0年国債	19,000,000	27,170,760	
	4 4 0年国債	30,000,000	43,164,600	

5	40年国債	35,000,000	48,767,250	
6	40年国債	28,000,000	38,482,920	
7	40年国債	31,000,000	41,033,770	
8	40年国債	33,000,000	40,901,850	
9	40年国債	40,000,000	37,113,600	
10	40年国債	91,000,000	99,030,750	
11	40年国債	85,000,000	89,794,000	
12	40年国債	99,000,000	94,569,750	
13	40年国債	79,000,000	75,391,280	
319	10年国債	140,000,000	142,228,800	
320	10年国債	35,000,000	35,512,400	
321	10年国債	65,000,000	66,134,900	
322	10年国債	140,000,000	142,230,200	
323	10年国債	70,000,000	71,299,200	
324	10年国債	80,000,000	81,342,400	
325	10年国債	160,000,000	163,032,000	
326	10年国債	20,000,000	20,377,600	
327	10年国債	90,000,000	91,905,300	
328	10年国債	60,000,000	61,103,400	
329	10年国債	160,000,000	164,105,600	
330	10年国債	81,000,000	83,268,000	
331	10年国債	10,000,000	10,219,100	
332	10年国債	65,000,000	66,541,800	
333	10年国債	83,000,000	85,117,330	
334	10年国債	320,000,000	328,748,800	
335	10年国債	210,000,000	215,275,200	
337	10年国債	210,000,000	213,704,400	
338	10年国債	80,000,000	81,819,200	
339	10年国債	25,000,000	25,588,000	
340	10年国債	150,000,000	153,715,500	
341	10年国債	15,000,000	15,306,300	
342	10年国債	20,000,000	20,205,400	
343	10年国債	122,000,000	123,310,280	
344	10年国債	50,000,000	50,560,500	
345	10年国債	280,000,000	283,180,800	
346	10年国債	40,000,000	40,472,400	
347	10年国債	215,000,000	217,562,800	
348	10年国債	210,000,000	212,522,100	
349	10年国債	250,000,000	253,017,500	

350	10年国債	230,000,000	232,693,300
351	10年国債	180,000,000	182,037,600
352	10年国債	230,000,000	232,500,100
353	10年国債	210,000,000	212,177,700
354	10年国債	150,000,000	151,473,000
355	10年国債	75,000,000	75,691,500
356	10年国債	185,000,000	186,502,200
357	10年国債	75,000,000	75,555,750
358	10年国債	235,000,000	236,562,750
359	10年国債	200,000,000	201,168,000
2	30年国債	9,000,000	11,015,550
3	30年国債	4,000,000	4,875,440
4	30年国債	8,000,000	10,298,080
5	30年国債	8,000,000	9,793,360
6	30年国債	9,000,000	11,280,150
7	30年国債	12,000,000	14,999,880
10	30年国債	15,000,000	16,701,000
11	30年国債	9,000,000	10,709,010
12	30年国債	11,000,000	13,680,700
13	30年国債	11,000,000	13,570,590
14	30年国債	22,000,000	28,375,380
15	30年国債	21,000,000	27,440,700
16	30年国債	26,000,000	34,069,360
17	30年国債	17,000,000	22,101,020
18	30年国債	20,000,000	25,784,000
19	30年国債	15,000,000	19,383,000
20	30年国債	16,000,000	21,185,120
21	30年国債	16,000,000	20,766,880
22	30年国債	17,000,000	22,633,120
23	30年国債	16,000,000	21,352,000
24	30年国債	15,000,000	20,078,700
25	30年国債	17,000,000	22,260,820
26	30年国債	32,000,000	42,515,520
27	30年国債	32,000,000	43,267,840
28	30年国債	34,000,000	46,186,960
29	30年国債	43,000,000	57,951,960
30	30年国債	56,000,000	74,870,880
31	30年国債	76,000,000	100,818,560
32	30年国債	45,000,000	60,817,500

33	30年国債	75,000,000	97,527,000
34	30年国債	70,000,000	94,081,400
35	30年国債	92,000,000	120,440,880
36	30年国債	73,000,000	95,866,520
37	30年国債	83,000,000	107,663,450
38	30年国債	65,000,000	83,204,550
39	30年国債	50,000,000	65,182,000
40	30年国債	44,000,000	56,514,480
41	30年国債	45,000,000	56,914,200
42	30年国債	53,000,000	67,095,350
43	30年国債	40,000,000	50,686,400
44	30年国債	42,000,000	53,270,280
45	30年国債	57,000,000	69,795,360
46	30年国債	55,000,000	67,384,900
47	30年国債	50,000,000	62,471,000
48	30年国債	68,000,000	81,797,880
49	30年国債	68,000,000	81,827,800
50	30年国債	60,000,000	63,714,000
51	30年国債	55,000,000	51,778,100
52	30年国債	69,000,000	68,214,090
53	30年国債	55,000,000	55,631,400
54	30年国債	55,000,000	58,318,150
55	30年国債	56,000,000	59,337,040
56	30年国債	50,000,000	52,941,500
57	30年国債	70,000,000	74,063,500
58	30年国債	75,000,000	79,387,500
59	30年国債	55,000,000	56,782,550
60	30年国債	48,000,000	51,953,760
61	30年国債	50,000,000	51,457,500
62	30年国債	46,000,000	44,934,180
63	30年国債	50,000,000	47,429,000
64	30年国債	50,000,000	47,351,500
65	30年国債	55,000,000	52,000,850
66	30年国債	102,000,000	96,278,820
67	30年国債	59,000,000	58,703,230
53	20年国債	13,000,000	13,374,010
54	20年国債	14,000,000	14,420,700
55	20年国債	41,000,000	42,346,440
56	20年国債	12,000,000	12,457,320

57	20年国債	24,000,000	24,871,680
58	20年国債	35,000,000	36,447,950
59	20年国債	3,000,000	3,125,280
61	20年国債	40,000,000	41,141,200
62	20年国債	16,000,000	16,410,560
63	20年国債	30,000,000	31,607,100
64	20年国債	35,000,000	37,151,800
65	20年国債	42,000,000	44,787,960
66	20年国債	30,000,000	31,892,700
67	20年国債	19,000,000	20,356,410
68	20年国債	25,000,000	27,050,500
69	20年国債	12,000,000	12,941,760
70	20年国債	18,000,000	19,719,000
71	20年国債	17,000,000	18,494,300
72	20年国債	53,000,000	57,756,220
75	20年国債	14,000,000	15,401,120
76	20年国債	25,000,000	27,274,500
78	20年国債	17,000,000	18,619,760
79	20年国債	14,000,000	15,401,120
81	20年国債	65,000,000	71,849,700
82	20年国債	28,000,000	31,092,320
85	20年国債	31,000,000	34,752,860
86	20年国債	6,000,000	6,792,960
87	20年国債	35,000,000	39,431,350
88	20年国債	33,000,000	37,561,260
89	20年国債	15,000,000	16,986,150
92	20年国債	45,000,000	51,177,600
93	20年国債	18,000,000	20,450,340
94	20年国債	45,000,000	51,421,050
95	20年国債	30,000,000	34,844,100
96	20年国債	23,000,000	26,400,320
97	20年国債	25,000,000	29,000,500
98	20年国債	34,000,000	39,200,640
99	20年国債	53,000,000	61,372,940
100	20年国債	35,000,000	40,951,050
101	20年国債	18,000,000	21,332,700
102	20年国債	10,000,000	11,904,400
103	20年国債	21,000,000	24,835,230
104	20年国債	64,000,000	74,689,280

105	20年国債	38,000,000	44,517,380
106	20年国債	16,000,000	18,872,960
107	20年国債	20,000,000	23,527,200
108	20年国債	68,000,000	78,863,680
109	20年国債	60,000,000	69,811,800
110	20年国債	27,000,000	31,876,470
111	20年国債	35,000,000	41,779,500
112	20年国債	40,000,000	47,396,400
113	20年国債	70,000,000	83,202,700
114	20年国債	45,000,000	53,671,950
115	20年国債	42,000,000	50,482,740
116	20年国債	27,000,000	32,566,860
117	20年国債	77,000,000	92,144,360
118	20年国債	13,000,000	15,482,350
119	20年国債	23,000,000	26,943,810
120	20年国債	75,000,000	86,398,500
123	20年国債	42,000,000	50,703,660
124	20年国債	55,000,000	65,836,100
125	20年国債	25,000,000	30,533,500
126	20年国債	21,000,000	25,209,660
127	20年国債	70,000,000	83,301,400
128	20年国債	32,000,000	38,184,000
129	20年国債	65,000,000	76,867,700
130	20年国債	28,000,000	33,176,080
131	20年国債	70,000,000	82,176,500
132	20年国債	25,000,000	29,413,250
133	20年国債	75,000,000	89,075,250
134	20年国債	15,000,000	17,855,400
135	20年国債	20,000,000	23,579,800
136	20年国債	65,000,000	75,895,950
137	20年国債	18,000,000	21,254,220
139	20年国債	120,000,000	140,304,000
141	20年国債	48,000,000	56,904,000
142	20年国債	70,000,000	83,827,800
143	20年国債	48,000,000	56,420,160
144	20年国債	40,000,000	46,526,000
145	20年国債	130,000,000	154,685,700
146	20年国債	115,000,000	137,084,600
147	20年国債	100,000,000	118,113,000

148	20年国債	85,000,000	99,423,650	
149	20年国債	120,000,000	140,544,000	
150	20年国債	115,000,000	133,290,750	
151	20年国債	120,000,000	135,813,600	
152	20年国債	100,000,000	113,239,000	
153	20年国債	140,000,000	160,609,400	
154	20年国債	100,000,000	113,271,000	
155	20年国債	120,000,000	132,466,800	
156	20年国債	85,000,000	86,133,050	
157	20年国債	113,000,000	110,878,990	
158	20年国債	95,000,000	97,532,700	
159	20年国債	120,000,000	124,909,200	
160	20年国債	130,000,000	137,322,900	
161	20年国債	80,000,000	83,169,600	
162	20年国債	80,000,000	83,080,800	
163	20年国債	72,000,000	74,689,920	
164	20年国債	110,000,000	112,169,200	
165	20年国債	95,000,000	96,737,550	
166	20年国債	100,000,000	105,222,000	
167	20年国債	80,000,000	81,362,400	
168	20年国債	110,000,000	109,809,700	
169	20年国債	80,000,000	78,396,800	
170	20年国債	40,000,000	39,154,000	
171	20年国債	60,000,000	58,663,200	
172	20年国債	95,000,000	94,571,550	
173	20年国債	75,000,000	74,589,750	
国債証券 合計			19,490,511,720	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	101,739,400	
	27-15 北海道公債	100,000,000	100,872,500	
	222 神奈川県公債	100,000,000	100,023,000	
	401 大阪府公債	100,000,000	102,179,700	
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	102,357,500	
	11 兵庫県公債20年	100,000,000	116,645,000	
	28-1 静岡県公債	100,000,000	100,159,800	
	24-16 愛知県公債	100,000,000	101,763,000	
	22-1 福岡県15年	100,000,000	108,450,400	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	101,004,200	
	116 共同発行地方	100,000,000	101,726,700	
	117 共同発行地方	100,000,000	101,593,200	

	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,838,500	
	2 5 - 6 大阪市公債	100,000,000	102,144,500	
	1 1 名古屋市20年	100,000,000	118,240,400	
地方債証券	合計		1,559,737,800	
特殊債券	4 7 日本政策投資C O	100,000,000	107,770,200	
	8 1 政保道路機構	100,000,000	117,235,400	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	101,501,800	
	2 4 1 政保道路機構	100,000,000	101,848,300	
	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	101,687,700	
	3 6 地方公共団体	100,000,000	101,513,100	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	102,037,300	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,790,300	
特殊債券	合計		833,384,100	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,775,600	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	101,939,500	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,941,100	
	5 N T Tファイナンス	100,000,000	101,381,900	
	8 0 三菱地所	100,000,000	113,281,100	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	107,663,400	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	103,608,600	
社債券	合計		728,591,200	
合計			22,612,224,820	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	310,544,181	490,246,399

金銭信託		81,363,318	250,265,526
コール・ローン		1,650,714,540	1,463,251,667
国債証券		181,018,748,472	207,276,345,009
派生商品評価勘定		9,687,789	6,404,065
未収利息		1,166,961,459	1,133,352,685
前払費用		33,597,855	55,994,215
流動資産合計		184,271,617,614	210,675,859,566
資産合計		184,271,617,614	210,675,859,566
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	37,986
未払解約金		49,790,998	39,857,702
その他未払費用		-	1,488
流動負債合計		49,790,998	39,897,176
負債合計		49,790,998	39,897,176
純資産の部			
元本等			
元本	1	64,884,126,052	69,294,023,744
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		119,337,700,564	141,341,938,646
元本等合計		184,221,826,616	210,635,962,390
純資産合計		184,221,826,616	210,635,962,390
負債純資産合計		184,271,617,614	210,675,859,566

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<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>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	61,016,797,302円	64,884,126,052円
期中追加設定元本額	7,317,086,630円	11,883,280,333円
期中一部解約元本額	3,449,757,880円	7,473,382,641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	665,066,981円	619,439,410円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	22,335,406円	16,394,286円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	136,671,225円	104,485,816円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	41,439,241円	29,631,947円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	452,115,338円	347,995,057円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	21,328,975円	72,630,080円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマージ ングプラス(為替ヘッジな し)	396,024,112円	462,210,176円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,397,701,870円	1,764,861,209円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	772,381,006円	641,943,287円
D-I's 外国債券インデッ クス	2,319,541円	1,101,524円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	137,425円	910,973円
iFree 外国債券イン デックス	581,553,813円	646,512,133円
iFree 8資産バランス	669,429,376円	917,298,628円
iFree 年金バランス	11,605,239円	37,616,571円
DCダイワ外国債券インデッ クス	44,921,822,655円	48,137,448,595円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	770,420,650円	787,595,796円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	386,983,564円	431,244,535円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	236,055,342円	262,640,586円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	383,524,126円	435,390,378円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	296,847,629円	326,114,604円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	96,841,002円	105,202,617円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	9,553,624円	8,986,991円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,774,212円	19,218,139円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	2,335,799円	4,685,011円
ダイワつみたてインデックス外国債券	42,409,294円	148,838,637円
ダイワつみたてインデックスバランス30	53,558円	2,938,110円
ダイワつみたてインデックスバランス50	35,706円	837,194円
ダイワつみたてインデックスバランス70	36,799円	802,053円
ダイワ世界バランスファンド40VA	202,933,789円	182,332,430円
ダイワ世界バランスファンド60VA	148,305,974円	138,793,711円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,009,608,503円	4,283,805,122円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,596,398円	-円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	300,947,657円	256,763,016円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	149,526,227円	147,389,137円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	29,980,661円	32,291,656円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	903,195,629円	1,958,427,646円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,690,917,776円	5,852,076,418円
ダイワライフスタイル25	34,527,657円	32,696,083円

	ダイワライフスタイル50	60,594,929円	58,954,721円
	ダイワライフスタイル75	16,187,344円	15,519,461円
計		64,884,126,052円	69,294,023,744円
2.	期末日における受益権の総数	64,884,126,052口	69,294,023,744口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7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	14,670,452,446	6,315,681,141
合計	14,670,452,446	6,315,681,141

(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(2018年12月1日から2019年9月9日まで、及び2019年12月3日から2020年9月7日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	1,636,106,701	-	1,645,794,490	9,687,789	1,641,255,891	-	1,647,621,970	6,366,079
アメリカ・ドル	707,186,956	-	710,848,250	3,661,294	490,344,159	-	494,281,680	3,937,521
イギリス・ポ ンド	68,908,890	-	69,803,720	894,830	18,725,728	-	18,741,030	15,302
オーストラ リア・ドル	35,501,952	-	36,315,790	813,838	16,465,234	-	16,427,880	37,354
カナダ・ドル	72,101,631	-	73,116,120	1,014,489	30,892,358	-	31,141,730	249,372
シンガポール ・ドル	8,875,920	-	8,964,480	88,560	25,707,346	-	25,781,590	74,244

スウェーデン・ クローナ	5,748,135	-	5,856,030	107,895	-	-	-	-
デンマーク・ク ローネ	22,701,376	-	22,721,810	20,434	30,193,719	-	30,252,960	59,241
ノルウェー・ク ローネ	17,236,448	-	17,546,760	310,312	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	31,314,327	-	32,476,800	1,162,473	-	-	-	-
ユーロ	656,876,022	-	658,092,730	1,216,708	1,028,927,347	-	1,030,995,100	2,067,753
南アフリカ・ラ ンド	9,655,044	-	10,052,000	396,956	-	-	-	-
合計	1,636,106,701	-	1,645,794,490	9,687,789	1,641,255,891	-	1,647,621,970	6,366,079

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.8392円	3.0397円
(1万口当たり純資産額)	(28,392円)	(30,397円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2% United States Treasury Note/Bond 20211115	アメリカ・ドル 2,153,000.000	アメリカ・ドル 2,199,999.990	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,309,500.480	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,525,565.130	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,615,297.490	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,881,309.320	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,543,357.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,882,613.300	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,877,390.640	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,428,152.890	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,688,158.490	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,322,987.040	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,301,858.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	770,464.320	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,114,800.300	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	992,153.330	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	969,171.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	1,014,919.740	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	654,660.380			

6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,089,178.440	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,519,241.170	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	676,000.000	1,020,861.400	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,369,556.650	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	840,747.080	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	808,378.830	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,467,120.910	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,713,112.200	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,669,574.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,882,772.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,619,787.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,623,183.840	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,608,963.160	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,272,116.990	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	2,060,673.120	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	2,151,676.800	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,218,248.420	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,951,149.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,189,524.380	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,791,344.940	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,846,778.310	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	2,078,999.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,544,259.680	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	1,898,000.000	2,465,900.580	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,665,313.840	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	3,078,090.340	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,707,000.000	5,396,279.900	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,677,795.270	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,678,991.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,616,051.930	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,324,626.160	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,701,161.250	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,208,963.750	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,411,318.010	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	5,118,756.780	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,947,414.080	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,250,189.780	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,573,572.610	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,184,464.410	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	3,142,673.710	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,898,244.870	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,962,349.880	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,281,311.240	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,781,181.250	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,680,956.800	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,365,355.680	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,921,258.340	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,324,930.680	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,217,658.950	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,873,000.000	5,068,478.910	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,527,689.900	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,553,674.880	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,415,765.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,159,000.000	1,550,788.360	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,652,108.820	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,545,332.830	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,217,788.160	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,664,110.480	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,657,831.410	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,484,158.080	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,060,338.400	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,745,819.700	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,990,589.350	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,149,239.600	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	4,211,624.970	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,599,000.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,100,770.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,748,030.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	4,092,236.400	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,735,668.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,865,568.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,484,744.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,595,605.850	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,073,697.640	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,810,496.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	3,037,950.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,612,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,500,000.000	4,607,960.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,644,454.700	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,467,456.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,096,840.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,669,325.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	6,140,000.000	6,844,135.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,081,698.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,651,268.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,776,887.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,086,423.900	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,453,272.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,860,310.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,978,822.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,204,480.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	4,724,720.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,086,460.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,194,040.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,082,950.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,651,496.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,087,180.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,561,040.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,608,413.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,994,250.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,219,120.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,460,988.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,293,248.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,129,840.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,588,075.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,690,025.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,598,425.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,175,455.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,531,100.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,788,750.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,451,488.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,038,000.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,684,555.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,564,113.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,500,574.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,853,292.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,998,458.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	5,146,302.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,073,304.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,209,024.000	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,820,906.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,635,940.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,669,900.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,127,107.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,980,437.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,675,175.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,671,275.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,352,500.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,135,439.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,897,089.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,736,879.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,813,650.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,873,924.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	4,033,116.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,592,820.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,836,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,245,370.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,089,640.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,840,625.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,335,600.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,128,560.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	5,900,000.000	7,094,278.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,558,203.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,394,680.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,172,020.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,887,808.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,920,245.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,699,800.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,094,800.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,692,564.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,100,890.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,310,600.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,804,475.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	6,409,249.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,790,800.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,547,236.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,617,705.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,760,525.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,824,986.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,512,744.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	6,209,889.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,475,523.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,757,005.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,113,236.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,598,280.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,297,180.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,701,775.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	3,038,868.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,117,960.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,823,510.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,715,225.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,489,191.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,591,175.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,459,234.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,141,044.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,959,684.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,159,040.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,081,660.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,173,491.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,680,450.000	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,150,930.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,974,414.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,051,250.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,589,627.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,218,430.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	6,450,000.000	7,080,874.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,482,935.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,525,005.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,146,400.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,156,090.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,100,170.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,702,925.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,658,975.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,528,995.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,125,760.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	4,700,000.000	4,926,916.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,542,475.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,315,992.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,870,828.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,411,744.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,700,000.000	5,308,039.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	202,882.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	312,726.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	200,000.000	207,608.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	200,000.000	201,694.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,514,880.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,694.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	200,000.000	200,428.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,616,000.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,740,876.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	500,000.000	499,355.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,711,178.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430	500,000.000	499,785.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	1,700,000.000	1,702,380.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	5,298,104.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,899,600.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	499,745.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,502,975.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,994,600.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,511,770.000	

	0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,497,195.000	
	0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,482,375.000	
	0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,500,805.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,470.000	
	0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,391,228.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,498,215.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	800,000.000	798,656.000	
	0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	2,500,000.000	2,476,750.000	
	0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,958,200.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	2,100,000.000	2,052,078.000	
	1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,500,000.000	1,464,840.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 854,538,392.790 (90,888,703,457)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,621,000.000	1,788,968.020	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,803,053.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,596,439.800	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,345,032.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,790,000.000	2,085,350.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,750,000.000	3,225,200.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,510,000.000	1,982,932.000	

1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,010,000.000	2,175,081.300	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,049,400.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,500,000.000	2,804,775.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,060,000.000	1,504,882.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	2,600,000.000	2,703,506.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,110,000.000	1,373,292.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,058,700.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	2,227,470.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,683,304.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	940,000.000	1,025,728.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,310,511.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,700,000.000	1,713,770.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	650,000.000	593,320.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	700,000.000	704,480.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	500,000.000	499,690.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	50,000.000	47,375.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,401,521.160	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,936,032.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,808,543.360	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,564,632.200	

4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,257,000.000	2,142,933.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,608,000.000	3,324,057.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	3,019,458.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,604,692.320	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,816,000.000	3,202,697.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,663,016.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,546,328.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,362,041.000	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,466,357.280	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,940,778.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,574,000.000	3,310,594.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,619,239.300	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	833,401.580	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,844,350.400	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,324,707.380	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,295,135.800	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,693,277.880	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,358,196.400	
2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,216,269.600	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,387,780.000	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド	

			98,168,301.480 (13,834,858,727)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,500,000.000	2,029,245.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,153,260.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,988,892.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,371,284.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,248,020.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,458,654.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,977,768.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,025,160.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,750,000.000	2,566,725.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	2,037,996.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,562,100.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,012,490.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,100,000.000	1,131,493.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	600,000.000	604,308.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	700,000.000	730,758.000	
イスラエル・シュケル	小計		イスラエル・シュケル 26,898,153.000 (849,174,690)	
オーストラリ ア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	3,162,000.000	3,483,480.540	

5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,055,495.840	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,540,189.260	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	3,473,000.000	3,782,201.190	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	3,404,000.000	4,093,548.280	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,498,000.000	3,956,797.680	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,772,220.080	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,248,000.000	3,923,843.840	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,513,368.360	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,007,000.000	1,217,070.270	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	1,022,044.320	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,062,619.680	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,678,000.000	2,983,345.560	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,152,000.000	1,472,555.520	
2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	800,000.000	818,648.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,238,564.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,930,493.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	3,034,486.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	3,370,000.000	3,873,478.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	990,000.000	1,194,405.300	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,995,916.000	

	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	900,000.000	923,490.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,390,136.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,700,000.000	2,717,631.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,500,000.000	1,485,825.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,500,000.000	1,483,665.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 65,965,518.220 (5,112,327,662)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 405,000.000	カナダ・ドル 639,968.850	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	879,873.140	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,419,284.890	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,796,258.870	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,661,784.960	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	2,133,681.090	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,827,763.840	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,253,548.670	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,295,351.400	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,519,395.100	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,881,332.810	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,259,138.320	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,030,919.100	

0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,494,359.200	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,288,198.800	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,446,451.200	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,776,722.500	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,338,588.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	3,100,000.000	3,214,948.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,366,742.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,740,000.000	2,159,148.600	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,399,498.600	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,281,252.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,465,688.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	2,450,000.000	2,604,448.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	809,904.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,600,000.000	1,665,168.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,120,152.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,106.450	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	1,690,000.000	1,702,337.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,301,173.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	700,182.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 49,738,368.390	

(4,045,221,501)

シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル
3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000		910,188.000
3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000		833,310.000
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000		687,106.700
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	609,000.000		721,202.160
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000		505,000.000
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000		716,628.000
3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000		724,484.000
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000		730,937.500
2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000		571,238.600
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000		897,840.000
2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000		489,510.000
1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000		465,106.000
1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000		512,145.000
2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	650,000.000		747,506.500
1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000		465,885.000
2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000		624,965.000
2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000		517,048.000
2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000		175,810.500
1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	300,000.000		349,350.000

シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 11,645,260.960 (907,398,734)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	スウェーデン・クローナ 4,655,000.000	スウェーデン・クローナ 7,272,413.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,032,747.550	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,498,234.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,604,831.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,112,304.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,863,540.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	5,400,000.000	5,797,386.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	3,000,000.000	3,015,180.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 53,196,637.700 (647,935,047)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 12,662,000.000	デンマーク・クローネ 23,885,216.940	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	7,871,403.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,177,708.700	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,749,953.280	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,456,792.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,368,612.100	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	800,000.000	815,272.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ	

			63,324,958.520 (1,071,458,299)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	8,602,222.160	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,487,915.250	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,740,765.550	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,543,072.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,735,384.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,887,100.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	4,236,270.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,000,000.000	4,278,880.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 38,511,609.460 (458,673,269)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,575,204.610	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,766,859.390	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,458,279.800	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,320,000.000	3,440,018.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	3,011,053.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,085,910.100	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,424,720.400	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	2,400,000.000	2,568,504.000	

	Poland Government Bond 20220725	3,200,000.000	3,195,808.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	1,000,000.000	1,003,700.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	500,000.000	493,320.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,139,506.760	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,684,000.000	1,793,426.320	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,930,025.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	4,046,901.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,149,081.960	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 48,082,318.840 (1,358,325,507)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	1,773,000.000	1,903,386.420	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	881,570.520	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,361,838.680	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,691,410.520	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,482,975.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	902,466.250	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	803,449.410	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	696,047.220	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,041,770.730	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,553,517.820	

3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,289,810.580	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	726,462.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,141,179.480	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	878,219.320	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,894,980.150	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,209,297.600	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,383,065.200	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,373,636.040	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,093,931.100	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	713,557.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	360,595.840	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	1,600,000.000	1,652,400.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	809,002.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	981,278.400	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,266,174.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,293,396.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	839,800.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	817,558.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	721,284.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	710,547.500	

	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,109,404.000	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,438,812.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	421,032.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,418,729.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,500,000.000	1,591,935.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	400,000.000	428,448.000	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 40,882,967.280 (1,048,239,281)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	20,290,000.000	20,851,018.500	
	8% Mexican Bonos 20471107	16,300,000.000	18,246,220.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	29,000,000.000	29,970,630.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	17,800,000.000	19,831,336.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	5,000,000.000	5,256,250.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	33,023,986.470	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	28,543,260.270	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	31,148,520.960	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,947,066.200	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	26,544,000.000	31,494,456.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	22,430,201.040	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	14,799,616.800	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,551,918.680	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	16,654,000.000	18,277,598.460	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	8,995,785.600	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 324,367,864.980 (1,602,377,253)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	614,000.000	681,509.300	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	300,139.830	

0.5% Finland Government Bond 20260415	1,111,000.000	1,178,315.490	
Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,008.000	
1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	480,189.600	
Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,138.900	
0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	856,120.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	433,725.100	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	537,650.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	539,000.000	
Finland Government Bond 20240915	200,000.000	205,236.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	318,726.500	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	415,952.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,503,256.510	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,217,746.480	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	1,049,133.120	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	378,652.800	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,127.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	780,000.000	832,969.800	
2.1% Austria Government Bond 21170920	490,000.000	1,009,978.200	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	405,584.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	982,485.000	

0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,054,960.200	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	819,816.000	
Austria Government Bond 20300220	680,000.000	700,393.200	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,017,520.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	802,998.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,813,835.410	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,074,000.000	1,207,809.660	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	981,685.800	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,397,084.360	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,600,866.280	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	1,039,705.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	503,122.200	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,519,112.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,098,835.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	780,000.000	1,218,812.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	484,572.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,464,137.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	850,000.000	992,638.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,659,420.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	798,894.000	

0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,258,003.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	671,853.600	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,235,148.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,203,620.500	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,752,227.160	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,004,768.660	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,360,447.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,572,611.640	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,650,375.520	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,430,832.650	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	6,144,905.380	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,476,915.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,896,606.270	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	5,076,748.560	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,456,360.450	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,873,443.390	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,322,745.480	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,508,000.000	4,113,621.600	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,717,536.120	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,488,283.200	

1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,927,600.790	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,729,302.510	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,697,197.250	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,979,000.000	5,010,082.200	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,727,656.900	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,323,363.620	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,315,942.520	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,318,740.380	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,526,632.320	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,521,906.200	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	6,200,000.000	6,578,696.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,488,876.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,070,000.000	2,832,588.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,063,704.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,706,768.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,358,840.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,151,170.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,750,000.000	1,770,055.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,836,957.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,200,000.000	1,249,296.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,091,060.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	700,000.000	734,202.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	503,405.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	807,168.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	303,129.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	101,242.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,410,472.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,173,038.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,131,458.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,840,646.300	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,944,479.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,971,744.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,751,493.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,480,136.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	300,000.000	310,902.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,468,724.650	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,065,479.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	5,021,185.920	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	5,031,922.780	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,510,940.320	

4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,700,113.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	4,014,671.400	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,731,543.360	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,764,000.000	6,989,672.720	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,487,000.000	3,287,994.920	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,873,260.820	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,333,056.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,845,767.200	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,199,000.000	6,402,308.550	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,924,136.200	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,351,023.240	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,565,994.210	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,634,830.260	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,387,000.000	5,566,664.300	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,899,000.000	4,292,292.130	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,673,164.960	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,357,173.610	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,217,235.400	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,287,000.000	3,481,984.840	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,169,000.000	3,737,518.600	

1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,880,808.930	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,800,000.000	3,975,446.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,044,360.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,170,000.000	2,797,021.500	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,735,138.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,300,000.000	3,242,816.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,439,336.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,788,652.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,627,899.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	3,650,000.000	3,981,639.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,475,106.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,413,034.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,750,000.000	3,529,212.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,250,000.000	5,621,647.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,213,633.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,800,000.000	2,866,584.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,437,872.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,370,000.000	1,458,789.700	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,085,110.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	1,046,520.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	2,000,000.000	2,036,420.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	654,936.720	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,651,880.310	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,485,000.000	2,514,951.450	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	874,450.500	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,779,000.000	3,252,776.970	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,516,529.180	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,577,769.440	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,482,060.800	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,740,543.980	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,672,258.420	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,869,732.360	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,745,092.440	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,210,668.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,307,196.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,431,374.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,264,310.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,273,788.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	600,000.000	669,072.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,900,000.000	1,969,844.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	828,480.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,414,773.080	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,552,557.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,334,782.880	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,977,894.900	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,926,208.320	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,667,167.470	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,611,399.740	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,859,462.800	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,038,138.710	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,549,526.080	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,875,617.800	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,390,596.750	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,889,784.460	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,584,845.760	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,108,989.840	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,576,892.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,366,596.140	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,141,610.800	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,706,910.000	

2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,658,704.800	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,377,805.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	2,750,000.000	2,806,760.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,451,435.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,938,086.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,732,215.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,676,240.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,571,180.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,282,385.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,943,662.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,362,062.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,788,312.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,500,492.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,709,402.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,233,240.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,592,199.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,771,312.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,581,744.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,235,939.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,324,014.000	

2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,279,655.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,535,837.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,962,453.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	740,902.800	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,299,519.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,377,636.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,200,000.000	1,328,604.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,503,405.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,031,260.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,452,375.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,987,900.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,532,552.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,307,293.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	200,000.000	202,324.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,791,101.320	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,237,716.560	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,730,224.950	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,347,335.740	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,707,357.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,153,483.200	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,556,798.350	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,552,105.280	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,484,590.220	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,508,550.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,392,586.520	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,166,219.800	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	2,657,000.000	2,950,678.210	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,191,848.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,134,759.300	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,117,738.220	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,827,935.530	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,521,805.540	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,500,578.110	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,838,000.000	3,484,836.960	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,640,503.260	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,476,787.860	
5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,620,331.760	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	941,003.460	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,857,782.640	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,520,411.160	

4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,285,163.880	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,450,258.320	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,153,284.600	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,447,421.640	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,505,387.250	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,691,484.550	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,055,227.140	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,310,411.310	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	696,096.960	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	693,285.050	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,202,816.430	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	526,959.840	
2% IRISH TREASURY 20450218	881,000.000	1,220,625.500	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,163,754.340	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	687,753.000	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,441.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	875,448.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	550,000.000	641,547.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	450,000.000	519,727.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	1,200,000.000	1,340,520.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	500,000.000	638,740.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	250,000.000	260,570.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	830,560.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	516,685.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,213,360.500	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,393,782.390	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,673,000.000	2,834,563.900	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,144,333.750	

3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	853,116.770	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	951,395.600	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	793,414.440	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,069,834.290	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,032,037.440	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,038,922.500	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,022,208.280	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	819,209.400	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	487,700.970	
1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	326,536.080	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	471,288.200	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	635,847.960	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	580,476.990	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,943,656.600	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,222,874.100	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,381,592.240	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,460,169.280	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,059,238.210	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,771,898.560	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	2,122,512.500	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,206,122.800	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,110,160.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,096,194.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	2,200,000.000	2,698,520.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,256,763.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,631,696.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,090,950.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,799,915.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,452,968.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,093,819.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,700,000.000	1,710,438.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	2,600,000.000	2,880,020.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,650,000.000	1,928,239.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,353,866.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,900,000.000	1,963,365.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,388,396.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,486,592.600	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	1,500,000.000	1,517,475.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,153,200.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,529,648.000	

1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,160,333.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	900,000.000	947,097.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,200,102.370	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,863,669.860	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,764,782.060	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,979,915.840	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,235,101.790	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,715,782.850	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,665,856.550	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,153,844.200	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,233,412.280	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,190,085.070	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,488,407.600	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,456,227.140	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,270,878.100	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,366,149.950	
ユーロ 小計		ユーロ 678,888,151.130 (85,451,651,582)	
国債証券 合計		207,276,345,009 [207,276,345,009]	
合計		207,276,345,009 [207,276,345,009]	

（注）1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における〔 〕内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 249銘柄	100%	43.8%
イギリス・ポンド	国債証券 47銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シェケル	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%	2.5%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リングgit	国債証券 36銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 326銘柄	100%	41.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	179,782,730	163,343,622
金銭信託	5,562,269	27,085,007
コール・ローン	112,848,380	158,360,534
国債証券	13,293,383,939	16,082,945,127
派生商品評価勘定	3,173,630	1,870,918

未収利息		179,582,805	205,790,810
前払費用		17,909,951	23,733,989
流動資産合計		13,792,243,704	16,663,130,007
資産合計		13,792,243,704	16,663,130,007
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	2,373,372
未払金		92,941,055	29,036,624
未払解約金		1,153,226	7,612,716
その他未払費用		-	168
流動負債合計		94,094,281	39,022,880
負債合計		94,094,281	39,022,880
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,015,179,396	12,256,994,427
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,682,970,027	4,367,112,700
元本等合計		13,698,149,423	16,624,107,127
純資産合計		13,698,149,423	16,624,107,127
負債純資産合計		13,792,243,704	16,663,130,007

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7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	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	7,543,379,126円	10,015,179,396円
期中追加設定元本額	2,912,481,879円	3,334,908,979円
期中一部解約元本額	440,681,609円	1,093,093,948円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	17,127,669円	63,982,469円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	208,931,970円	258,222,119円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	407,678,668円	358,926,042円

D - I ' s 新興国債券イン デックス	56,456,104円	55,788,261円
i F r e e 新興国債券イン デックス	2,328,868,726円	2,957,472,086円
i F r e e 8資産バランス D Cダイワ新興国債券イン デックスファンド	1,410,629,846円	2,065,719,756円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	5,371,446,714円	6,282,460,991円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	179,795,307円	174,895,312円
計	34,244,392円	39,527,391円
2. 期末日における受益権の総数	10,015,179,396円	12,256,994,427円
	10,015,179,396口	12,256,994,427口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7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	143,130,090	8,997,064
合計	143,130,090	8,997,064

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年7月6日から2019年9月9日まで、及び2020年7月7日から2020年9月7日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の 取引  為替予約取引								

売 建	-	-	-	-	18,611,845	-	18,611,250	595
アメリカ・ドル	-	-	-	-	18,611,845	-	18,611,250	595
買 建	99,423,370	-	102,597,000	3,173,630	222,522,605	-	222,019,556	503,049
インドネシア・ ルピア	15,160,000	-	15,200,000	40,000	-	-	-	-
トルコ・リラ	16,257,770	-	16,677,000	419,230	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	-	-	-	-	14,797,443	-	14,363,216	434,227
ポーランド・ズ ロチ	-	-	-	-	92,419,197	-	90,706,880	1,712,317
メキシコ・ペソ	68,005,600	-	70,720,000	2,714,400	75,598,601	-	77,239,080	1,640,479
ルーマニア・レ イ	-	-	-	-	30,029,068	-	29,802,240	226,828
南アフリカ・ラ ンド	-	-	-	-	9,678,296	-	9,908,140	229,844
合計	99,423,370	-	102,597,000	3,173,630	241,134,450	-	240,630,806	502,454

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.3677円	1.3563円

(1万口当たり純資産額)

(13,677円)

(13,563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	インドネシア・ルピア		インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	8,250,000,000.000	8,809,515,000.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	6,692,880,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,583,490,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,320,440,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,943,400,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	5,000,000,000.000	5,403,350,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	13,101,840,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	14,300,000,000.000	14,410,110,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	12,500,000,000.000	13,018,375,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	6,100,000,000.000	6,154,839,000.000	
		11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	4,409,568,000.000	
		10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	2,180,000,000.000	2,733,131,400.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,467,534,400.000			
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	14,386,476,160.000			

	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,100,787,500.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	10,693,616,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20220515	11,060,000,000.000	11,548,299,000.000	
	5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	10,910,000,000.000	11,165,403,100.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,062,303,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	6,761,294,500.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	13,536,999,600.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	14,424,892,500.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	11,120,000,000.000	12,630,874,400.000	
	インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 213,359,418,560.000 (1,536,187,813)	
ウルグアイ・ペ ソ	9.875% Uruguay Government International Bond 20220620	5,300,000.000	5,485,500.000	
	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,891,000.000	
	ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 8,376,500.000 (21,025,015)	
オフショア・人 民元	3.29% China Government Bond 20231018	4,300,000.000	4,351,815.000	
	3.22% China Government Bond 20251206	4,200,000.000	4,233,516.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,845,648.000	
	3.19% China Government Bond 20240411	6,700,000.000	6,747,168.000	

	3.29% China Government Bond 20290523	5,400,000.000	5,457,240.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	6,800,000.000	6,846,104.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	7,000,000.000	6,987,400.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	4,500,000.000	4,495,005.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,478,940.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	1,600,000.000	1,565,440.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,300,000.000	6,070,554.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	6,000,000.000	5,725,320.000	
	2.36% China Government Bond 20230702	1,500,000.000	1,475,490.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 63,279,640.000 (984,631,198)	
コロンビア・ペソ		コロンビア・ペソ	コロンビア・ペソ	
	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	116,721,000.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	45,733,500.000	
	7% Colombian TES 20220504	4,335,000,000.000	4,636,976,100.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,650,000,000.000	4,482,273,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	5,090,000,000.000	5,420,850,000.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	4,310,000,000.000	4,982,575,500.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	3,174,255,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	3,000,000,000.000	3,293,880,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,300,000,000.000	2,521,122,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	2,200,000,000.000	2,407,064,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	1,050,000,000.000	1,107,130,500.000	
	コロンビア・ペソ 小計		コロンビア・ペソ 32,188,580,600.000 (920,593,406)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	

4.875% Thailand Government Bond 20290622	26,050,000.000	33,545,106.000	
3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	25,244,851.000	
3.85% Thailand Government Bond 20251212	22,610,000.000	26,016,648.700	
3.65% Thailand Government Bond 20211217	30,600,000.000	31,828,896.000	
3.65% Thailand Government Bond 20310620	22,700,000.000	27,403,440.000	
1.875% Thailand Government Bond 20220617	17,200,000.000	17,615,380.000	
3.4% Thailand Government Bond 20360617	20,100,000.000	24,568,632.000	
2.125% Thailand Government Bond 20261217	29,600,000.000	31,539,984.000	
2% Thailand Government Bond 20221217	24,000,000.000	24,777,120.000	
3.775% Thailand Government Bond 20320625	29,000,000.000	35,827,470.000	
2.875% Thailand Government Bond 20460617	24,900,000.000	28,577,232.000	
2.4% Thailand Government Bond 20231217	22,000,000.000	23,257,080.000	
2.875% Thailand Government Bond 20281217	20,000,000.000	22,479,600.000	
3.3% Thailand Government Bond 20380617	21,000,000.000	24,938,760.000	
1.45% Thailand Government Bond 20241217	30,000,000.000	30,807,300.000	
1.6% Thailand Government Bond 20291217	9,000,000.000	9,141,930.000	
1.6% Thailand Government Bond 20350617	12,000,000.000	11,931,120.000	
タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 429,500,549.700 (1,451,711,858)	
チェコ・コロナ 2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	チェコ・コロナ 12,600,000.000	チェコ・コロナ 14,064,120.000	

	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	10,311,400.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	10,200,000.000	11,157,780.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	17,491,845.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	17,900,000.000	18,125,719.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	12,000,000.000	11,858,160.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	9,900,000.000	9,912,276.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	13,000,000.000	12,481,040.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	12,000,000.000	13,767,840.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	20,000,000.000	22,068,000.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	10,000,000.000	10,135,000.000	
チェコ・コルナ 小計			チェコ・コルナ 151,373,180.000 (719,022,605)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	550,000,000.000	636,735,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000	711,360,000.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000	596,070,300.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	410,000,000.000	489,277,600.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	272,112,500.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	650,000,000.000	684,794,500.000	
チリ・ペソ 小計			チリ・ペソ 3,390,349,900.000 (466,512,147)	
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	

	9.5% Turkey Government Bond 20220112	1,660,000.000	1,587,972.600	
	8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000	729,881.000	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	2,441,118.000	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	628,857.200	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,426,282.600	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,225,921.200	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	2,326,338.300	
	9.2% Turkey Government Bond 20210922	2,010,000.000	1,942,343.400	
	11% Turkey Government Bond 20220302	2,400,000.000	2,336,400.000	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,678,643.000	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,827,097.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	1,700,000.000	1,480,428.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,373,974.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	1,906,740.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	1,400,000.000	1,501,346.000	
	トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 26,413,342.300 (377,974,928)	
	ドミニカ・ペソ 9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	ドミニカ・ペソ 11,000,000.000	ドミニカ・ペソ 11,275,000.000	
	ドミニカ・ペソ 小計		ドミニカ・ペソ 11,275,000.000 (20,520,500)	
	ハンガリー・ フォリント	ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	

	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	104,961,600.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	183,224,300.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20211027	89,000,000.000	91,121,760.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	142,783,200.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	138,032,700.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	119,636,000.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	145,000,000.000	155,122,450.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	160,000,000.000	168,241,600.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	65,000,000.000	70,928,000.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	40,438,800.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	152,044,480.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	139,431,250.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	169,988,250.000	
	ハンガリー・フォロント 小計		ハンガリー・フォロント 1,675,954,390.000 (585,578,464)	
フィリピン・ペソ	6.25% Philippine Government International Bond 20360114	フィリピン・ペソ 10,000,000.000	フィリピン・ペソ 12,834,800.000	
	フィリピン・ペソ 小計		フィリピン・ペソ 12,834,800.000 (28,108,212)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	ブラジル・リアル 13,310,000.000	ブラジル・リアル 15,014,079.300	

	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	10,690,000.000	12,436,211.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	7,250,000.000	8,546,590.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	4,300,000.000	5,154,195.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	500,000.000	607,755.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101	7,200,000.000	6,939,504.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	6,100,000.000	5,734,793.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	12,700,000.000	11,185,144.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	11,600,000.000	9,825,316.000	
	ブラジル・レアル 小計		ブラジル・レアル 75,443,587.800 (1,513,398,372)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 730,000.000	ペルー・ソル 856,421.400	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,391,422.400	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	2,153,492.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	1,900,000.000	2,245,648.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	1,250,000.000	1,328,762.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,400,000.000	1,397,382.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,965,000.000	2,611,013.400	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	2,471,164.850	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,395,104.000	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 17,850,411.050 (538,011,389)	

ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	3,610,000.000	4,026,196.900	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,740,000.000	4,073,121.800	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,640,000.000	3,971,021.600	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,200,000.000	3,315,680.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,169,530.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	5,500,000.000	5,913,765.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	5,450,000.000	6,108,414.500	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,820,000.000	1,938,263.600	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,530,000.000	2,823,986.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	4,500,000.000	4,989,330.000	
3.25% Poland Government Bond 20250725	3,550,000.000	3,981,538.000		
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 44,310,847.400 (1,251,781,439)		
マレーシア・リングgit		マレーシア・リングgit	マレーシア・リングgit	
	3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414	3,400,000.000	3,517,776.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	2,016,972.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,140,500.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,700,000.000	1,926,049.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	2,600,000.000	2,918,630.000	
3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	1,700,000.000	1,810,908.000		

3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	1,400,000.000	1,518,090.000	
3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	1,500,000.000	1,622,130.000	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	2,350,000.000	2,555,695.500	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,878,573.600	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,850,000.000	2,018,257.500	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,477,028.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,000,000.000	3,293,340.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,229,304.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	3,020,000.000	3,257,583.400	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,120,000.000	2,337,427.200	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,600,000.000	3,135,288.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,469,650.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,186,300.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,150,000.000	2,374,460.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	1,100,000.000	1,157,838.000	
マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 45,841,800.200 (1,175,383,757)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	18,900,000.000	19,422,585.000	
8% Mexican Bonos 20471107	14,500,000.000	16,231,300.000	
7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	10,334,700.000	
8% Mexican Bonos 20240905	22,000,000.000	24,510,640.000	
8% Mexican Bonos 20231207	22,750,000.000	25,015,672.500	
10% Mexican Bonos 20241205	24,150,000.000	28,818,919.500	

	7.5% Mexican Bonos 20270603	30,230,000.000	33,667,755.600	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	9,949,157.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	30,730,000.000	36,461,145.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	17,900,000.000	21,250,164.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	17,950,000.000	20,411,304.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	31,450,000.000	32,497,914.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	17,820,000.000	19,557,271.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	11,810,932.000	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 309,939,460.400 (1,531,100,935)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,535,090.700	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,221,357.500	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	2,396,436.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,105,074.700	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,606,336.000	
	3.4% Romania Government Bond 20220308	1,700,000.000	1,715,045.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,553,220.000	
	4% Romania Government Bond 20211027	1,000,000.000	1,014,940.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,854,384.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,000,000.000	1,079,220.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	1,400,000.000	1,376,438.000	
ルーマニア・レイ	小計		ルーマニア・レイ 17,457,541.900 (452,674,062)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	

8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	46,760,000.000	53,306,867.600	
7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	32,910,000.000	34,781,262.600	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	15,172,704.000	
7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	49,673,699.200	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	24,300,000.000	25,806,357.000	
8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	31,000,000.000	36,813,120.000	
7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	43,100,000.000	48,186,231.000	
7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	59,000,000.000	62,572,450.000	
7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	45,100,000.000	50,665,791.000	
7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	35,600,000.000	38,225,856.000	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215	49,000,000.000	50,572,900.000	
6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	38,000,000.000	39,966,500.000	
7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	45,000,000.000	48,847,500.000	
6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	51,000,000.000	54,290,520.000	
7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	51,000,000.000	57,400,500.000	
7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	59,540,800.000	
7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	50,000,000.000	54,072,500.000	
7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	55,000,000.000	61,352,500.000	
7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	43,479,980.000	
6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	47,000,000.000	47,723,800.000	

ロシア・ルーブル 小計			ロシア・ルーブル 932,451,838.400 (1,324,081,611)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	30,050,000.000	34,711,356.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,220,000.000	7,469,378.400	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	12,580,000.000	8,028,556.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	15,940,000.000	13,166,440.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	13,880,000.000	14,927,940.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	29,520,000.000	23,125,968.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	17,900,000.000	14,375,132.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	22,900,000.000	21,207,690.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	16,600,000.000	13,066,856.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	15,300,000.000	13,374,342.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	14,100,000.000	12,088,776.000	
9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	11,300,000.000	9,269,955.000		
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 184,812,389.400 (1,184,647,416)	
国債証券 合計			16,082,945,127 [16,082,945,127]	
合計			16,082,945,127 [16,082,945,127]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券 23銘柄	100%	9.7%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.1%
オフショア・人民元	国債証券 13銘柄	100%	6.1%
コロンビア・ペソ	国債証券 11銘柄	100%	5.7%
タイ・バーツ	国債証券 17銘柄	100%	9.0%
チェコ・コルナ	国債証券 11銘柄	100%	4.5%
チリ・ペソ	国債証券 6銘柄	100%	2.9%
トルコ・リラ	国債証券 15銘柄	100%	2.4%
ドミニカ・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ハンガリー・フォリント	国債証券 13銘柄	100%	3.6%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.2%
ブラジル・リアル	国債証券 9銘柄	100%	9.4%
ペルー・ソル	国債証券 9銘柄	100%	3.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	100%	7.8%
マレーシア・リングgit	国債証券 21銘柄	100%	7.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.5%
ルーマニア・レイ	国債証券 11銘柄	100%	2.8%
ロシア・ルーブル	国債証券 20銘柄	100%	8.2%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	100%	7.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### 「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	70,019,279	759,908,277
コール・ローン	1,420,564,515	4,443,029,250

投資証券	2	335,680,895,490	345,406,939,740
派生商品評価勘定		475,184,000	-
未収入金		-	68,413,210
未収配当金		3,568,936,872	4,621,562,149
流動資産合計		341,215,600,156	355,299,852,626
資産合計		341,215,600,156	355,299,852,626
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	57,802,500
前受金		435,400,000	104,127,400
未払金		652,682,110	713,041,408
未払解約金		151,273,000	33,654,000
その他未払費用		-	4,623
流動負債合計		1,239,355,110	908,629,931
負債合計		1,239,355,110	908,629,931
純資産の部			
元本等			
元本	1	104,354,428,940	130,880,999,900
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		235,621,816,106	223,510,222,795
元本等合計		339,976,245,046	354,391,222,695
純資産合計		339,976,245,046	354,391,222,695
負債純資産合計		341,215,600,156	355,299,852,626

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	84,070,307,149円	104,354,428,940円
期中追加設定元本額	26,476,296,710円	48,492,275,048円
期中一部解約元本額	6,192,174,919円	21,965,704,088円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	6,467,868,523円	5,691,649,149円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	88,304,145,289円	114,727,765,723円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	319,750,593円	332,368,636円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	147,017円	1,188,915円
iFree J-REITイ ンデックス	106,103,863円	133,232,767円
iFree 8資産バランス	609,288,680円	1,030,596,868円
DC・ダイワJ-REIT オープン	4,847,475,470円	5,330,291,237円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,194,356円	2,477,304円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,628,999円	4,631,249円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,391,836円	2,800,390円
	ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	60,130,254円	100,959,881円
	ダイワファンドラップ J - REITインデックス	1,230,384,800円	1,710,148,234円
	ダイワ J - REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	804,740,012円	262,363,036円
	ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	359,689,776円	412,746,462円
	ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,236,489,472円	1,137,780,049円
	計	104,354,428,940円	130,880,999,900円
2.	期末日における受益権の総数	104,354,428,940口	130,880,999,900口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 478,800,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 4,479,350,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	38,568,584,401	29,151,211,333
合計	38,568,584,401	29,151,211,333

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年3月16日から2019年9月9日まで、及び2020年3月17日から2020年9月7日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 不動産投信関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	3,803,600,000	-	4,279,000,000	475,400,000	8,966,475,000	-	8,909,250,000	57,225,000
合計	3,803,600,000	-	4,279,000,000	475,400,000	8,966,475,000	-	8,909,250,000	57,225,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.2579円	2.7077円
(1万口当たり純資産額)	(32,579円)	(27,077円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	6,295	637,054,000	
	サンケイリアルエステート	9,425	856,732,500	
	SOSILA物流リート投	8,581	1,142,989,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	12,799	7,999,375,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	47,129	3,694,913,600	
	森ヒルズリート	45,246	5,990,570,400	
	産業ファンド	54,443	9,707,186,900	
	アドバンス・レジデンス	36,586	11,231,902,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	25,128	4,668,782,400	
	A P I 投資法人	19,300	7,777,900,000	
	G L P 投資法人	110,750	18,019,025,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	16,808	5,311,328,000	
	日本プロロジスリート	58,280	20,135,740,000	
	星野リゾート・リート	5,861	2,822,071,500	
	O N E リート投資法人	6,004	1,472,180,800	
	イオンリート投資	39,067	4,434,104,500	
	ヒューリックリート投資法	31,009	4,248,233,000	
	日本リート投資法人	12,511	4,485,193,500	
	インベスコ・オフィス・Jリート	247,452	3,555,885,240	
	積水ハウス・リート投資	113,288	8,428,627,200	
	トーセイ・リート投資法人	8,521	907,486,500	
	ケネディクス商業リート	14,163	3,045,045,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	8,215	990,729,000	
	サムティ・レジデンシャル	7,414	736,951,600	
	野村不動産マスターF	124,555	16,241,972,000	
	いちごホテルリート投資	6,735	467,409,000	
	ラサールロジポート投資	42,923	7,408,509,800	
	スターアジア不動産投	39,573.9	1,721,464,650	
	マリモ地方創生リート	3,609	368,839,800	
	三井不ロジパーク	11,036	5,793,900,000	
	大江戸温泉リート	6,217	391,671,000	
	投資法人みらい	41,598	1,582,803,900	
森トラスト・ホテルリート投	8,342	875,910,000		
三菱地所物流REIT	8,667	3,648,807,000		
CREロジスティクスファンド	10,511	1,576,650,000		

ザイマックス・リート	5,901	510,436,500	
タカラレーベン不動産投	11,574	981,475,200	
伊藤忠アドバンスロジ	12,162	1,744,030,800	
日本ビルファンド	37,299	23,199,978,000	
ジャパンリアルエステイト	38,517	22,070,241,000	
日本リートファンド	72,796	11,552,725,200	
オリックス不動産投資	76,744	11,895,320,000	
日本プライムリアルティ	23,980	7,589,670,000	
プレミアム投資法人	34,789	4,192,074,500	
東急リアル・エステート	25,824	3,571,459,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	26,746	2,784,258,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	82,373	9,398,759,300	
森トラスト総合リート	27,528	3,743,808,000	
インヴィンシブル投資法人	161,052	4,960,401,600	
フロンティア不動産投資	12,782	4,428,963,000	
平和不動産リート	23,986	2,856,732,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	25,166	7,056,546,400	
福岡リート投資法人	19,920	2,675,256,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	11,915	7,315,810,000	
いちごオフィスリート投資法人	31,955	2,367,865,500	
大和証券オフィス投資法人	8,206	4,841,540,000	
阪急阪神リート投資法人	17,398	2,037,305,800	
スタートアップリート投資法人	5,998	1,194,201,800	
大和ハウスリート投資法人	54,956	14,563,340,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	124,079	6,011,627,550	
大和証券リビング投資法人	48,592	5,107,019,200	
ジャパンエクセレント投資法人	35,740	4,378,150,000	
投資証券 合計		345,406,939,740	
合計		345,406,939,740	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本プロロジスリート	3,500口	野村不動産マスターF	4,000口
日本ビルファンド	2,300口	ジャパンリアルエステイト	2,300口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	33,874,213	48,519,710
金銭信託	13,143,036	62,073,225
コール・ローン	266,648,425	362,929,529
投資信託受益証券	177,901,699	26,132,652
投資証券	24,277,172,699	26,170,300,071
派生商品評価勘定	17,716,516	9,397,363
未収入金	1,748,342	701,114
未収配当金	20,654,985	29,200,354
差入委託証拠金	72,396,468	240,195,819
流動資産合計	24,881,256,383	26,949,449,837
資産合計	24,881,256,383	26,949,449,837
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	332,757	7,181,605
未払金	24,932,719	26,196,319
未払株式払込金	701,386	-
未払解約金	12,567,200	12,817,000
その他未払費用	-	474
流動負債合計	38,534,062	46,195,398
負債合計	38,534,062	46,195,398
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,095,442,480	12,710,434,181
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,747,279,841	14,192,820,258
元本等合計	24,842,722,321	26,903,254,439
純資産合計	24,842,722,321	26,903,254,439
負債純資産合計	24,881,256,383	26,949,449,837

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <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>(3)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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1. 1 期首	2018年9月8日	2019年9月10日
期首元本額	8,231,121,083円	10,095,442,480円
期中追加設定元本額	2,835,957,978円	5,387,342,068円
期中一部解約元本額	971,636,581円	2,772,350,367円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	4,757,864,319円	5,923,738,240円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	744,491,511円	1,095,052,315円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	337,120,998円	350,937,429円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	230,353,697円	256,912,078円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,218,540円	2,351,557円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	162,858円	1,557,802円
iFree 外国REITイ ンデックス	88,594,922円	118,408,376円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	784,640,527円	1,321,841,726円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	- 円	29,687,634円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,079,374,904円	2,645,406,694円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,785,747円	3,233,380円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,019,823円	6,024,373円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,604,642円	3,635,506円

ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	- 円	249,211,041円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	250,529,311円	254,423,431円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	33,216,198円	51,363,816円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	564,064,704円	172,589,274円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	213,399,779円	205,187,585円
計	10,095,442,480円	12,710,434,181円
2. 期末日における受益権の総数	10,095,442,480口	12,710,434,181口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用してしております。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しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	6,580,740	3,191
投資証券	2,180,917,198	4,945,220,898
合計	2,187,497,938	4,945,224,089

（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（2018年12月1日から2019年9月9日まで、及び2019年12月3日から2020年9月7日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種 類	2019年9月9日 現在			2020年9月7日 現在		
	契約額等	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等	時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)			うち		

		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	365,176,630	-	380,125,718	14,949,088	721,672,433	-	723,152,137	1,479,704
合計	365,176,630	-	380,125,718	14,949,088	721,672,433	-	723,152,137	1,479,704

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2019年9月9日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	250,013,229	-	252,447,900	2,434,671	433,116,146	-	433,852,200	736,054
アメリカ・ドル	121,722,775	-	122,751,000	1,028,225	309,171,136	-	310,460,400	1,289,264
イギリス・ポンド	2,560,520	-	2,624,000	63,480	-	-	-	-
カナダ・ドル	7,936,247	-	8,105,000	168,753	-	-	-	-
ユーロ	117,793,687	-	118,967,900	1,174,213	123,945,010	-	123,391,800	553,210
合計	250,013,229	-	252,447,900	2,434,671	433,116,146	-	433,852,200	736,054

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2019年9月9日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	2,4608円	2,1166円
(1万口当たり純資産額)	(24,608円)	(21,166円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

該当事項はありません。

### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	3,000,000	245,700,000	
		アメリカ・ドル 小計		245,700,000 (26,132,652)	
投資信託受益証券 合計				26,132,652 [26,132,652]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26,300	350,316,000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	61,239,000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	254,551,560	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	25,400	240,538,000	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	30,700	4,976,470.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	66,747	4,688,309.280	
BOSTON PROPERTIES INC	31,500	2,766,015.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	32,467	1,215,889.150	
VORNADO REALTY TRUST	34,664	1,274,941.920	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	16,300	386,799.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,700	433,832.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,800	194,112.000	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	12,900	841,725.000	
EQUITY RESIDENTIAL	76,300	4,433,793.000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,800	486,180.000	
EPR PROPERTIES	16,100	553,035.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	26,390.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	75,051.000	
GLOBAL NET LEASE INC	19,833	347,275.830	
EQUINIX INC	19,200	14,441,856.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,529	402,822.260	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	58,534.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,100	110,902.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,300	454,938.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25,700	310,327.500	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,200	199,584.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	10,282.500	
HOST HOTELS & RESORTS INC	153,900	1,837,566.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	55,708	1,596,034.200	
CORESITE REALTY CORP	8,600	1,003,362.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	32,600	783,704.000	
RLJ LODGING TRUST	35,871	360,503.550	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	19,140.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	43,900	827,954.000	
CYRUSONE INC	24,800	1,931,176.000	
KIMCO REALTY CORP	94,400	1,195,104.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,000	93,870.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	47,650	1,266,537.000	
WHITESTONE REIT	8,500	56,185.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	44,691	1,682,616.150	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27,200	421,872.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	51,680	547,291.200	
COLONY CAPITAL INC	105,011	287,730.140	

INVITATION HOMES INC	118,697	3,403,042.990	
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	698,669.600	
CLIPPER REALTY INC	1,400	9,226.000	
GLADSTONE LAND CORP	4,500	68,850.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	43,200	1,639,008.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14,300	312,312.000	
VICI PROPERTIES INC	102,300	2,340,624.000	
RETAIL VALUE INC	2,815	35,581.600	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,500	140,125.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	17,056.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,100	99,889.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,600	541,512.000	
SAFEHOLD INC	2,600	151,918.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	20,028.260	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22,400	153,664.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,100	367,428.000	
CORECIVIC INC	25,224	239,375.760	
COREPOINT LODGING INC	6,700	38,726.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	46,342.000	
STORE CAPITAL CORP	48,600	1,356,426.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22,400	135,520.000	
LIFE STORAGE INC	10,000	1,077,000.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,100	264,115.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	243,795.480	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9,200	62,192.000	
PARAMOUNT GROUP INC	40,700	306,878.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,200	194,764.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	26,800	1,267,908.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,700	288,903.000	
STAG INDUSTRIAL INC	32,500	1,050,075.000	
VENTAS INC	81,379	3,626,248.240	
CARETRUST REIT INC	19,603	381,670.410	
GEO GROUP INC/THE	24,100	265,582.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64,300	838,472.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10,600	251,538.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	690,100.580	
UMH PROPERTIES INC	8,600	124,700.000	
IRON MOUNTAIN INC	62,200	1,875,952.000	
TERRENO REALTY CORP	14,400	832,176.000	

VEREIT INC	235,208	1,634,695.600	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,320	814,010.400	
SUN COMMUNITIES INC	21,400	3,117,766.000	
ACADIA REALTY TRUST	17,011	206,853.760	
ALEXANDER'S INC	400	106,428.000	
PROLOGIS INC	160,519	16,173,894.440	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,500	4,576,825.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,700	388,640.000	
SAUL CENTERS INC	2,400	67,800.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	4,201.220	
MACK-CALI REALTY CORP	20,200	267,246.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	21,300	1,984,947.000	
COUSINS PROPERTIES INC	31,606	943,123.040	
SITE CENTERS CORP	31,878	264,587.400	
DUKE REALTY CORP	80,400	3,068,868.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,300	1,095,102.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,267	3,199,517.420	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27,800	1,155,924.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,400	1,263,724.000	
GETTY REALTY CORP	7,703	224,465.420	
WELLTOWER INC	91,100	5,568,032.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	117,500	3,331,125.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	22,100	815,932.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	36,500	322,112.500	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	28,800	852,768.000	
EQUITY COMMONWEALTH	25,875	808,593.750	
KILROY REALTY CORP	23,100	1,337,490.000	
LTC PROPERTIES INC	8,400	313,236.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	60,000	676,200.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	24,928	2,950,228.800	
MACERICH CO/THE	21,979	181,766.330	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,800	2,611,676.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9,600	614,016.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	37,500	1,404,375.000	
REALTY INCOME CORP	74,917	4,822,407.290	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24,000	580,080.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	8,686.000	
PUBLIC STORAGE	32,800	6,958,192.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,300	539,177.000	

REGENCY CENTERS CORP	37,020	1,537,440.600	
RPT REALTY	17,800	114,454.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,600	103,312.000	
SL GREEN REALTY CORP	16,700	821,473.000	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49,000	193,305.000	
TAUBMAN CENTERS INC	13,300	508,858.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	58,740.000	
UDR INC	64,400	2,273,964.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,600	178,126.000	
WP CAREY INC	37,600	2,633,880.000	
WASHINGTON REIT	17,800	390,710.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25,900	484,848.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,130	3,299.600	
AGREE REALTY CORP	11,700	776,997.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	49,548	1,575,626.400	
CUBESMART	42,200	1,347,868.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	390,157.820	
DIGITAL REALTY TRUST INC	58,478	8,489,836.040	
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	9,396.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	28,200	3,055,470.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	52,841.250	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,460	172,544.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	18,950	238,580.500	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21,000	304,920.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,223	42,659.370	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	29,300	1,049,526.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,300	117,180.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	245,160.180	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	115,300	2,121,520.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	92,610.000	
DOUGLAS EMMETT INC	35,000	973,700.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46,700	322,697.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320,562	238,818.690	
ARA US HOSPITALITY TRUST	87,800	31,608.000	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	12,330.000	
PRIME US REIT	99,000	78,705.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 185,261,622.380 (19,704,426,157)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	565,520	452,416.000	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	10,000	7,000.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129,570	89,273.730	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	117,644.020	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	84,413.670	
	REGIONAL REIT LTD	81,310	57,892.720	
	NEWRIVER REIT PLC	69,330	38,894.130	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183,290	242,309.380	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135,490	149,851.940	
	LXI REIT PLC	118,038	129,369.640	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75,200	81,216.000	
	AEW UK REIT PLC	25,610	19,745.310	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	150,000	98,250.000	
	RDI REIT PLC	41,036	36,316.860	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	159,931	870,184.570	
	SEGRO PLC	253,460	2,325,748.960	
	HAMMERSON PLC	31,984	84,821.560	
	UNITE GROUP PLC/THE	84,760	803,524.800	
	BRITISH LAND CO PLC	201,570	711,138.960	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53,581	312,805.870	
	DERWENT LONDON PLC	22,890	620,319.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283,370	430,722.400	
	WORKSPACE GROUP PLC	26,460	143,942.400	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	43,930	336,064.500		
SHAFTESBURY PLC	47,850	255,279.750		
BIG YELLOW GROUP PLC	34,960	367,779.200		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	193,150	443,858.700		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	34,899.200		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	357,260	551,609.440		
ELITE COMMERCIAL REIT	51,300	33,858.000		
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 9,931,150.710 (1,399,597,070)	
イスラエル・シュケル			イスラエル・シュケル	
REIT 1 LTD	28,840	377,515.600		
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 377,515.600	

			(11,918,167)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	63,380	171,126.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	396,284	348,729.920	
	RURAL FUNDS GROUP	78,595	176,838.750	
	WAYPOINT REIT	159,830	426,746.100	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	98,668	493,340.000	
	CENTURIA OFFICE REIT	84,950	174,147.500	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241,860	532,092.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57,547	192,206.980	
	NATIONAL STORAGE REIT	206,195	387,646.600	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	75,292.800	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	130,092.050	
	SCENTRE GROUP	1,164,910	2,539,503.800	
	ARENA REIT	59,890	152,719.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	120,645.000	
	BWP TRUST	105,550	421,144.500	
	DEXUS	242,530	2,194,896.500	
	GPT GROUP	433,000	1,636,740.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	107,400	358,716.000	
	MIRVAC GROUP	874,460	1,845,110.600	
STOCKLAND	530,010	1,945,136.700		
ABACUS PROPERTY GROUP	81,120	227,136.000		
GOODMAN GROUP	364,610	6,617,671.500		
VICINITY CENTRES	878,900	1,217,276.500		
CHARTER HALL GROUP	105,060	1,314,300.600		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,660	274,436.000		
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 23,973,691.900 (1,857,961,123)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	116,459.000	
	SLATE GROCERY REIT	3,100	32,674.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,200	175,746.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	19,329.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	73,374.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19,700	227,732.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,700	173,313.000	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	65,632.000		

	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8,500	144,755.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,200	470,642.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,900	162,410.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,500	167,400.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24,700	337,649.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	33,700	415,858.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	63,252.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	165,886.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16,300	341,648.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	18,600	815,610.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	154,273.200	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32,566	339,989.040	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34,300	512,442.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	103,626.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	138,744.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	7,400	253,006.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	123,120.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,300	501,144.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 6,095,713.240 (495,764,359)	
シンガポール・ ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	266,483	775,465.530	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	126,200	55,528.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455,000	427,700.000	
	AIMS APAC REIT	89,000	105,020.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	53,592.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	548,890	751,979.300	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	64,930.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	143,900	93,535.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	645,475	1,065,033.750	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	672,616	2,206,180.480	
	CAPITALAND MALL TRUST	641,500	1,238,095.000	
	SUNTEC REIT	506,300	713,883.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	676,100	1,386,005.000	
	KEPPEL REIT	433,400	463,738.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	417,456	375,710.400	
	ESR-REIT	459,902	183,960.800	

	CDL HOSPITALITY TRUSTS	161,600	179,376.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	164,168	433,403.520	
	STARHILL GLOBAL REIT	308,800	135,872.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	179,396	204,511.440	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86,300	332,255.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467,200	54,195.200	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	343,180	1,053,562.600	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244,500	156,480.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	468,484	927,598.320	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	100,155.000	
	SPH REIT	166,600	145,775.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202,100	97,008.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	82,275.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541,063	200,193.310	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 14,063,016.650 (1,095,790,258)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	214,002.000	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	320,920	332,152.200	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76,800	233,472.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	248,220	564,700.500	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	219,820	368,198.500	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,712,525.200 (122,257,174)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	28,920	353,402.400	ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	11,980	102,165.440	
	WERELDHAVE NV	6,470	45,937.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	25,690	993,432.300	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	8,230	79,584.100	
	NSI NV	3,231	95,314.500	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	92,250.000	
	ICADE	5,240	275,624.000	
	ALTAREA	740	90,280.000	
	GECINA SA	10,241	1,137,775.100	
	KLEPIERRE	37,740	521,378.100	
	COVIVIO	8,992	545,364.800	

	MERCIALYS	4,030	22,406.800	
	AEDIFICA	4,964	497,392.800	
	COFINIMMO	4,500	543,600.000	
	BEFIMMO	4,420	170,833.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,610	100,037.000	
	RETAIL ESTATES	1,940	110,580.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	24,150	709,285.500	
	MONTEA	2,150	218,870.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	19,500.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	44,331.300	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	45,533	316,909.680	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66,100	469,971.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82,050	115,198.200	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	132,513.600	
ユーロ 小計			ユーロ 7,803,936.620 (982,281,502)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 39,900,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	17,960	91,057,200.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 130,957,200.000 (11,746,861)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349,000	香港・ドル 1,291,300.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	712,170.000	
	FORTUNE REIT	311,000	2,074,370.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	696,000.000	
	LINK REIT	461,400	29,068,200.000	
	CHAMPION REIT	431,000	1,767,100.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 35,609,140.000 (488,557,400)	
投資証券 合計			26,170,300,071 [26,170,300,071]	
合計			26,196,432,723 [26,196,432,723]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 157銘柄	0.1%	99.9%	75.4%
イギリス・ポンド	投資証券 30銘柄	-%	100%	5.3%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	7.1%
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	4.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	3.7%
韓国・ウォン	投資証券 2銘柄	-%	100%	0.0%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.9%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年9月8日から2021年3月7日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### 【中間財務諸表】

## iFree 8資産バランス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2021年3月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		21,495,454
コール・ローン		323,159,746
親投資信託受益証券		27,063,632,706
流動資産合計		27,408,287,906
<b>資産合計</b>		
27,408,287,906		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		32,855,410
未払受託者報酬		2,694,440
未払委託者報酬		26,944,793
未払利息		312
その他未払費用		1,010,336
流動負債合計		63,505,291
<b>負債合計</b>		
63,505,291		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 20,650,977,445
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		6,693,805,170
（分配準備積立金）		537,711,628
元本等合計		27,344,782,615
<b>純資産合計</b>		
27,344,782,615		
<b>負債純資産合計</b>		
27,408,287,906		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
<b>営業収益</b>	
受取利息	135
有価証券売買等損益	2,638,139,868
営業収益合計	2,638,140,003
<b>営業費用</b>	
支払利息	40,200
受託者報酬	2,694,440
委託者報酬	26,944,793
その他費用	1,011,380
営業費用合計	30,690,813
営業利益又は営業損失（ ）	2,607,449,190
経常利益又は経常損失（ ）	2,607,449,190
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,607,449,190
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	125,549,444
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,648,948,547
剰余金増加額又は欠損金減少額	995,919,998
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	995,919,998
剰余金減少額又は欠損金増加額	432,963,121
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	432,963,121
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,693,805,170

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年3月7日現在
1. 1 期首元本額	18,838,006,602円
期中追加設定元本額	4,019,672,590円
期中一部解約元本額	2,206,701,747円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	20,650,977,445口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年3月7日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年3月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3241円 (13,241円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年3月7日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,035,413,920

株式	2 3	166,472,460,650
派生商品評価勘定		30,129,500
未収配当金		234,256,757
未収利息		1,133,204
その他未収収益	4	29,082,759
流動資産合計		181,802,476,790
資産合計		181,802,476,790
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		21,314,600
前受金		8,254,200
未払解約金		116,956,070
未払利息		14,598
受入担保金		12,762,861,510
流動負債合計		12,909,400,978
負債合計		12,909,400,978
純資産の部		
元本等		
元本	1	133,369,245,633
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		35,523,830,179
元本等合計		168,893,075,812
純資産合計		168,893,075,812
負債純資産合計		181,802,476,790

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	145,237,517,692円
期中追加設定元本額	7,795,345,365円
期中一部解約元本額	19,663,617,424円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス	3,053,187,343円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	6,358,254,605円
デックスファンドV A	
適格機関投資家専用・ダイ	929,122円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドV A 2	
ダイワ国内重視バランスファ	27,283,689円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	558,806,286円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	26,962,746円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	789,444,629円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	144,559,543円
D-I's TOPIXイン デックス	32,029,980円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	44,996,462円
iFree TOPIXイン デックス	2,931,383,354円
iFree 8資産バランス	2,640,103,371円
iFree 年金バランス	287,396,188円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,062,661,535円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,846,637,211円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,691,573,276円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,404,794,976円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,353,724,841円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	48,657,335円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	39,911,630円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	899,469,297円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,862,841円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,946,508円
ダイワつみたてインデックス バランス70	12,120,526円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	122,070,962円

	ダイワ世界バランスファンド 60VA		131,346,461円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA		6,903,259,425円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)		606,155,183円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)		86,777,082円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)		157,868,952円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド		144,913,259円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス		10,250,226,981円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		991,367,139円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス		2,177,857,252円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX		1,198,589,252円
	ダイワライフスタイル25		161,650,926円
	ダイワライフスタイル50		624,857,481円
	ダイワライフスタイル75		495,551,413円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)		11,043,056,571円
	計		133,369,245,633円
2.	期末日における受益権の総数		133,369,245,633口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行って おります。	
		株式	12,193,924,750円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとお り差入を行っております。	
		株式	864,020,000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27,460,028円が含まれております。
--------------	---

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （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3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,373,775,800	-	2,382,660,000	8,884,200
合計	2,373,775,800	-	2,382,660,000	8,884,200

## （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3月7日現在
1口当たり純資産額	1.2664円
(1万口当たり純資産額)	(12,664円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	303,418,476
コール・ローン	4,150,655,635
株式	167,623,740,728
投資証券	3,862,265,371
派生商品評価勘定	111,793,507
未収入金	602,390
未収配当金	285,263,960
差入委託証拠金	2,666,278,106
流動資産合計	179,004,018,173
資産合計	179,004,018,173
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,426,789
未払解約金	61,838,300
未払利息	4,030
流動負債合計	145,269,119
負債合計	145,269,119

純資産の部		
元本等		
元本	1	54,959,066,918
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		123,899,682,136
元本等合計		178,858,749,054
純資産合計		178,858,749,054
負債純資産合計		179,004,018,173

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7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)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。</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>(3)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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	53,173,758,315円
期中追加設定元本額	5,276,718,770円
期中一部解約元本額	3,491,410,167円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックス V A	402,385,580円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	5,225,597円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	93,152,943円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	10,632,892円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	309,394,374円
外国株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	25,712,894円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	536,036,557円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,476,256,718円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマ ー ジ ング プラス(為替 ヘッ ジ なし)	638,307,018円
D-I's 外国株式インデッ クス	10,698,279円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	11,310,057円

i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	2,649,036,056円
i F r e e 8資産バランス	1,029,977,553円
i F r e e 年金バランス	109,542,099円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	34,041,679,499円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	555,620,616円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	960,942,704円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	726,784,703円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,554,324,162円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	11,527,877円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	8,491,426円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	512,245,866円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	2,099,717円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	2,062,630円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	2,592,310円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	139,906,573円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	252,260,918円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	2,014,478,062円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A(適格機関投資家専 用)	101,578,737円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	251,457,589円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	234,082,341円

ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	817,236,747円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	196,765,136円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,416,030,246円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,724,439,159円
ダイワライフスタイル25	15,593,832円
ダイワライフスタイル50	60,979,464円
ダイワライフスタイル75	48,217,987円
計	54,959,066,918円
2. 期末日における受益権の総数	54,959,066,918口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				

株価指数 先物取引				
買 建	7,299,350,600	-	7,288,168,046	11,182,554
合計	7,299,350,600	-	7,288,168,046	11,182,554

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	4,086,168,428	-	4,125,717,700	39,549,272
アメリカ・ドル	3,069,116,530	-	3,106,080,000	36,963,470
イギリス・ポンド	137,056,996	-	137,898,800	841,804
オーストラリア・ドル	97,513,344	-	98,164,200	650,856
カナダ・ドル	143,780,558	-	145,469,700	1,689,142
スイス・フラン	161,740,345	-	160,287,000	1,453,345
ユーロ	476,960,655	-	477,818,000	857,345
合計	4,086,168,428	-	4,125,717,700	39,549,272

## (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3月7日現在
1口当たり純資産額	3.2544円
(1万口当たり純資産額)	(32,544円)

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・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3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	342,880,687
コール・ローン	139,658,866
株式	12,245,620,439
投資証券	1,165,577,035
派生商品評価勘定	16,809,002
未収配当金	9,329,974
差入委託証拠金	173,497,164
流動資産合計	14,093,373,167
資産合計	14,093,373,167
負債の部	

流動負債		
派生商品評価勘定		2,879,676
未払金		80,495,321
未払解約金		42,188,633
未払利息		134
流動負債合計		125,563,764
負債合計		125,563,764
純資産の部		
元本等		
元本	1	7,890,700,241
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,077,109,162
元本等合計		13,967,809,403
純資産合計		13,967,809,403
負債純資産合計		14,093,373,167

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	7,158,803,351円
期中追加設定元本額	1,213,709,240円
期中一部解約元本額	481,812,350円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国株式インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投 資家専用)	26,109,064円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	252,386,554円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマー ジングプラス(為替 ヘッジなし)	300,248,546円
D-I's 新興国株式イン デックス	139,313,430円
iFree 新興国株式イン デックス	3,053,578,902円
iFree 8資産バランス 新興国株式ファン ダメンタル・イン デックスファンド (為替ヘッジなし/適格機関 投資家専用)	1,951,173,014円 556,713,645円
DCダイワ新興国株式ファン ダメンタル・イン デックス ファンド	1,140,066,033円
ダイワ・インデックスセ レクト 新興国株式	381,062,693円
ダイワ・ノーロード 新興 国 株式 ファンド	90,048,360円
計	7,890,700,241円
2. 期末日における受益権の総数	7,890,700,241口

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	529,854,279	-	543,563,513	13,709,234
合計	529,854,279	-	543,563,513	13,709,234

#### （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	81,769,908	-	81,990,000	220,092
アメリカ・ドル	81,769,908	-	81,990,000	220,092
合計	81,769,908	-	81,990,000	220,092

## (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3月7日現在
1口当たり純資産額	1.7702円
(1万口当たり純資産額)	(17,702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

	2021年3月7日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		129,982,373
国債証券		24,528,621,140
地方債証券		1,557,354,400
特殊債券		831,284,900
社債券		927,708,900
未収利息		59,514,509
前払費用		5,020,718
流動資産合計		28,039,486,940
資産合計		28,039,486,940
負債の部		
流動負債		
未払利息		126
流動負債合計		126
負債合計		126
純資産の部		
元本等		
元本	1	21,796,816,170
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,242,670,644
元本等合計		28,039,486,814
純資産合計		28,039,486,814
負債純資産合計		28,039,486,940

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7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3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	17,672,155,283円
期中追加設定元本額	4,384,972,743円
期中一部解約元本額	260,311,856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	427,807,290円
ド(FOFs用)(適格機関投資	
家専用)	
iFree 日本債券イン	1,815,897,924円
デックス	
iFree 8資産バランス	2,618,538,381円
ダイワ・ライフ・バランス3	7,407,729,044円
0	
ダイワ・ライフ・バランス5	4,741,424,371円
0	
ダイワ・ライフ・バランス7	1,506,550,397円
0	
DCダイワ・ワールドアセッ	1,156,406,975円
ト(六つの羽/安定コース)	
DCダイワ・ワールドアセッ	861,619,567円
ト(六つの羽/6分散コー	
ス)	
DCダイワ・ワールドアセッ	295,446,114円
ト(六つの羽/成長コース)	

ダイワつみたてインデックス 日本債券	435,142,730円
ダイワつみたてインデックス バランス30	29,659,169円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,251,336円
ダイワつみたてインデックス バランス70	5,346,080円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	295,016,664円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	189,980,128円
計	21,796,816,170円
2. 期末日における受益権の総数	21,796,816,170口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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3月7日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2021年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.2864円
(1万口当たり純資産額)	(12,864円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2021年3月7日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		1,068,392,053
コール・ローン		1,134,905,638
国債証券		214,744,968,686
派生商品評価勘定		7,082,828
未収利息		1,210,495,233
前払費用		32,344,133
流動資産合計		218,198,188,571
資産合計		218,198,188,571
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		246,875
未払金		548,822,764
未払解約金		36,020,174
未払利息		1,100
流動負債合計		585,090,913
負債合計		585,090,913
純資産の部		
元本等		
元本	1	71,666,126,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		145,946,970,659
元本等合計		217,613,097,658
純資産合計		217,613,097,658
負債純資産合計		218,198,188,571

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7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	2021年3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	69,294,023,744円
期中追加設定元本額	7,350,204,330円
期中一部解約元本額	4,978,101,075円

## 期末元本額の内訳

## ファンド名

ダイワ外国債券インデックス V A	574,365,265円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	11,453,926円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	100,821,503円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	26,424,146円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	337,537,082円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	121,063,234円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	480,260,348円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,968,373,386円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	691,501,089円
D-I's 外国債券インデッ クス	894,745円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,999,131円
iFree 外国債券イン デックス	1,286,122,252円
iFree 8資産バランス	1,112,471,222円
iFree 年金バランス	120,037,737円
DCダイワ外国債券インデッ クス	48,988,110,867円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	859,642,425円

ダイワ・ライフ・バランス50	503,864,995円
ダイワ・ライフ・バランス70	318,840,580円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	492,277,311円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	366,465,099円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	125,535,360円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	22,257,986円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,993,506円
ダイワつみたてインデックス外国債券	187,662,804円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,438,469円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,090,290円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,132,161円
ダイワ世界バランスファンド40VA	175,496,970円
ダイワ世界バランスファンド60VA	134,530,786円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,234,482,404円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	248,948,277円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,364,663円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	33,796,155円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,021,565,860円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,851,842,802円
ダイワライフスタイル25	33,801,888円

ダイワライフスタイル50	62,309,205円
ダイワライフスタイル75	17,351,070円
計	71,666,126,999円
2. 期末日における受益権の総数	71,666,126,999口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	1,142,450,877	-	1,149,286,830	6,835,953
アメリカ・ドル	489,956,963	-	496,669,810	6,712,847
イギリス・ポンド	42,240,476	-	42,571,960	331,484
ユーロ	610,253,438	-	610,045,060	208,378

合計	1,142,450,877	-	1,149,286,830	6,835,953
----	---------------	---	---------------	-----------

## (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3月7日現在
1口当たり純資産額	3.0365円
(1万口当たり純資産額)	(30,365円)

## 「ダイワ新興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3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	269,094,408
コール・ローン	235,514,962
国債証券	18,174,825,396
派生商品評価勘定	156,460
未収利息	248,580,271

前払費用		19,818,055
流動資産合計		18,947,989,552
資産合計		18,947,989,552
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,688,845
未払金		106,172,395
未払解約金		13,183,764
未払利息		228
流動負債合計		121,045,232
負債合計		121,045,232
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,392,462,973
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,434,481,347
元本等合計		18,826,944,320
純資産合計		18,826,944,320
負債純資産合計		18,947,989,552

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7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	2021年3月7日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>2020年9月8日</p> <p>12,256,994,427円</p> <p>1,500,586,719円</p> <p>365,118,173円</p>
<p>期末元本額の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）</p> <p>ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）</p> <p>ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）</p>	<p>104,412,813円</p> <p>258,443,675円</p> <p>372,126,930円</p>

D - I ' s 新興国債券イン デックス	71,078,371円
i F r e e 新興国債券イン デックス	3,391,608,147円
i F r e e 8資産バランス D Cダイワ新興国債券イン デックスファンド	2,364,710,730円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	6,631,852,736円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	165,285,564円
計	32,944,007円
2. 期末日における受益権の総数	13,392,462,973円
	13,392,462,973口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2021年3月7日 現在		
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)
		1年超	
市場取引以外の取引			

為替予約取引				
買 建	222,150,845	-	220,618,460	1,532,385
チェコ・コルナ	8,229,184	-	8,199,700	29,484
トルコ・リラ	16,872,110	-	16,614,400	257,710
ハンガリー・	43,160,644	-	42,366,350	794,294
フォリント				
ポーランド・	63,748,798	-	63,205,800	542,998
ズロチ				
マレーシア・	18,490,500	-	18,550,000	59,500
リングット				
メキシコ・ペソ	12,097,482	-	12,051,390	46,092
ルーマニア・	53,210,840	-	53,307,800	96,960
レイ				
南アフリカ・	6,341,287	-	6,323,020	18,267
ランド				
合計	222,150,845	-	220,618,460	1,532,385

(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3月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4058円 (14,058円)

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年3月7日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		6,294,657,961
投資証券	2	417,240,598,510
派生商品評価勘定		1,067,375,740
未収入金		149,117,650
未収配当金		5,010,530,755
流動資産合計		429,762,280,616
資産合計		429,762,280,616
負債の部		
流動負債		
前受金		1,178,414,340
未払金		1,307,543,050
未払解約金		36,880,000
未払利息		6,110
流動負債合計		2,522,843,500
負債合計		2,522,843,500
純資産の部		
元本等		
元本	1	139,212,494,426
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		288,026,942,690
元本等合計		427,239,437,116
純資産合計		427,239,437,116
負債純資産合計		429,762,280,616

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	130,880,999,900円
期中追加設定元本額	21,751,304,851円
期中一部解約元本額	13,419,810,325円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - R E I Tオープン	5,616,058,597円
ダイワJ - R E I Tオープン （毎月分配型）	122,614,321,996円

ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	354,444,328円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	2,334,394円
iFree J-REITイ ンデックス	329,844,795円
iFree 8資産バランス	1,115,432,745円
DC・ダイワJ-REIT オープン	5,470,254,697円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,703,410円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,115,512円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	101,677,586円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,714,730,170円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	384,973,893円
ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	446,084,927円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,054,517,376円
計	139,212,494,426円
2. 期末日における受益権の総数	139,212,494,426口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。  投資証券 5,282,450,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 不動産投信関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	8,912,895,660	-	9,980,850,000	1,067,954,340
合計	8,912,895,660	-	9,980,850,000	1,067,954,340

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2021年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.0690円
(1万口当たり純資産額)	(30,690円)

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年3月7日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		543,300,905
コール・ローン		641,764,659
投資信託受益証券		101,978,448
投資証券		33,334,032,214
派生商品評価勘定		15,496,581
未収入金		94,770,494
未収配当金		42,921,171
差入委託証拠金		193,812,472
流動資産合計		34,968,076,944
資産合計		34,968,076,944
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		7,785,744
未払金		673,796,870
未払株式払込金		7,055,961
未払解約金		18,458,900
未払利息		622
流動負債合計		707,098,097
負債合計		707,098,097
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,377,184,711
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		19,883,794,136
元本等合計		34,260,978,847
純資産合計		34,260,978,847
負債純資産合計		34,968,076,944

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年9月8日 至 2021年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年3月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日
期首元本額	12,710,434,181円
期中追加設定元本額	2,665,948,467円
期中一部解約元本額	999,197,937円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国	6,089,861,400円
REITインデックス（為替	
ヘッジあり）	
ダイワファンドラップ 外国	1,084,401,751円
REITインデックス（為替	
ヘッジなし）	
ダイワファンドラップオンラ	358,725,835円
イン 外国REITインデッ	
クス（為替ヘッジあり）	
ダイワファンドラップオンラ	271,682,679円
イン 外国REITインデッ	
クス（為替ヘッジなし）	
D-I's グローバルREI	
Tインデックス	1,868,167円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	3,033,535円
iFree 外国REITイン デックス	287,911,421円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,435,786,794円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	98,422,262円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	42,009,478円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	2,766,304,730円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	6,117,216円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	4,059,772円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	228,872,981円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	218,996,022円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	250,842,428円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	56,043,566円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	736,604,330円
計	435,640,344円
	14,377,184,711円
2. 期末日における受益権の総数	14,377,184,711口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありませぬ。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 不動産投信関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	900,186,348	-	901,719,598	1,533,250
合計	900,186,348	-	901,719,598	1,533,250

#### （注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

種 類	2021年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)

		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	697,205,413	-	703,383,000	6,177,587
アメリカ・ドル	578,593,073	-	584,574,200	5,981,127
ユーロ	118,612,340	-	118,808,800	196,460
合計	697,205,413	-	703,383,000	6,177,587

## (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3月7日現在
1口当たり純資産額	2.3830円
(1万口当たり純資産額)	(23,830円)

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年3月31日

資産総額	28,866,252,841円
負債総額	53,499,791円
純資産総額（ - ）	28,812,753,050円
発行済数量	21,022,189,970口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3706円

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	187,489,169,265円
負債総額	11,626,212,502円
純資産総額（ - ）	175,862,956,763円
発行済数量	133,584,109,370口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3165円

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	459,539,883,508円
負債総額	1,594,392,348円
純資産総額（ - ）	457,945,491,160円
発行済数量	140,387,791,188口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.2620円

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ B P I ）

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	29,043,230,560円
負債総額	91,409,010円
純資産総額( - )	28,951,821,550円
発行済数量	22,507,283,785口
1単位当たり純資産額( / )	1.2863円

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	14,327,497,415円
負債総額	32,214,346円
純資産総額( - )	14,295,283,069円
発行済数量	7,890,075,170口
1単位当たり純資産額( / )	1.8118円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	193,305,121,750円
負債総額	89,115,818円
純資産総額( - )	193,216,005,932円
発行済数量	55,557,033,685口
1単位当たり純資産額( / )	3.4778円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	37,660,487,386円
負債総額	106,813,145円
純資産総額( - )	37,553,674,241円

発行済数量	14,559,554,464口
1単位当たり純資産額( / )	2.5793円

## (参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	19,384,756,666円
負債総額	217,409,759円
純資産総額( - )	19,167,346,907円
発行済数量	13,686,219,753口
1単位当たり純資産額( / )	1.4005円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年3月31日

資産総額	221,614,617,564円
負債総額	919,347,422円
純資産総額( - )	220,695,270,142円
発行済数量	71,873,574,025口
1単位当たり純資産額( / )	3.0706円

#### 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2021年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

## ホ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および経営会議

## ・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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。

## ・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。

## ・経営会議

法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年3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	41	80,646
追加型株式投資信託	735	20,466,276
株式投資信託 合計	776	20,546,922
単位型公社債投資信託	54	165,335
追加型公社債投資信託	14	1,561,179
公社債投資信託 合計	68	1,726,514
総合計	844	22,273,436

### 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期事業年度（2019年4月1日から2020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62期事業年度に係る中間会計期間（2020年4月1日から2020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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	28,489	2,741
有価証券	554	22,167
前払費用	214	205
未収委託者報酬	11,468	10,847
未収収益	98	63
その他	56	62
流動資産計	40,882	36,088
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	217
建物	10	7
器具備品	195	209
無形固定資産	2,821	2,362

ソフトウェア	2,804	2,028
ソフトウェア仮勘定	17	333
投資その他の資産	12,799	15,844
投資有価証券	8,493	9,153
関係会社株式	1,836	3,972
出資金	183	183
長期差入保証金	1,070	1,069
繰延税金資産	1,183	1,431
その他	31	33
固定資産計	15,827	18,424
資産合計	56,709	54,512

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	2 3,882	2 3,530
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		

資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
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	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	363
評価・換算差額等合計	46	363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		

給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299
退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31 日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	15	78

法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

## 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

時価のあるもの

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。

## 時価のないもの

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	8～18年
器具備品	4～17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・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

## (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 6．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## (未適用の会計基準等)

## 1．収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年3月30日）

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

#### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

#### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日)
- ・「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 2019年7月4日)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)

#### (1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

#### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

#### (表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
未払金	3,788百万円	3,397百万円

3 保証債務

前事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2020年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2018年4月1日至2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

（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。

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. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-
(2) 未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-

(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		2,741	2,741	-
(2) 未収委託者報酬		10,847	10,847	-
(3) 有価証券及び投資有価証券				
有価証券		21,900	21,900	-
其他有価証券		8,754	8,754	-
資産計		44,243	44,243	-
(1) 未払手数料		(3,988)	(3,988)	-
(2) その他未払金		(3,530)	(3,530)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,889)	(2,889)	-
負債計		(10,408)	(10,408)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、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。

#### 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	666	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	1,836	3,972

(3) 長期差入保証金	1,070	1,069
-------------	-------	-------

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

(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(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	87	55	32
(2) その他	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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(2020年3月31日)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	389	86	-
(2) その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他			

証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

#### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

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

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	171	183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

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

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574

貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,389	2,574
-------------------------	-------	-------

## (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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

## 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174百万円、当事業年度181百万円であります。

## (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
	(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		788
	731	
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	164	173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
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	85	71
繰延税金負債合計	244	230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

## 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(2019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(2020年3月31日)

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

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

[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子会社

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注1)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173

同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055
-------------	------------	--------	-----	--------	---	---------	-------------	-------	---------	-------

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,389.06円	1株当たり純資産額	14,732.52円
1株当たり当期純利益	4,550.81円	1株当たり当期純利益	4,050.66円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,870	10,566
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 (2020年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		2,811
有価証券		12,910
未収委託者報酬		11,357
その他		360
流動資産合計		27,439
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	226
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		1,720
その他		687
無形固定資産合計		2,408
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		10,638
関係会社株式		3,972
繰延税金資産		1,053
その他		1,286
投資その他の資産合計		16,951
固定資産合計		19,586
資産合計		47,025

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2020年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金	5,860
未払費用	3,365
未払法人税等	594
賞与引当金	571
その他	2

流動負債合計	11,000
--------	--------

## 固定負債

退職給付引当金	2,609
役員退職慰労引当金	110
その他	4

固定負債合計	2,724
--------	-------

## 負債合計

負債合計	13,724
------	--------

## 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	5,784

利益剰余金合計	6,158
---------	-------

## 株主資本合計

株主資本合計	32,828
--------	--------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	472
--------------	-----

評価・換算差額等合計	472
------------	-----

## 純資産合計

純資産合計	33,301
-------	--------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計	47,025
----------	--------

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

## 当中間会計期間

(自 2020年4月1日  
至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		31,426
その他営業収益		214
営業収益合計		31,641
営業費用		
支払手数料		13,509
その他営業費用		5,825
営業費用合計		19,334
一般管理費	1	5,708
営業利益		6,597
営業外収益	2	239
営業外費用	3	156
経常利益		6,679
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		6,679
法人税、住民税及び事業税		2,071
法人税等調整額		8
中間純利益		4,599

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564

中間純利益	-	-	-	4,599	4,599	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	5,965	5,965	5,965
当中間期末残高	15,174	11,495	374	5,784	6,158	32,828

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,564
中間純利益	-	-	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	836	836	836
当中間期変動額合計	836	836	5,128
当中間期末残高	472	472	33,301

## 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	8～18年
器具備品	4～17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．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## ５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## ６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年２月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## （追加情報）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年７月４日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

## (中間貸借対照表関係)

## 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2020年9月30日現在)
有形固定資産	316百万円

## 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(2020年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,623百万円に対して保証を行っております。

## (中間損益計算書関係)

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	327百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
投資有価証券売却益	203百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
為替差損	63百万円
有価証券償還損	46百万円
投資有価証券売却損	33百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

（金融商品関係）

当中間会計期間（2020年9月30日）

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価  
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

## （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(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券（1）	60			60
資産合計	60			60

( 1 ) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券410百万円、投資有価証券9,911百万円は上記の表に含めておりません。

( 2 ) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、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。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

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

(単位:百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,944
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間(2020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 1,944百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

#### 2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	60	55	5
(2) その他	7,989	7,141	847
小計	8,049	7,196	852
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	14,833	15,006	173
小計	14,833	15,006	173
合計	22,882	22,203	679

(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。

## (セグメント情報等)

### [セグメント情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

#### 1. サービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

##### (2) 有形固定資産

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

#### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	12,766.41円
1株当たり中間純利益	1,763.16円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
中間純利益(百万円)	4,599
普通株式に係る中間純利益(百万円)	4,599
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

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

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

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2020年3月末日現在）

事業の内容

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。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2020年3月末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	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。
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
株式会社 S B I 証券	48,323	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
O K B 証券株式会社	1,500	
auカブコム証券株式会社	7,196	
京銀証券株式会社	3,000	
G M O クリック証券株式会社	4,346	
静岡東海証券株式会社	600	
株式会社証券ジャパン	3,000	
第四北越証券株式会社	600	
立花証券株式会社	6,695	
東海東京証券株式会社	6,000	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000	
百五証券株式会社	3,000	
ほくほく T T 証券株式会社	1,250	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
むさし証券株式会社	5,000	
楽天証券株式会社	7,495	
ワイエム証券株式会社	1,270	
株式会社愛知銀行	18,000	
株式会社イオン銀行	51,250	

株式会社大垣共立銀行	46,773	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。	
株式会社沖縄銀行	22,725		
株式会社香川銀行	12,000		
株式会社関西みらい銀行	38,971		
株式会社北九州銀行	10,000		
株式会社きらやか銀行	22,700		
株式会社高知銀行	19,544		
株式会社佐賀共栄銀行	2,679		
株式会社静岡銀行	90,845		
株式会社静岡中央銀行	2,000		
株式会社島根銀行	7,886		
株式会社清水銀行	10,816		
信金中央金庫	690,998	(注1)	
株式会社新生銀行	512,204	(注2)	
スルガ銀行株式会社	30,043	(注3)	
全国信用協同組合連合会	111,875		
株式会社大東銀行	14,743		
株式会社但馬銀行	5,481	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。	
株式会社中京銀行	31,844		
株式会社筑波銀行	48,868		
株式会社東邦銀行	23,519		
株式会社徳島大正銀行	11,036		
株式会社鳥取銀行	9,061		
株式会社トマト銀行	17,810		
株式会社富山第一銀行	10,182		
株式会社長野銀行	13,017		
株式会社名古屋銀行	25,090		
株式会社西日本シティ銀行	85,745		
株式会社百五銀行	20,000		
株式会社福井銀行	17,965		
株式会社福島銀行	18,682		
株式会社豊和銀行	12,495		
株式会社みちのく銀行	36,986		
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958		(注4)
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279		
株式会社武蔵野銀行	45,743		
株式会社もみじ銀行	10,000		
株式会社山口銀行	10,005		

(注1) 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2）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

（注3）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4）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。

## 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。

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】

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しております。

### <再信託受託会社の概要>

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

事業の内容：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。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 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。  
「iFreeのポイント」を記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**

2020年5月22日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員業 務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員業 務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員業 務執行社員	公認会計士	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61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（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- (注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2020年10月9日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているiFree 8資産バランスの2019年9月10日から2020年9月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、iFree 8資産バランスの2020年9月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2020年11月20日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

**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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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2020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（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2021年4月2日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小林 英之 印

**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 i F r e e 8 資産バランスの2020年9月8日から2021年3月7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、i F r e e 8 資産バランスの2021年3月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月8日から2021年3月7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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。