

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2022年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 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

### (6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

### (7)【申込期間】

2022年6月1日から2022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】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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。

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、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？



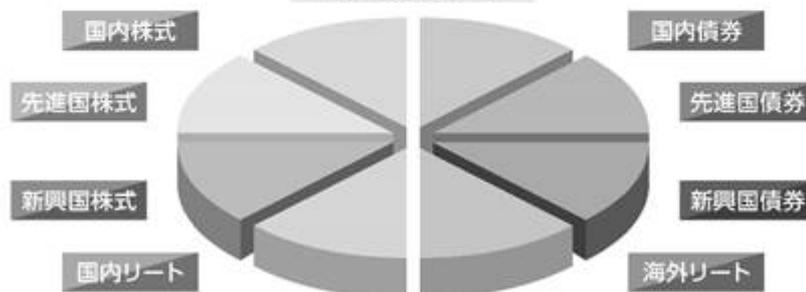
これらの質問については、以降でご説明します。

## 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。

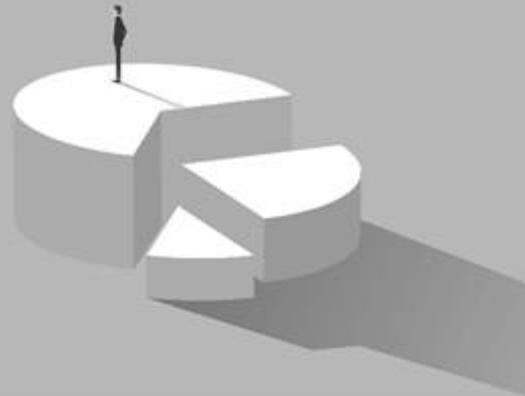
※対象インデックスについては、後掲の「対象インデックスについて」をご参照下さい。



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>	<b>運用管理費用 (信託報酬)</b>	<b>換金時手数料 信託財産留保額</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。	ファンドの運用・管理等に対するものです。	換金する際に必要な費用等です。
当ファンドは	当ファンドは	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、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。

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

### ● MSCIコクサイ指数

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

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) をもとに、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.

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

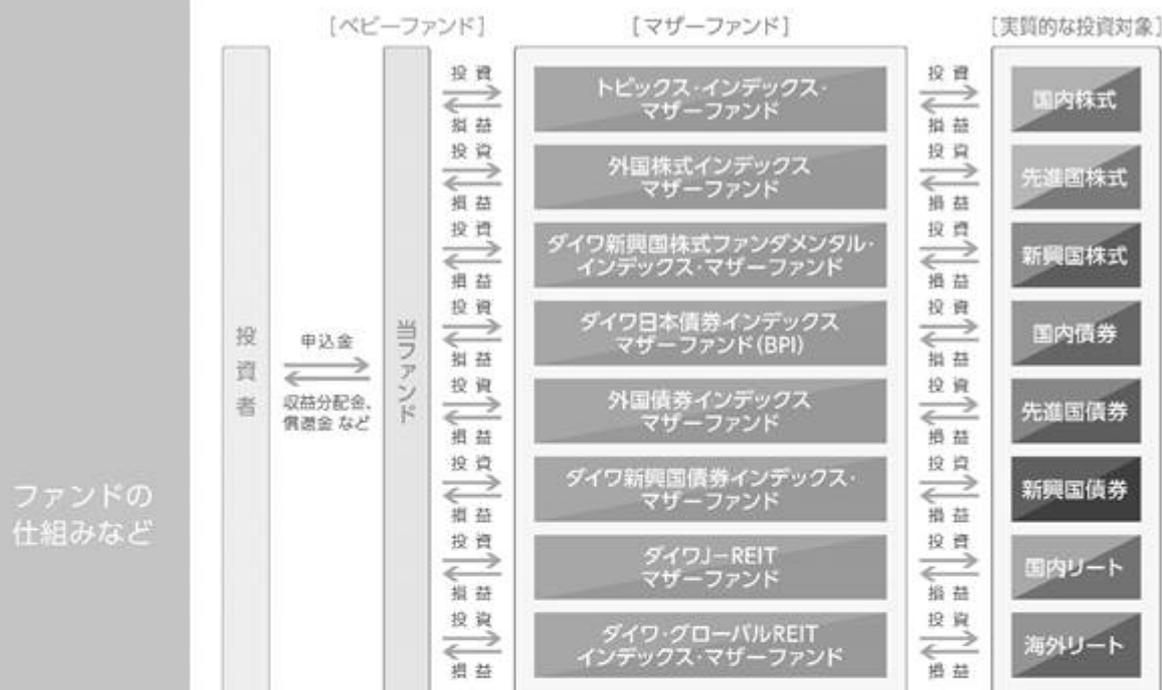
**● S&P先進国REIT指数**

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([SPDJI])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SPDJI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、SPDJI、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。



- 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時、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	<p>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。）</p>	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。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。

## &lt; 委託会社の概況（2022年3月末日現在） &gt;

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券（東証株価指数）
2. 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・マーケット 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。)

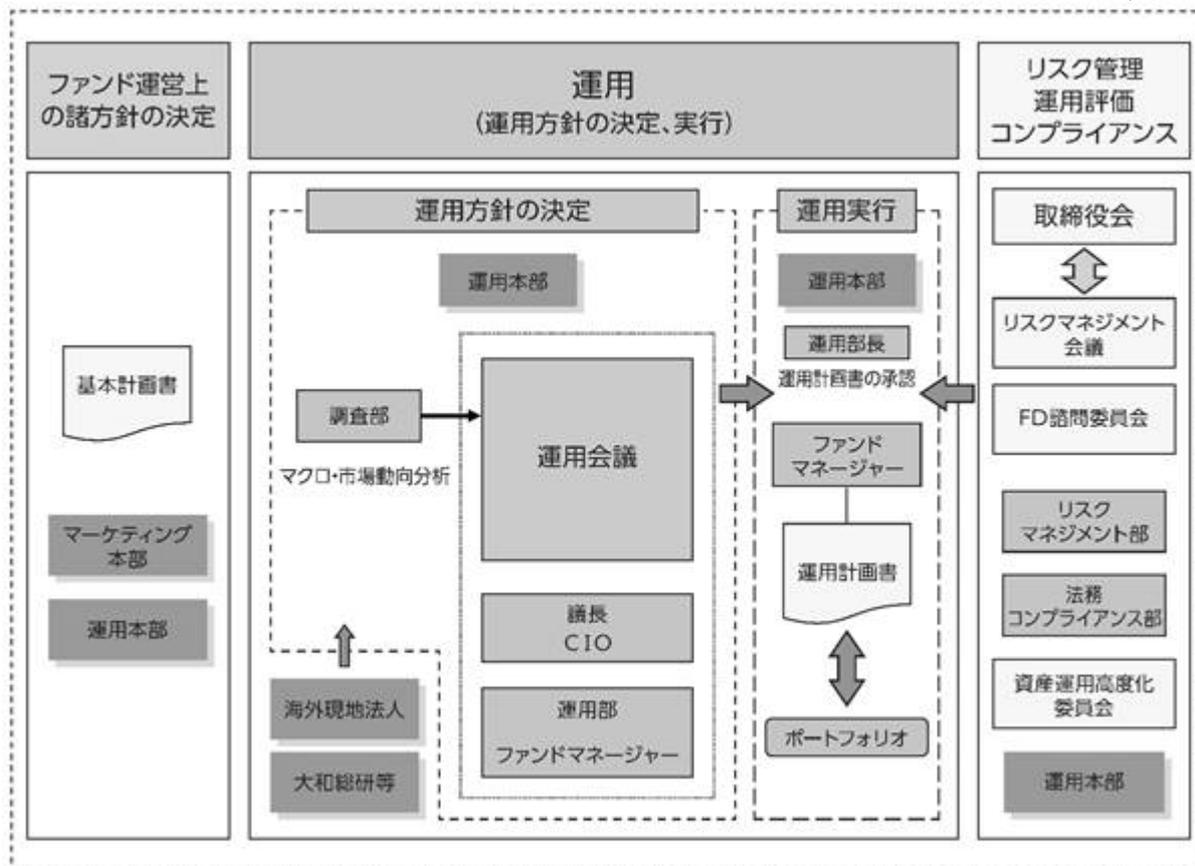
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

**イ．リスクマネジメント会議**

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

**ロ．FD諮問委員会**

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

**ハ．資産運用高度化委員会**

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2022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。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

### <参考> マザーファンドの概要

#### 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 投資対象

東京証券取引所第1市場株式（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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由によ

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

二．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。

## 2. 外国株式インデックスマザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

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

- 1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー

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

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せん。

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せん。）

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. 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。

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

##### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

### (2) 投資対象

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

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

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

#### 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せん。）
  - 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せん。）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。)
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。)
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。 )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（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。

二．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．「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。

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

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

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

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。

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。

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。

## 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。

## 3【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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）

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)。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

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

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

ロ. リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

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

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

#### 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

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

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み入れた部分は、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場合があります。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、基準価額に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付を中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

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

## (3)その他の留意点

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

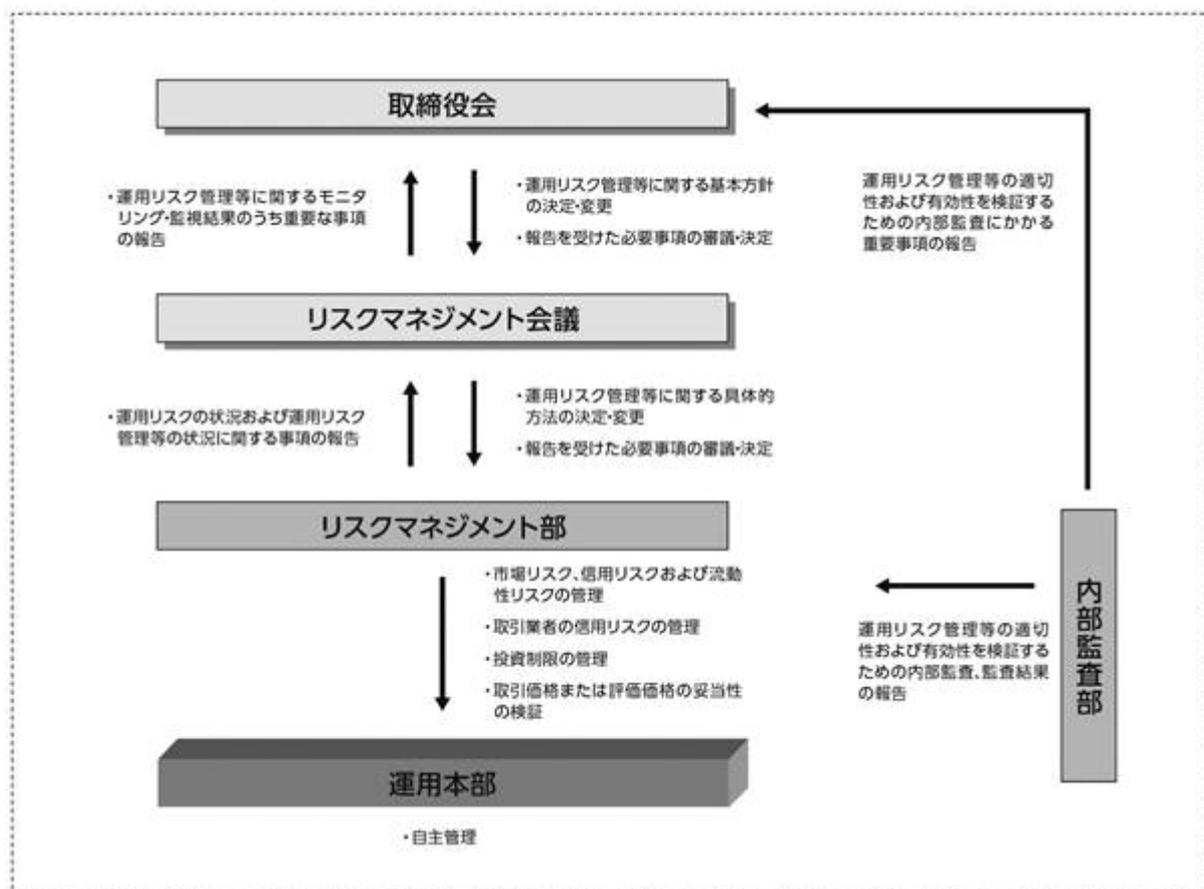
## 流動性リスクに関する事項

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

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

## (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



## 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於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：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円ベース)

### ※指数について

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.242%（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收受した後、販売会社に支払われます。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、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：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

「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。

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

- ( ) 上記は、2022年3月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】（2022年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	40,423,936,729	99.02
内 日本	40,423,936,729	99.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	400,936,329	0.98
純資産総額	40,824,873,058	100.00

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

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

## (2)【投資資産】（2022年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	1,523,608,513	3.0445 4,638,732,434	3.5049 5,340,095,477	13.08
2	外国株式インデックスマザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,202,154,223	3.9537 4,753,062,486	4.3725 5,256,419,340	12.88
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	日本	親投資 信託受 益証券	2,610,309,609	1.8950 4,946,545,940	1.9867 5,185,902,100	12.70
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,494,743,226	3.4921 5,219,884,213	3.3629 5,026,671,994	12.31
5	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	3,713,654,926	1.3844 5,141,262,452	1.3437 4,990,038,124	12.22
6	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	3,457,390,928	1.4465 5,001,131,812	1.4403 4,979,680,153	12.20

7	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	1,551,549,441	3.1240 4,847,188,179	3.1472 4,883,036,400	11.96
8	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	3,748,499,009	1.2923 4,844,527,226	1.2704 4,762,093,141	11.66

(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。

#### 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
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
2021年3月末日	28,812,753,050	-	1.3706	-
4月末日	29,835,991,341	-	1.3919	-

5月末日	30,977,194,970	-	1.4134	-
6月末日	32,249,906,149	-	1.4334	-
7月末日	32,920,242,322	-	1.4297	-
8月末日	34,016,569,287	-	1.4462	-
第5計算期間末 (2021年9月7日)	34,554,535,822	34,554,535,822	1.4651	1.4651
9月末日	34,502,566,056	-	1.4373	-
10月末日	36,149,272,856	-	1.4746	-
11月末日	36,140,595,140	-	1.4432	-
12月末日	37,997,382,607	-	1.4860	-
2022年1月末日	37,622,645,265	-	1.4406	-
2月末日	37,958,954,268	-	1.4230	-
3月末日	40,824,873,058	-	1.4996	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2021年9月8日～ 2022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
第5計算期間	22.7
2021年9月8日～ 2022年3月7日	5.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第5計算期間	8,347,815,842	3,601,501,893
2021年9月8日～ 2022年3月7日	4,505,009,217	1,302,440,375

(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 (2022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	186,449,692,090	97.34
内 日本	186,449,692,090	97.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,097,618,064	2.66
純資産総額	191,547,310,154	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	5,021,970,000	2.62
内 日本	5,021,970,000	2.62

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

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

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

(2) 投資資産 (2022年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	3,555,000	1,987.19 7,064,481,450	2,222.50 7,900,987,500	4.12
2 ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	439,700	12,354.14 5,432,116,600	12,730.00 5,597,381,000	2.92

3	キーエンス	日本	株式	電気機器	63,600	71,315.22 4,535,648,000	57,250.00 3,641,100,000	1.90
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,341,500	633.82 2,751,740,940	760.30 3,300,842,450	1.72
5	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	44,500	54,129.21 2,408,750,000	63,250.00 2,814,625,000	1.47
6	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	517,400	6,964.34 3,603,349,800	5,414.00 2,801,203,600	1.46
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	720,500	3,229.02 2,326,513,610	3,545.00 2,554,172,500	1.33
8	任天堂	日本	株式	その他製品	39,600	52,807.87 2,091,192,000	61,670.00 2,442,132,000	1.27
9	三菱商事	日本	株式	卸売業	517,700	3,548.22 1,836,915,400	4,601.00 2,381,937,700	1.24
10	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	413,000	6,286.06 2,596,143,800	5,559.00 2,295,867,000	1.20
11	信越化学	日本	株式	化学	118,000	21,045.12 2,483,325,000	18,790.00 2,217,220,000	1.16
12	日立	日本	株式	電気機器	337,500	6,418.89 2,166,377,100	6,165.00 2,080,687,500	1.09
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	502,100	3,778.61 1,897,244,300	4,005.00 2,010,910,500	1.05
14	ダイキン工業	日本	株式	機械	89,400	26,551.78 2,373,729,600	22,410.00 2,003,454,000	1.05
15	伊藤忠	日本	株式	卸売業	483,300	3,461.09 1,672,746,400	4,144.00 2,002,795,200	1.05
16	武田薬品	日本	株式	医薬品	551,700	3,739.48 2,063,075,000	3,498.00 1,929,846,600	1.01
17	本田技研	日本	株式	輸送用機器	552,600	3,332.48 1,841,529,000	3,487.00 1,926,916,200	1.01
18	HOYA	日本	株式	精密機器	137,000	18,310.36 2,508,519,800	14,030.00 1,922,110,000	1.00
19	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	479,200	3,929.84 1,883,182,300	3,907.00 1,872,234,400	0.98
20	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	79,200	17,436.18 1,380,946,000	23,510.00 1,861,992,000	0.97
21	三井物産	日本	株式	卸売業	536,500	2,458.93 1,319,220,900	3,328.00 1,785,472,000	0.93
22	日本電産	日本	株式	電気機器	181,900	13,208.89 2,402,697,300	9,748.00 1,773,161,200	0.93

23	村田製作所	日本	株式	電気機器	206,200	9,942.43 2,050,130,000	8,117.00 1,673,725,400	0.87
24	東京海上HD	日本	株式	保険業	228,100	6,015.41 1,372,115,800	7,128.00 1,625,896,800	0.85
25	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	270,400	5,126.48 1,386,200,400	5,813.00 1,571,835,200	0.82
26	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,042,400	1,550.21 1,615,944,550	1,428.00 1,488,547,200	0.78
27	第一三共	日本	株式	医薬品	551,500	3,008.14 1,658,992,850	2,680.00 1,478,020,000	0.77
28	SMC	日本	株式	機械	20,500	76,972.74 1,577,941,200	68,840.00 1,411,220,000	0.74
29	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	885,700	1,597.26 1,414,699,900	1,567.00 1,387,891,900	0.72
30	ファナック	日本	株式	電気機器	61,600	25,429.00 1,566,426,900	21,645.00 1,333,332,000	0.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.34%
合計	97.34%

(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	0.31%
建設業	2.15%
食料品	3.16%
繊維製品	0.43%
パルプ・紙	0.20%
化学	6.28%
医薬品	4.79%
石油・石炭製品	0.43%
ゴム製品	0.65%
ガラス・土石製品	0.72%
鉄鋼	0.82%
非鉄金属	0.79%

金属製品	0.55%
機械	5.20%
電気機器	17.61%
輸送用機器	8.15%
精密機器	2.46%
その他製品	2.36%
電気・ガス業	1.10%
陸運業	3.00%
海運業	0.62%
空運業	0.41%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.04%
卸売業	5.95%
小売業	4.12%
銀行業	5.11%
証券、商品先物取引業	0.74%
保険業	2.18%
その他金融業	1.11%
不動産業	1.90%
サービス業	5.74%
合計	97.34%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 040 6月	買建	258	4,816,217,900	5,021,970,000	2.62%

(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（2022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	436,806,384,600	97.51
内 日本	436,806,384,600	97.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,171,419,095	2.49
純資産総額	447,977,803,695	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)	11,169,200,000	2.49
内 日本	11,169,200,000	2.49

(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) 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（2022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	45,920	638,636.05 29,326,167,716	692,000.00 31,776,640,000	7.09
2 ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	39,388	601,530.26 23,693,073,943	639,000.00 25,168,932,000	5.62
3 GLP投資法人	日本	投資証券	127,569	173,457.06 22,127,744,051	185,400.00 23,651,292,600	5.28
4 日本プロロジスリート	日本	投資証券	64,443	339,188.73 21,858,339,564	356,500.00 22,973,929,500	5.13
5 野村不動産マスターF	日本	投資証券	127,373	148,575.82 18,924,548,292	161,200.00 20,532,527,600	4.58

6	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	198,735	93,409.71 18,563,779,094	103,000.00 20,469,705,000	4.57
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	59,141	306,750.24 18,141,516,337	328,000.00 19,398,248,000	4.33
8	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,382	322,771.95 12,711,405,021	344,500.00 13,567,099,000	3.03
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	78,480	162,276.89 12,735,490,328	165,300.00 12,972,744,000	2.90
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	88,670	123,909.12 10,987,021,822	140,700.00 12,475,869,000	2.78
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	26,914	371,370.25 9,995,058,950	399,500.00 10,752,143,000	2.40
12	産業ファンド	日本	投資証券	55,918	171,570.01 9,593,852,001	184,900.00 10,339,238,200	2.31
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	119,561	74,172.85 8,868,180,348	80,700.00 9,648,572,700	2.15
14	三井不ロジパーク	日本	投資証券	15,515	522,687.65 8,109,499,002	575,000.00 8,921,125,000	1.99
15	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,185	675,723.71 8,233,693,445	731,000.00 8,907,235,000	1.99
16	A PI投資法人	日本	投資証券	20,992	388,879.33 8,163,355,069	424,000.00 8,900,608,000	1.99
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	13,600	613,380.99 8,341,981,468	640,000.00 8,704,000,000	1.94
18	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	48,219	165,340.96 7,972,575,907	175,200.00 8,447,968,800	1.89
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	26,558	294,749.40 7,827,954,830	317,500.00 8,432,165,000	1.88
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	120,668	58,144.92 7,016,232,252	62,300.00 7,517,616,400	1.68
21	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	173,363	39,036.15 6,767,424,188	42,200.00 7,315,918,600	1.63
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,808	463,016.29 6,393,328,983	507,000.00 7,000,656,000	1.56
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	46,317	134,777.96 6,242,511,010	151,100.00 6,998,498,700	1.56
24	イオンリート投資	日本	投資証券	46,321	140,722.18 6,518,392,381	151,000.00 6,994,471,000	1.56
25	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,327	700,779.63 5,835,392,025	757,000.00 6,303,539,000	1.41

26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	53,223	111,181.28 5,917,401,375	115,100.00 6,125,967,300	1.37
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	36,745	152,463.57 5,602,273,889	166,600.00 6,121,717,000	1.37
28	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	37,755	145,783.90 5,504,071,199	161,100.00 6,082,330,500	1.36
29	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	18,323	305,263.66 5,593,346,138	328,500.00 6,019,105,500	1.34
30	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	28,184	195,432.32 5,508,064,574	213,500.00 6,017,284,000	1.34

(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	97.51%
合計	97.51%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 040 6月	買建	5,600	10,337,600,000	11,169,200,000	2.49%

(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) 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（2022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	34,240,446,880	89.77
内 日本	34,240,446,880	89.77
地方債証券	1,553,060,400	4.07
内 日本	1,553,060,400	4.07
特殊債券	829,781,700	2.18
内 日本	829,781,700	2.18
社債券	1,313,600,300	3.44
内 日本	1,313,600,300	3.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	203,752,674	0.53
純資産総額	38,140,641,954	100.00

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

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

## (2) 投資資産（2022年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	139 5年国債	日本	国債証券	640,000,000	100.51 643,270,600	100.27 641,760,000	0.100000 2024/03/20	1.68
2	137 5年国債	日本	国債証券	590,000,000	100.42 592,501,600	100.23 591,386,500	0.100000 2023/09/20	1.55
3	138 5年国債	日本	国債証券	560,000,000	100.47 562,648,800	100.25 561,444,800	0.100000 2023/12/20	1.47
4	143 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.74 554,097,500	100.40 552,200,000	0.100000 2025/03/20	1.45
5	141 5年国債	日本	国債証券	520,000,000	100.62 523,234,800	100.33 521,731,600	0.100000 2024/09/20	1.37
6	145 5年国債	日本	国債証券	510,000,000	100.81 514,133,400	100.41 512,121,600	0.100000 2025/09/20	1.34
7	144 5年国債	日本	国債証券	480,000,000	100.74 483,556,000	100.41 482,006,400	0.100000 2025/06/20	1.26
8	361 10年国債	日本	国債証券	460,000,000	100.42 461,953,700	99.35 457,033,000	0.100000 2030/12/20	1.20

9	140 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.57 452,587,500	100.31 451,395,000	0.100000 2024/06/20	1.18
10	149 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.46 452,104,500	99.95 449,797,500	0.005000 2026/09/20	1.18
11	352 10年国債	日本	国債証券	440,000,000	101.19 445,250,000	100.09 440,422,400	0.100000 2028/09/20	1.15
12	345 10年国債	日本	国債証券	410,000,000	101.01 414,161,500	100.35 411,447,300	0.100000 2026/12/20	1.08
13	147 5年国債	日本	国債証券	406,000,000	100.47 407,924,440	100.03 406,158,340	0.005000 2026/03/20	1.06
14	347 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	101.08 404,352,000	100.31 401,248,000	0.100000 2027/06/20	1.05
15	350 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	101.17 404,692,500	100.20 400,832,000	0.100000 2028/03/20	1.05
16	353 10年国債	日本	国債証券	390,000,000	101.25 394,887,900	100.03 390,128,700	0.100000 2028/12/20	1.02
17	349 10年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.84 383,223,000	100.25 380,972,800	0.100000 2027/12/20	1.00
18	136 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.35 381,356,600	100.20 380,786,600	0.100000 2023/06/20	1.00
19	148 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.46 381,775,600	100.00 380,000,000	0.005000 2026/06/20	1.00
20	348 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.13 364,093,200	100.30 361,080,000	0.100000 2027/09/20	0.95
21	358 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.22 364,404,700	99.64 358,722,000	0.100000 2030/03/20	0.94
22	364 10年国債	日本	国債証券	355,000,000	100.43 356,554,900	99.02 351,535,200	0.100000 2031/09/20	0.92
23	351 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	101.21 354,263,000	100.15 350,539,000	0.100000 2028/06/20	0.92
24	360 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	101.01 353,545,500	99.45 348,096,000	0.100000 2030/09/20	0.91
25	359 10年国債	日本	国債証券	340,000,000	101.11 343,787,600	99.55 338,480,200	0.100000 2030/06/20	0.89
26	354 10年国債	日本	国債証券	330,000,000	101.32 334,359,300	100.00 330,000,000	0.100000 2029/03/20	0.87
27	363 10年国債	日本	国債証券	330,000,000	100.57 331,881,000	99.13 327,158,700	0.100000 2031/06/20	0.86
28	334 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.85 325,936,000	101.42 324,547,200	0.600000 2024/06/20	0.85

29	355 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.31 324,211,800	99.89 319,654,400	0.100000 2029/06/20	0.84
30	362 10年国債	日本	国債証券	315,000,000	100.74 317,337,300	99.25 312,637,500	0.100000 2031/03/20	0.82

(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	89.77%
地方債証券	4.07%
特殊債券	2.18%
社債券	3.44%
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（2022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	17,631,835,315	90.17
内 中国	6,351,512,806	32.48
内 台湾	2,531,652,738	12.95
内 香港	4,431,281	0.02
内 タイ	720,395,346	3.68
内 シンガポール	17,558,680	0.09
内 マレーシア	82,168,756	0.42

	内 インドネシア	258,135,110	1.32
	内 インド	2,093,974,138	10.71
	内 サウジアラビア	541,452,173	2.77
	内 ロシア	165,576,478	0.85
	内 トルコ	367,945,782	1.88
	内 カナダ	18,901,912	0.10
	内 メキシコ	550,999,808	2.82
	内 チリ	135,152,206	0.69
	内 ブラジル	2,887,233,981	14.77
	内 南アフリカ	904,744,120	4.63
投資証券		837,650,868	4.28
	内 アメリカ	837,650,868	4.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,083,778,225	5.54
純資産総額		19,553,264,408	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)	1,069,797,527	5.47
内 アメリカ	1,069,797,527	5.47
為替予約取引(買建)	280,361,125	1.43
内 日本	280,361,125	1.43

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年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	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	325,600	2,777.02 904,222,426	2,572.63 837,650,868	4.28
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	303,000	2,527.69 765,891,700	2,571.36 779,122,080	3.98

3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費財・サービス	333,200	2,256.27 751,794,925	1,781.39 593,561,147	3.04
4	VALE SA	ブラジル	株式	素材	178,590	2,657.55 474,614,095	2,458.88 439,131,977	2.25
5	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	4,147,000	94.02 390,004,329	90.71 376,182,664	1.92
6	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	61,400	6,977.47 428,417,454	5,952.58 365,488,658	1.87
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	404,000	1,026.85 414,855,748	882.09 356,366,784	1.82
8	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	4,478,000	71.00 318,039,038	74.44 333,370,979	1.70
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	376,300	752.51 283,176,164	846.13 318,399,027	1.63
10	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	70,002	3,602.48 252,181,518	4,356.90 304,992,309	1.56
11	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	415,936	630.53 262,273,843	713.78 296,889,553	1.52
12	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	427,418	651.28 278,379,654	575.28 245,887,969	1.26
13	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	249,100	780.11 194,326,792	900.50 224,315,743	1.15
14	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	4,522,000	44.19 199,894,638	48.79 220,659,130	1.13
15	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	3,195,800	60.27 192,661,817	61.15 195,430,840	1.00
16	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,445,000	42.90 147,794,408	46.76 161,100,602	0.82
17	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	50,275	2,587.09 130,066,238	3,103.43 156,025,371	0.80
18	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション・サービス	64,650	2,340.99 151,346,006	2,286.56 147,826,621	0.76
19	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,228,000	59.43 132,422,473	64.43 143,565,190	0.73

20	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	コミュニケーション・サービス	1,073,600	96.13 103,212,692	127.75 137,156,265	0.70
21	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	35,093	3,962.42 139,053,311	3,888.28 136,451,533	0.70
22	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	934,000	141.95 132,584,542	142.21 132,826,475	0.68
23	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	288,902	474.46 137,076,617	452.13 130,621,492	0.67
24	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	133,000	1,006.23 133,829,428	954.82 126,991,326	0.65
25	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	127,700	826.61 105,560,121	895.11 114,306,657	0.58
26	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国	株式	不動産	300,000	286.25 85,882,500	373.79 112,138,800	0.57
27	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費財・サービス	28,595	4,322.94 123,614,925	3,722.32 106,439,740	0.54
28	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	サウジアラビア	株式	素材	23,324	4,027.49 93,937,457	4,247.10 99,059,360	0.51
29	CHINA RESOURCES LAND LTD	中国	株式	不動産	166,000	520.73 86,443,290	579.46 96,190,692	0.49
30	SASOL LTD	南アフリカ	株式	素材	30,610	1,928.38 59,028,039	3,059.58 93,653,878	0.48

(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	90.17%
投資証券	4.28%
合計	94.46%

(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	10.72%
素材	11.14%

資本財・サービス	2.63%
一般消費財・サービス	8.20%
生活必需品	3.78%
ヘルスケア	0.82%
金融	28.93%
情報技術	11.13%
コミュニケーション・サービス	6.70%
公益事業	3.33%
不動産	2.79%
その他	0.02%
合計	90.17%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) JUN 22	買建	153	1,017,902,760	1,069,797,527	5.47%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2022年4 月	買建	2,291,000	268,525,221	280,361,125	1.43%

(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 (2022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	259,068,450,015	93.01

内 香港	2,194,057,014	0.79
内 シンガポール	1,075,783,422	0.39
内 イスラエル	586,149,546	0.21
内 ノルウェー	635,928,466	0.23
内 スウェーデン	2,880,700,116	1.03
内 デンマーク	2,150,287,733	0.77
内 イギリス	11,552,854,812	4.15
内 アイルランド	441,111,762	0.16
内 オランダ	3,347,051,803	1.20
内 ベルギー	714,541,029	0.26
内 フランス	8,553,037,324	3.07
内 ドイツ	6,288,003,452	2.26
内 スイス	7,815,125,576	2.81
内 ポルトガル	157,209,375	0.06
内 スペイン	1,743,373,752	0.63
内 イタリア	1,800,664,576	0.65
内 フィンランド	726,183,618	0.26
内 オーストリア	152,553,988	0.05
内 カナダ	9,951,578,337	3.57
内 アメリカ	190,786,040,156	68.50
内 オーストラリア	5,354,077,064	1.92
内 ニュージーランド	162,137,094	0.06
投資証券	6,616,996,726	2.38
内 香港	101,795,130	0.04
内 シンガポール	111,689,056	0.04
内 イギリス	164,365,572	0.06
内 フランス	112,615,852	0.04
内 カナダ	30,003,609	0.01
内 アメリカ	5,518,579,790	1.98
内 オーストラリア	552,178,002	0.20
内 その他	25,769,715	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,842,839,684	4.61
純資産総額	278,528,286,425	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	12,580,614,327	4.52
内 イギリス	604,664,843	0.22

	内 ドイツ	2,276,829,828	0.82
	内 カナダ	624,664,656	0.22
	内 アメリカ	8,437,566,600	3.03
	内 オーストラリア	636,888,400	0.23
為替予約取引(買建)		6,121,368,500	2.20
	内 日本	6,121,368,500	2.20

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

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

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

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

## (2) 投資資産（2022年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	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	637,600	19,642.12 12,523,871,782	21,757.27 13,872,435,543	4.98
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	277,600	40,997.95 11,381,064,214	38,413.32 10,663,539,131	3.83
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	17,760	433,163.54 7,692,986,669	407,071.58 7,229,591,399	2.60
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	33,150	137,454.74 4,556,625,535	133,893.43 4,438,567,407	1.59
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	11,690	354,955.35 4,149,429,379	347,437.06 4,061,539,235	1.46
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	11,107	356,597.46 3,960,728,398	349,165.20 3,878,177,955	1.39

7	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	97,080	40,403.01 3,922,332,788	33,889.79 3,290,020,910	1.18
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	91,800	40,844.23 3,749,511,034	27,886.56 2,559,986,346	0.92
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	36,666	55,420.39 2,032,047,657	63,743.15 2,337,206,697	0.84
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	102,400	19,564.77 2,003,434,099	21,980.02 2,250,754,058	0.81
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	50,650	34,634.77 1,754,256,748	43,767.88 2,216,843,522	0.80
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	114,670	19,658.52 2,254,256,260	17,200.69 1,972,403,191	0.71
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	93,967	18,258.01 1,715,655,351	18,895.79 1,775,580,896	0.64
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	64,750	24,083.29 1,559,398,222	27,409.24 1,774,748,322	0.64
15	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	106,800	15,916.59 1,699,893,802	15,981.67 1,706,842,698	0.61
16	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	164,305	7,609.84 1,250,351,288	10,253.83 1,684,756,228	0.60
17	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	40,550	49,446.17 2,005,043,772	37,752.41 1,530,860,607	0.55
18	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	74,818	14,178.75 1,060,832,374	20,253.09 1,515,296,226	0.54
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	34,000	39,674.67 1,348,941,457	44,334.55 1,507,374,822	0.54
20	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	286,401	5,575.96 1,596,965,721	5,262.77 1,507,262,591	0.54
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	217,913	6,389.98 1,392,475,482	6,418.13 1,398,594,311	0.50
22	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	68,572	14,443.97 990,460,055	20,041.36 1,374,276,309	0.49
23	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	15,700	95,798.67 1,504,039,836	85,054.74 1,335,359,418	0.48
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	26,600	47,354.55 1,259,633,631	49,145.83 1,307,279,131	0.47

25	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	16,012	69,165.40 1,107,476,767	77,239.10 1,236,752,551	0.44
26	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	70,562	18,084.10 1,276,051,263	17,252.09 1,217,342,285	0.44
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	159,350	6,711.37 1,069,477,355	7,613.88 1,213,272,081	0.44
28	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	17,160	67,689.62 1,161,555,856	70,554.16 1,210,709,442	0.43
29	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	163,750	6,821.52 1,117,043,372	6,859.95 1,123,318,368	0.40
30	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,585	31,144.33 983,696,107	35,479.63 1,120,624,338	0.40

(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	93.01%
投資証券	2.38%
合計	95.39%

(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	4.27%
素材	4.18%
資本財・サービス	8.75%
一般消費財・サービス	10.64%
生活必需品	6.66%
ヘルスケア	12.46%
金融	13.27%
情報技術	22.04%
コミュニケーション・サービス	7.54%
公益事業	2.84%
不動産	0.37%
合計	93.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI JUN 22	買建	300	7,812,637,141	8,437,566,600	3.03%
	イギリス	FTSE 100 INDEX JUN 22	買建	50	572,880,621	604,664,843	0.22%
	オーストラリア	SPI 200 JUN 22	買建	37	603,896,418	636,888,400	0.23%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX JUN 22	買建	24	604,404,055	624,664,656	0.22%
	ドイツ	SWISS MKT IX JUN 22	買建	36	546,083,223	576,437,666	0.21%
		EURO STOXX 50 JUN 22	買建	322	1,591,558,730	1,700,392,162	0.61%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2022年4月	買建	31,230,000	3,725,755,380	3,821,771,250	1.37%
		英ポンド買/円売 2022年4月	買建	1,250,000	197,720,582	201,075,000	0.07%
		スイス・フラン買/円売 2022年4月	買建	2,450,000	311,382,578	324,753,625	0.12%
		カナダ・ドル買/円売 2022年4月	買建	3,560,000	331,342,047	348,479,500	0.13%
		ユーロ買/円売 2022年4月	買建	8,010,000	1,044,163,064	1,095,027,075	0.39%
		豪ドル買/円売 2022年4月	買建	3,590,000	306,913,681	330,262,050	0.12%

(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（2022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	272,307,812	0.95
内 アメリカ	272,307,812	0.95
投資証券	27,927,969,272	96.95
内 ガーンジー	72,758,972	0.25
内 韓国	63,572,068	0.22
内 香港	369,632,007	1.28
内 シンガポール	985,630,503	3.42
内 イスラエル	21,872,862	0.08
内 イギリス	1,496,874,199	5.20
内 アイルランド	29,957,056	0.10
内 オランダ	50,882,741	0.18
内 ベルギー	340,613,887	1.18
内 フランス	469,850,264	1.63
内 ドイツ	14,924,703	0.05
内 スペイン	109,034,637	0.38
内 イタリア	7,089,604	0.02
内 カナダ	533,534,368	1.85
内 アメリカ	21,281,734,325	73.87
内 オーストラリア	1,973,995,631	6.85
内 ニュージーランド	106,011,445	0.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	607,679,472	2.11
純資産総額	28,807,956,556	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)	595,918,658	2.07
内 ドイツ	127,776,908	0.44
内 アメリカ	468,141,750	1.63
為替予約取引(買建)	319,705,942	1.11
内 日本	319,705,942	1.11

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

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

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

## (2) 投資資産（2022年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	102,513	18,770.46 1,924,227,755	20,089.09 2,059,393,355	7.15
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	12,487	100,262.13 1,251,974,179	92,258.80 1,152,035,709	4.00
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	21,156	40,699.20 861,034,555	48,486.02 1,025,770,290	3.56
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	45,489	19,541.27 888,917,112	16,496.94 750,429,672	2.60
5	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	60,276	10,056.29 606,158,089	11,977.08 721,930,800	2.51
6	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	39,296	20,630.05 810,681,974	17,643.74 693,328,501	2.41
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	78,425	8,535.96 669,441,070	8,601.56 674,578,065	2.34
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	19,341	29,471.75 570,015,512	30,836.16 596,402,180	2.07
9	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	47,362	10,556.74 499,992,821	11,198.68 530,392,119	1.84
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	244,590	2,258.04 552,299,843	2,121.52 518,902,577	1.80
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	20,171	25,119.32 506,683,247	24,732.57 498,880,694	1.73
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	18,529	24,859.61 460,624,783	25,573.39 473,849,353	1.64
13	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	55,313	6,020.48 333,015,506	7,689.76 425,343,900	1.48
14	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	15,978	25,700.55 410,644,335	26,070.29 416,551,156	1.45
15	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	82,743	5,055.19 418,287,318	5,006.97 414,292,124	1.44
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	9,034	42,401.03 383,051,549	42,679.84 385,569,682	1.34
17	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	52,800	7,276.33 384,191,946	7,234.47 381,980,169	1.33

18	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	169,579	2,278.68 386,438,674	2,188.90 371,192,905	1.29
19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	16,094	24,063.09 387,272,407	21,798.88 350,831,221	1.22
20	LINK REIT	香港	投資証券	303,600	1,073.99 326,066,937	1,058.04 321,222,766	1.12
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	74,721	4,168.35 311,471,991	4,262.84 318,523,944	1.11
22	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	19,664	13,517.48 265,809,593	16,015.95 314,937,747	1.09
23	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	87,165	3,441.11 299,952,608	3,541.96 308,735,519	1.07
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	41,467	7,034.61 291,706,024	7,101.06 294,459,978	1.02
25	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	14,131	20,665.42 292,023,284	20,758.56 293,339,323	1.02
26	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	20,280	13,238.55 268,480,285	13,427.40 272,307,812	0.95
27	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	40,086	5,743.39 230,232,180	6,787.74 272,093,722	0.94
28	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	26,443	9,639.19 254,889,910	10,065.35 266,158,145	0.92
29	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	85,428	2,850.46 243,511,728	3,059.75 261,388,323	0.91
30	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	98,972	2,012.09 199,142,064	2,439.23 241,415,739	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### 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
投資信託受益証券	0.95%
投資証券	96.95%
合計	97.89%

(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	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE JUN 22	買建	90	439,907,601	468,141,750	1.63%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE JUN 22	買建	103	125,616,644	127,776,908	0.44%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2022年4 月	買建	270,000	24,839,379	24,839,811	0.09%
		米ドル買/円売 2022年4 月	買建	1,525,600	179,659,643	186,697,879	0.65%
		ユーロ買/円売 2022年4 月	買建	550,000	73,719,628	75,188,421	0.26%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2022年4月	買建	90,000	8,143,767	8,143,938	0.03%
		香港ドル買/円売 2022年 4月	買建	405,000	6,334,200	6,334,038	0.02%
		英ポンド買/円売 2022年 4月	買建	115,000	18,502,200	18,501,855	0.06%

(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 (2022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	23,531,697,483	96.54
内 中国	2,376,536,820	9.75
内 タイ	2,323,007,748	9.53
内 マレーシア	2,301,318,993	9.44
内 フィリピン	25,716,339	0.11

内 インドネシア	2,366,481,288	9.71
内 ポーランド	1,627,047,600	6.68
内 ロシア	261,577,980	1.07
内 ハンガリー	787,327,042	3.23
内 ルーマニア	682,950,230	2.80
内 トルコ	219,586,161	0.90
内 チェコ	1,087,869,195	4.46
内 メキシコ	2,356,823,277	9.67
内 ドミニカ共和国	25,036,493	0.10
内 コロンビア	1,021,943,236	4.19
内 ペルー	559,017,018	2.29
内 チリ	499,603,074	2.05
内 ブラジル	2,359,006,699	9.68
内 ウルグアイ	28,282,013	0.12
内 エジプト	338,599,543	1.39
内 南アフリカ	2,283,966,734	9.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	843,066,034	3.46
純資産総額	24,374,763,517	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)	259,225,188	1.06
内 日本	259,225,188	1.06
為替予約取引(売建)	22,197,089	0.09
内 日本	22,197,089	0.09

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年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	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 (%)
				また は 額面金額				
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	27,700,000	82.10 583,307,239	81.74 580,730,871	- 2024/01/01	2.38

2	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	19,300,000	85.45 422,989,031	86.12 426,335,824	- 2023/07/01	1.75
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	40,950,000	112.58 389,128,888	108.86 376,239,754	10.500000 2026/12/21	1.54
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	43,020,000	83.96 304,863,672	84.90 308,280,545	8.750000 2048/02/28	1.26
5	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	12,010,000	102.18 314,766,278	98.09 302,177,960	10.000000 2023/01/01	1.24
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	38,400,000	94.24 305,438,956	91.53 296,645,068	8.000000 2030/01/31	1.22
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	52,400,000	96.45 311,179,346	90.87 293,180,806	5.750000 2026/03/05	1.20
8	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	11,390,000	104.21 304,445,214	96.52 281,989,040	10.000000 2025/01/01	1.16
9	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	11,550,000	102.76 304,433,160	94.92 281,186,788	10.000000 2027/01/01	1.15
10	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,730,000	108.55 272,214,138	100.22 251,335,703	8.500000 2029/05/31	1.03
11	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	41,000,000	104.08 262,745,210	98.97 249,831,307	8.000000 2024/09/05	1.02
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,230,000	103.35 255,987,622	95.62 236,839,326	7.500000 2027/06/03	0.97
13	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	37,950,000	103.73 242,386,954	95.96 224,211,077	7.750000 2031/05/29	0.92
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	29,100,000	90.64 222,623,110	89.55 219,938,382	8.250000 2032/03/31	0.90
15	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	29,900,000	85.23 215,101,558	85.96 216,937,835	8.500000 2037/01/31	0.89
16	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	31,900,000	108.54 213,190,905	100.78 197,941,711	8.500000 2038/11/18	0.81
17	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	25,800,000	90.20 196,432,241	90.51 197,098,222	8.875000 2035/02/28	0.81
18	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	7,490,000	103.73 228,838,506	88.38 194,979,273	2.500000 2026/07/25	0.80
19	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	9,300,000	78.39 186,989,553	77.78 185,538,483	- 2024/07/01	0.76

20	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	7,150,000	106.41 224,100,930	85.36 179,768,646	2.750000 2029/10/25	0.74
21	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	26,550,000	111.59 182,418,214	103.53 169,238,189	10.000000 2024/12/05	0.69
22	China Government Bond	中国	国債証券	8,600,000	98.98 163,871,323	100.98 167,175,701	2.850000 2027/06/04	0.69
23	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	27,250,000	104.78 175,799,050	99.36 166,699,054	8.000000 2023/12/07	0.68
24	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	23,100,000	84.21 164,183,738	85.03 165,787,637	8.750000 2044/01/31	0.68
25	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	6,900,000	103.10 182,467,398	93.02 164,635,179	10.000000 2029/01/01	0.68
26	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	27,800,000	103.33 176,862,574	94.65 162,017,435	8.000000 2047/11/07	0.66
27	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	36,050,000	123.23 163,046,797	118.17 156,354,953	4.875000 2029/06/22	0.64
28	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	17,800,000,000	103.60 158,598,817	101.96 156,088,022	7.000000 2030/09/15	0.64
29	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	37,500,000	118.32 162,842,504	112.15 154,356,071	3.775000 2032/06/25	0.63
30	China Government Bond	中国	国債証券	8,000,000	96.29 148,291,220	98.62 151,877,880	2.680000 2030/05/21	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
国債証券	96.54%
合計	96.54%

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

#### 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	ペルー・ソル買/円売 2022年4月	買建	674,916	22,197,470	22,234,374	0.09%
		タイ・バーツ買/円売 2022年4月	買建	7,000,000	25,494,000	25,690,000	0.11%
		ルーマニア・レイ買/円 売 2022年4月	買建	3,218,000	84,036,479	88,831,280	0.36%
		チェコ・コルナ買/円売 2022年4月	買建	3,743,000	19,798,040	20,924,492	0.09%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2022年4月	買建	45,596,000	16,093,608	16,960,479	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2022年4月	買建	5,956,000	34,482,370	36,617,488	0.15%
		マレーシア・リングgit 買/円売 2022年4月	買建	800,000	23,123,360	23,296,800	0.10%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2022年4月	買建	2,926,000	23,049,254	24,670,275	0.10%
		米ドル売/円買 2022年4 月	売建	181,367	22,197,470	22,197,089	0.09%

(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 (2022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	234,695,741,743	98.66
内 ユーロ	89,122,263,941	37.46
内 中国	2,831,271,698	1.19
内 シンガポール	969,089,254	0.41
内 マレーシア	1,224,887,424	0.51
内 イスラエル	1,026,326,150	0.43
内 ノルウェー	627,297,364	0.26
内 スウェーデン	652,386,929	0.27

内 デンマーク	994,344,595	0.42
内 イギリス	12,743,783,560	5.36
内 ポーランド	1,041,754,917	0.44
内 カナダ	4,781,074,055	2.01
内 アメリカ	113,093,744,741	47.54
内 メキシコ	1,787,433,276	0.75
内 オーストラリア	3,800,083,839	1.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,190,297,431	1.34
純資産総額	237,886,039,174	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)	635,560,228	0.27
内 日本	635,560,228	0.27
為替予約取引(売建)	121,789,695	0.05
内 日本	121,789,695	0.05

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年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	10,700,000	96.91 1,269,107,194	90.27 1,182,190,834	1.125000 2031/02/15	0.50
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	10,300,000	97.64 1,230,973,040	90.67 1,143,114,889	1.250000 2031/08/15	0.48
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	93.01 1,138,361,629	86.88 1,063,348,798	0.625000 2030/08/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	94.91 1,138,455,379	88.51 1,061,668,383	0.875000 2030/11/15	0.45
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	9,000,000	98.51 1,085,115,542	91.51 1,008,046,876	1.375000 2031/11/15	0.42

6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.16 1,077,144,598	94.01 1,001,065,138	1.625000 2031/05/15	0.42
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,700,000	99.52 937,945,433	96.89 913,131,962	0.250000 2023/11/15	0.38
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	102.16 966,422,717	96.38 911,727,755	1.625000 2026/05/15	0.38
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	98.95 908,351,042	95.17 873,671,835	0.375000 2024/09/15	0.37
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,699,000	118.93 926,528,089	111.22 866,494,242	2.750000 2027/10/25	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	97.44 894,435,299	92.87 852,522,843	0.250000 2025/06/30	0.36
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,920,000	114.61 927,510,835	104.72 847,493,631	1.500000 2031/05/25	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	109.49 897,848,633	102.40 839,742,512	2.875000 2028/08/15	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.24 890,127,293	87.20 832,476,463	0.625000 2030/05/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	108.20 874,035,701	101.13 816,918,001	2.625000 2029/02/15	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	109.25 869,121,987	102.26 813,585,689	2.875000 2028/05/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.37 851,375,437	93.23 798,797,917	1.250000 2028/03/31	0.34
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	98.95 847,760,036	92.73 794,514,267	1.250000 2028/09/30	0.33
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	108.34 842,016,335	101.55 789,284,909	2.750000 2028/02/15	0.33
20	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	101.14 792,251,849	100.46 786,909,804	- 2023/04/14	0.33
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	122.73 853,518,291	112.88 784,987,321	2.500000 2030/05/25	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	105.91 829,620,125	99.67 780,781,619	2.375000 2027/05/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.50 826,744,450	90.92 779,016,021	0.750000 2028/01/31	0.33
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,664,000	175.35 878,308,501	152.94 766,028,742	4.500000 2041/04/25	0.32

25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	111.25 871,465,167	97.43 763,220,123	2.375000 2051/05/15	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	100.21 797,264,927	95.67 761,159,932	1.500000 2027/01/31	0.32
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,900,000	102.65 866,920,680	89.57 756,410,588	2.000000 2051/08/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	104.36 787,071,494	99.78 752,575,887	2.375000 2024/08/15	0.32
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	97.10 772,536,083	92.46 735,615,303	0.250000 2025/09/30	0.31
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,997,000	109.63 748,885,119	106.86 729,997,683	4.250000 2023/10/25	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。

#### □．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	98.66%
合計	98.66%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2022年5月	買建	126,000	20,236,734	20,252,131	0.01%
		米ドル買/円売 2022年5月	買建	4,055,000	495,645,488	495,930,149	0.21%
		ユーロ買/円売 2022年5月	買建	873,000	119,365,901	119,377,948	0.05%
		米ドル売/円買 2022年4月	売建	545,000	66,698,626	66,697,863	0.03%

	ユーロ売/円買 2022年4月	売建	403,000	55,091,510	55,091,832	0.02%
--	-----------------	----	---------	------------	------------	-------

(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

2022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	14,996円
純資産総額	408億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.4%
3カ月間	0.9%
6カ月間	4.3%
1年間	9.4%
3年間	25.8%
5年間	38.3%
設定来	50.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年9月	18年9月	19年9月	20年9月	21年9月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

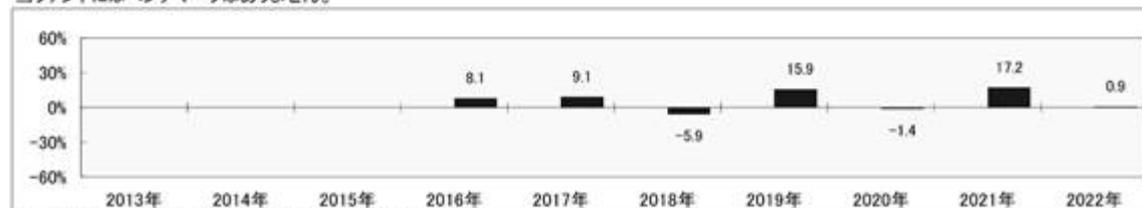
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	13.1%	外国株式・先物	1,626	24.7%	日本円	37.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	1.0%
外国株式INDEXMF	12.9%	外国債券	1,116	23.6%	米ドル	26.6%	日本ビルファンド	日本	0.9%
ダイワ新興国株式 F-INDEX・MF	12.7%	外国リート・先物	335	13.2%	ユーロ	6.3%	MSCI EMER MKT INDEX (DCE) JUN 22	アメリカ	0.7%
ダイワJ-REIT MF	12.3%	国内リート・先物	62	12.3%	香港ドル	3.8%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.7%
トピックス・インデックス・MF	12.2%	国内株式・先物	2,161	12.2%	ブラジル・レアル	3.1%	GLP投資法人	日本	0.7%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.2%	国内債券	288	11.6%	英ポンド	1.9%	APPLE INC	アメリカ	0.6%
外国債券INDEXMF	12.0%	外国投資信託等	10	0.7%	オフショア人民元	1.9%	日本プロロジリート	日本	0.6%
日本債券インデックスMF(BPI)	11.7%				南アフリカ・ランド	1.8%	野村不動産マスターF	日本	0.6%
					台湾ドル	1.7%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		3.8%	その他	15.7%	INVESCO FTSE RAFT EMERGING M	アメリカ	0.5%
合計	99.0%	合計	5,598	-	合計	100.0%	合計		6.8%

※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、2022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ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（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ないません。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ないません。

## 2【換金（解約）手続等】

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

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

### <一部解約>

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

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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（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付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

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

#### (4)【計算期間】

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

## 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1.の事項（前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあつては、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、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

##### < 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年9月8日から2021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4期 2020年9月7日現在	第5期 2021年9月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	40,515,304	-
コール・ローン	236,884,751	411,799,652
親投資信託受益証券	22,260,919,838	34,212,125,313
未収入金	5,669,000	-
流動資産合計	22,543,988,893	34,623,924,965
資産合計	22,543,988,893	34,623,924,965
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	32,340,327	30,424,438
未払受託者報酬	2,170,797	3,434,031
未払委託者報酬	21,708,390	34,340,657
その他未払費用	814,230	1,190,017
流動負債合計	57,033,744	69,389,143
負債合計	57,033,744	69,389,143
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 18,838,006,602	1 23,584,320,551
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,648,948,547	10,970,215,271
（分配準備積立金）	600,813,640	5,671,819,546
元本等合計	22,486,955,149	34,554,535,822
純資産合計	22,486,955,149	34,554,535,822
負債純資産合計	22,543,988,893	34,623,924,965

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2019年9月10日 至 2020年9月7日	第5期 自 2020年9月8日 至 2021年9月7日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,252	138
有価証券売買等損益	182,945,594	5,749,147,475
営業収益合計	182,944,342	5,749,147,613
<b>営業費用</b>		
支払利息	93,084	90,137
受託者報酬	4,153,580	6,144,948
委託者報酬	41,536,560	61,450,224
その他費用	1,560,114	2,201,591
営業費用合計	47,343,338	69,886,900
営業利益又は営業損失（ ）	230,287,680	5,679,260,713
経常利益又は経常損失（ ）	230,287,680	5,679,260,713
当期純利益又は当期純損失（ ）	230,287,680	5,679,260,713
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（ ）	75,373,261	381,979,171
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,721,726,160	3,648,948,547
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,787,238,412	2,764,859,107
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,787,238,412	2,764,859,107
剰余金減少額又は欠損金増加額	705,101,606	740,873,925
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	705,101,606	740,873,925
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,648,948,547	10,970,215,271

## (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5期	
	自 2020年9月8日	至 2021年9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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首元本額	12,911,568,998円	18,838,006,602円
期中追加設定元本額	9,224,765,978円	8,347,815,842円
期中一部解約元本額	3,298,328,374円	3,601,501,893円
2. 計算期間末日における受益権の総数	18,838,006,602口	23,584,320,551口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年9月10日 至 2020年9月7日	自 2020年9月8日 至 2021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(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>	<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(5,167,194,273円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,298,479,837円)及び分配準備積立金(504,625,273円)より分配対象額は10,970,299,383円(1万口当たり4,651.52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5期 自 2020年9月8日 至 2021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	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。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 2021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4期 2020年9月7日現在	第5期 2021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	113,722,511	5,635,039,183
合計	113,722,511	5,635,039,183

## （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4期 2020年9月7日現在	第5期 2021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5期 自 2020年9月8日 至 2021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なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第4期 2020年9月7日現在	第5期 2021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)	1.1937円 (11,937円)	1.4651円 (14,651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	2,270,739,389	4,313,496,543	
	ダイワ新興国債券インデックス・マ ザーファンド	2,915,477,206	4,237,354,571	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	3,197,005,271	4,456,945,048	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,073,964,819	4,244,201,568	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,345,747,943	4,204,789,447	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,197,273,510	4,234,516,950	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	1,418,312,242	4,318,902,608	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	3,248,738,657	4,201,918,578	
親投資信託受益証券 合計			34,212,125,313	
合計			34,212,125,313	

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

	2020年9月7日現在	2021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	2,123,832,560	-
コール・ローン	12,417,617,328	12,994,807,885
株式 2 3	153,692,856,715	189,788,890,350
派生商品評価勘定	6,183,250	146,211,950
未収入金	635,200	12,646,800
未収配当金	90,118,686	102,946,124
未収利息	2,841,197	1,025,745
その他未収収益 4	7,928,451	4,435,797
差入委託証拠金	23,625,000	-
流動資産合計	168,365,638,387	203,050,964,651
資産合計	168,365,638,387	203,050,964,651
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,404,350	-
前受金	8,432,700	134,453,500
未払解約金	259,193,620	452,261,100
受入担保金	13,624,119,620	9,924,137,895
その他未払費用	20,610	-
流動負債合計	13,894,170,900	10,510,852,495
負債合計	13,894,170,900	10,510,852,495

純資産の部		
元本等		
元本	1	145,237,517,692
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,233,949,795
元本等合計		154,471,467,487
純資産合計		154,471,467,487
負債純資産合計		168,365,638,387
		203,050,964,651

## 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	先物取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	144,845,005,615円	145,237,517,692円
期中追加設定元本額	37,864,010,477円	20,022,399,043円
期中一部解約元本額	37,471,498,400円	27,149,364,233円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	3,333,406,253円	3,037,312,377円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	6,867,723,764円	5,936,053,504円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	2,658,809円	925,788円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	46,604,616円	25,469,299円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	694,930,134円	468,307,280円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	36,922,244円	23,164,900円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	991,235,317円	723,006,295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)	111,142,691円	212,625,883円
D-I's TOPIXイン デックス	55,500,923円	42,121,286円

為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	13,272,102円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	24,121,009円	112,903,062円
iFree TOPIXイン デックス	1,955,526,936円	4,179,535,750円
iFree 8資産バランス	2,611,590,900円	3,197,005,271円
iFree 年金バランス	106,797,967円	442,601,861円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,767,887,875円	65,744,715,587円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,015,238,978円	2,911,072,949円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,722,562,513円	3,953,569,925円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,360,347,649円	3,760,977,295円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,142,755,615円	5,859,678,861円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	12,786,758円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	49,666,344円	52,356,678円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	36,796,901円	53,333,164円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	720,335,780円	1,308,591,695円
ダイワつみたてインデックス バランス30	11,325,834円	9,810,933円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,141,239円	8,690,476円
ダイワつみたてインデックス バランス70	10,252,913円	17,428,664円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	146,777,901円	113,101,715円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	156,434,763円	130,262,046円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,252,862,172円	6,250,599,539円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	728,799,049円	570,082,799円

	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	106,898,813円	82,764,931円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	196,192,338円	147,596,159円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	179,125,727円	179,598,319円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス	10,574,812,421円	10,238,504,982円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	9,698,721,896円	2,518,929,016円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	2,001,806,712円	2,631,610,906円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,332,052,976円	1,222,729,074円
	ダイワライフスタイル25	193,695,326円	158,275,910円
	ダイワライフスタイル50	675,255,051円	620,574,149円
	ダイワライフスタイル75	534,673,123円	496,136,802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)	11,750,877,360円	10,668,527,372円
	計	145,237,517,692円	138,110,552,502円
2.	期末日における受益権の総数	145,237,517,692口	138,110,552,502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 12,801,083,940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 9,613,970,350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 531,280,000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 984,520,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分5,022,985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3,169,649円が 含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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	2021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	2020年9月7日現在	2021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	542,696,140	36,346,847,074
合計	542,696,140	36,346,847,074

（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9月20日から2020年9月7日まで、及び2020年9月24日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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	767,554,700	-	771,360,000	3,805,300	2,350,556,500	-	2,496,835,000	146,278,500
合計	767,554,700	-	771,360,000	3,805,300	2,350,556,500	-	2,496,835,000	146,278,500

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年9月7日現在	2021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)	1.0636円 (10,636円)	1.3941円 (13,941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	3,100	3,085.00	9,563,500	貸付株式数 300株
日本水産	84,300	627.00	52,856,100	
マルハニチロ	14,000	2,624.00	36,736,000	
ハウスイ	500	955.00	477,500	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,700	1,513.00	4,085,100	
サカタのタネ	10,800	3,665.00	39,582,000	
ホクト	7,900	1,997.00	15,776,300	貸付株式数 3,100株
ホクリヨウ	2,300	783.00	1,800,900	貸付株式数 300株
ヒノキヤグループ	2,300	2,371.00	5,453,300	
ショーボンドHD	13,200	5,050.00	66,660,000	貸付株式数 5,100株
ミライト・ホールディングス	31,900	2,288.00	72,987,200	
タマホーム	5,900	2,729.00	16,101,100	貸付株式数 2,100株
サンヨーホームズ	1,500	725.00	1,087,500	貸付株式数 300株
日本アクア	4,400	590.00	2,596,000	貸付株式数 1,400株
ファーストコーポレーション	3,200	783.00	2,505,600	
ベステラ	1,900	1,530.00	2,907,000	
キャンディル	1,700	626.00	1,064,200	貸付株式数 200株
スペースバリューHD	11,500	853.00	9,809,500	貸付株式数 4,200株
住石ホールディングス	21,600	134.00	2,894,400	
日鉄鉱業	2,100	6,660.00	13,986,000	
三井松島HLDGS	3,600	1,335.00	4,806,000	
INPEX	367,200	773.00	283,845,600	貸付株式数 143,600株
石油資源開発	12,400	1,920.00	23,808,000	
K&Oエナジーグループ	4,300	1,359.00	5,843,700	貸付株式数 400株
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,310.00	2,358,000	
第一カッター興業	2,300	1,275.00	2,932,500	

明豊ファシリティワークス	3,300	876.00	2,890,800	貸付株式数	1,100株
安藤・間	58,400	841.00	49,114,400		
東急建設	29,000	790.00	22,910,000		
コムシスホールディングス	32,600	3,100.00	101,060,000		
ビーアールホールディングス	12,500	521.00	6,512,500	貸付株式数	1,800株
高松コンストラクションG P	5,700	2,135.00	12,169,500	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	11,080.00	31,024,000	貸付株式数	500株
ソネック	1,000	1,159.00	1,159,000	貸付株式数	200株 (100株)
ヤマウラ	4,100	918.00	3,763,800	貸付株式数	1,500株
オリエンタル白石	32,300	272.00	8,785,600		
大成建設	65,400	3,630.00	237,402,000		
大林組	209,000	947.00	197,923,000		
清水建設	197,800	819.00	161,998,200		
飛島建設	5,700	1,128.00	6,429,600	貸付株式数	500株
長谷工コーポレーション	68,600	1,583.00	108,593,800		
松井建設	7,800	801.00	6,247,800		
銭高組	900	4,095.00	3,685,500		
鹿島建設	153,900	1,485.00	228,541,500		
不動テトラ	5,100	1,777.00	9,062,700	貸付株式数	600株
大末建設	2,500	993.00	2,482,500	貸付株式数	700株
鉄建建設	3,900	1,843.00	7,187,700		
西松建設	15,500	3,620.00	56,110,000		
三井住友建設	51,700	486.00	25,126,200		
大豊建設	5,000	3,855.00	19,275,000	貸付株式数	1,800株
前田建設	53,400	838.00	44,749,200		
佐田建設	5,100	482.00	2,458,200	貸付株式数	1,700株
ナカノフドー建設	5,000	372.00	1,860,000	貸付株式数	1,700株
奥村組	11,500	3,105.00	35,707,500		
東鉄工業	8,500	2,524.00	21,454,000	貸付株式数	400株
イチケン	1,500	1,942.00	2,913,000	貸付株式数	400株
富士ピー・エス	2,400	579.00	1,389,600	貸付株式数	900株
浅沼組	2,600	4,645.00	12,077,000		
戸田建設	86,100	841.00	72,410,100	貸付株式数	3,000株
熊谷組	9,900	2,795.00	27,670,500		
北野建設	1,200	2,187.00	2,624,400	貸付株式数	400株
植木組	1,800	1,510.00	2,718,000	貸付株式数	700株
矢作建設	9,300	782.00	7,272,600	貸付株式数	200株

ピーエス三菱	6,800	662.00	4,501,600	
日本ハウスHLDGS	14,700	429.00	6,306,300	貸付株式数 5,400株
大東建託	23,000	12,870.00	296,010,000	
新日本建設	8,400	895.00	7,518,000	
NIPPO	17,700	4,215.00	74,605,500	貸付株式数 1,800株
東亜道路	1,300	4,630.00	6,019,000	
前田道路	13,200	1,916.00	25,291,200	
日本道路	2,100	8,520.00	17,892,000	
東亜建設	6,000	2,360.00	14,160,000	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	20,000	592.00	11,840,000	
若築建設	3,600	2,130.00	7,668,000	貸付株式数 1,400株
東洋建設	24,200	568.00	13,745,600	
五洋建設	90,100	745.00	67,124,500	
世紀東急	10,200	873.00	8,904,600	
福田組	2,400	4,950.00	11,880,000	
日本ドライケミカル	1,600	2,094.00	3,350,400	貸付株式数 600株
住友林業	54,400	2,185.00	118,864,000	貸付株式数 19,200株
日本基礎技術	6,300	589.00	3,710,700	貸付株式数 1,200株
バコーポレーション	8,400	479.00	4,023,600	
大和ハウス	194,300	3,585.00	696,565,500	
ライト工業	12,200	1,969.00	24,021,800	
積水ハウス	227,900	2,292.50	522,460,750	
日特建設	5,300	743.00	3,937,900	
北陸電気工事	3,400	1,335.00	4,539,000	貸付株式数 400株
ユアテック	12,100	738.00	8,929,800	
日本リーテック	4,400	1,700.00	7,480,000	貸付株式数 1,700株
四電工	1,200	3,465.00	4,158,000	
中電工	10,100	2,349.00	23,724,900	貸付株式数 1,300株
関電工	34,900	964.00	33,643,600	
きんでん	42,200	1,946.00	82,121,200	
東京エネシス	6,700	1,101.00	7,376,700	
トーエネック	2,000	3,820.00	7,640,000	
住友電設	5,900	2,357.00	13,906,300	貸付株式数 800株
日本電設工業	11,100	1,859.00	20,634,900	貸付株式数 1,700株
協和エクシオ	32,300	2,842.00	91,796,600	
新日本空調	5,400	2,500.00	13,500,000	貸付株式数 1,400株
日本工営	3,800	3,275.00	12,445,000	
九電工	14,800	4,180.00	61,864,000	
三機工業	15,500	1,563.00	24,226,500	
日揮ホールディングス	70,100	960.00	67,296,000	

中外炉工業	2,400	1,804.00	4,329,600		
ヤマト	6,800	772.00	5,249,600	貸付株式数	600株
太平電業	4,900	2,879.00	14,107,100		
高砂熱学	18,700	2,196.00	41,065,200		
三晃金属	900	2,266.00	2,039,400		
N E C ネットエスアイ	22,300	2,170.00	48,391,000		
朝日工業社	1,400	3,455.00	4,837,000		
明星工業	13,100	760.00	9,956,000		
大 気 社	10,100	3,620.00	36,562,000	貸付株式数	3,100株
ダイダン	4,600	2,851.00	13,114,600		
日比谷総合設備	6,700	1,933.00	12,951,100	貸付株式数	2,300株
ニッポン	19,500	1,666.00	32,487,000	貸付株式数	7,700株
日清製粉 G 本社	76,200	1,888.00	143,865,600		
日東富士製粉	500	6,870.00	3,435,000		
昭和産業	5,900	2,815.00	16,608,500		
鳥越製粉	6,400	794.00	5,081,600	貸付株式数	200株
中部飼料	8,400	1,146.00	9,626,400	貸付株式数	3,100株
フィード・ワン	9,300	768.00	7,142,400		
東洋精糖	1,500	1,172.00	1,758,000		
日本甜菜糖	3,500	1,650.00	5,775,000		
D M 三井製糖ホールディ	5,100	1,965.00	10,021,500	貸付株式数	400株
塩水港精糖	10,300	222.00	2,286,600	貸付株式数	1,900株
日新製糖	3,100	1,700.00	5,270,000	貸付株式数	300株
L I F U L L	22,500	362.00	8,145,000	貸付株式数	8,500株
ミクシィ	16,500	2,734.00	45,111,000	貸付株式数	3,200株
ジェイエイシーリクルート メント	5,500	1,965.00	10,807,500	貸付株式数	500株
日本M & A センター	105,500	3,435.00	362,392,500		
メンバーズ	2,400	3,200.00	7,680,000	貸付株式数	700株
中広	1,100	389.00	427,900	貸付株式数	300株
U T グループ	9,400	3,195.00	30,033,000	貸付株式数	3,700株
アイティメディア	2,500	2,308.00	5,770,000	貸付株式数	200株
タケエイ	7,500	1,692.00	12,690,000		
E ・ J ホールディングス	3,500	1,287.00	4,504,500		
夢真ビーネックスグルーフ	17,600	1,318.00	23,196,800	貸付株式数	1,200株
コシダカホールディングス	18,600	598.00	11,122,800	貸付株式数	6,700株
アルトナー	1,600	877.00	1,403,200	貸付株式数	100株
パソナグループ	7,300	3,265.00	23,834,500	貸付株式数	2,700株
C D S	1,500	1,610.00	2,415,000	貸付株式数	100株

リンクアンドモチベーション	14,500	1,044.00	15,138,000	
G C A	8,200	1,376.00	11,283,200	
エス・エム・エス	22,200	4,010.00	89,022,000	
サニーサイドアップG	2,000	748.00	1,496,000	貸付株式数 800株
パーソルホールディングス	64,200	2,702.00	173,468,400	
リニカル	3,700	857.00	3,170,900	貸付株式数 1,400株
クックパッド	21,700	228.00	4,947,600	貸付株式数 7,800株
エスクリ	3,000	508.00	1,524,000	貸付株式数 700株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	679.00	2,104,900	貸付株式数 1,200株
森永製菓	15,700	3,960.00	62,172,000	
中村屋	1,600	3,820.00	6,112,000	
江崎グリコ	18,400	4,245.00	78,108,000	貸付株式数 7,100株
名糖産業	3,200	1,744.00	5,580,800	貸付株式数 1,100株
井村屋グループ	3,800	2,326.00	8,838,800	貸付株式数 900株
不二家	4,100	2,395.00	9,819,500	貸付株式数 1,600株
山崎製パン	50,700	1,864.00	94,504,800	貸付株式数 19,800株
第一屋製パン	1,800	832.00	1,497,600	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,100	5,510.00	6,061,000	
亀田製菓	3,800	4,760.00	18,088,000	貸付株式数 1,000株
寿スピリッツ	6,600	7,280.00	48,048,000	貸付株式数 1,500株
カルビー	30,600	2,773.00	84,853,800	
森永乳業	12,600	7,130.00	89,838,000	
六甲バター	4,500	1,624.00	7,308,000	貸付株式数 200株
ヤクルト	46,400	5,880.00	272,832,000	
明治ホールディングス	44,200	6,980.00	308,516,000	
雪印メグミルク	16,000	2,290.00	36,640,000	貸付株式数 2,300株
プリマハム	9,600	3,080.00	29,568,000	貸付株式数 1,200株
日本ハム	25,700	4,430.00	113,851,000	
林兼産業	2,800	587.00	1,643,600	
丸大食品	6,400	1,813.00	11,603,200	貸付株式数 2,500株
S Foods	6,000	3,170.00	19,020,000	貸付株式数 100株
柿安本店	2,200	2,584.00	5,684,800	貸付株式数 300株
伊藤ハム米久HLDGS	42,800	748.00	32,014,400	
学情	2,800	1,236.00	3,460,800	貸付株式数 900株
スタジオアリス	3,400	2,285.00	7,769,000	貸付株式数 1,200株
クロスキャット	1,800	1,169.00	2,104,200	貸付株式数 600株
シミックホールディングス	3,600	1,530.00	5,508,000	貸付株式数 800株
エプコ	1,500	869.00	1,303,500	
システナ	24,000	2,362.00	56,688,000	貸付株式数 4,600株

N J S	1,600	1,937.00	3,099,200	
デジタルアーツ	3,900	9,120.00	35,568,000	
日鉄ソリューションズ	9,700	3,925.00	38,072,500	
総合警備保障	25,400	5,080.00	129,032,000	
キューブシステム	3,800	1,125.00	4,275,000	貸付株式数 1,300株
いちご	74,300	351.00	26,079,300	貸付株式数 15,000株
WOW WORLD	1,700	1,769.00	3,007,300	貸付株式数 300株
日本駐車場開発	73,500	171.00	12,568,500	
コア	2,600	1,515.00	3,939,000	貸付株式数 1,000株
カカクコム	47,800	3,630.00	173,514,000	
アイロムグループ	2,400	2,143.00	5,143,200	貸付株式数 900株
セントケア・ホールディング	5,200	1,017.00	5,288,400	貸付株式数 1,800株
サイネックス	1,800	672.00	1,209,600	貸付株式数 400株
ルネサンス	4,200	1,194.00	5,014,800	貸付株式数 1,500株
ディップ	10,400	3,920.00	40,768,000	貸付株式数 3,900株
SBSホールディングス	5,400	4,070.00	21,978,000	貸付株式数 200株
デジタルホールディングス	4,900	1,723.00	8,442,700	貸付株式数 1,700株
新日本科学	8,100	873.00	7,071,300	
キャリアデザインセンター	1,600	1,216.00	1,945,600	貸付株式数 600株
ベネフィット・ワン	23,500	5,170.00	121,495,000	
エムスリー	113,600	7,969.00	905,278,400	
ツカダ・グローバルHOLD	4,900	353.00	1,729,700	貸付株式数 700株
プラス	1,400	526.00	736,400	貸付株式数 300株
アウトソーシング	37,400	2,020.00	75,548,000	貸付株式数 14,000株
ウェルネット	6,300	516.00	3,250,800	貸付株式数 2,400株
ワールドホールディングス	2,600	2,801.00	7,282,600	貸付株式数 800株
ディー・エヌ・エー	27,800	2,075.00	57,685,000	
博報堂DYHLDGS	89,100	1,881.00	167,597,100	
ぐるなび	11,100	504.00	5,594,400	貸付株式数 4,300株
タカミヤ	7,500	481.00	3,607,500	貸付株式数 2,500株
ジャパンベストレスキュー	5,000	1,110.00	5,550,000	
ファンコミュニケーションズ	16,400	428.00	7,019,200	貸付株式数 6,300株
ライク	1,900	1,826.00	3,469,400	
ビジネス・ブレークスルー	3,000	455.00	1,365,000	貸付株式数 900株
エスプール	19,100	1,007.00	19,233,700	
WDBホールディングス	3,000	3,580.00	10,740,000	

手間いらず	1,000	5,800.00	5,800,000	貸付株式数	300株
ティア	3,600	508.00	1,828,800	貸付株式数	1,300株
C D G	500	1,571.00	785,500	貸付株式数	200株
バリューコマース	5,300	4,650.00	24,645,000	貸付株式数	1,500株
インフォマート	71,500	1,047.00	74,860,500	貸付株式数	27,600株
サッポロホールディングス	22,800	2,479.00	56,521,200		
アサヒグループホールディングン	158,600	5,377.00	852,792,200		
キリンHD	247,600	2,071.50	512,903,400	貸付株式数	112,200株
宝ホールディングス	50,200	1,563.00	78,462,600		
オエノンホールディングス	19,900	388.00	7,721,200		
養命酒	2,300	1,852.00	4,259,600	貸付株式数	800株
コカ・コーラボトラーズJHD	47,200	1,589.00	75,000,800	貸付株式数	20,200株
サントリー食品インター	45,200	4,600.00	207,920,000	貸付株式数	17,600株
ダイドーグループHD	3,800	5,770.00	21,926,000	貸付株式数	1,400株
伊藤園	20,500	7,230.00	148,215,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,900	2,258.00	15,580,200	貸付株式数	2,500株
ユニカフェ	2,500	1,055.00	2,637,500		
ジャパンフーズ	1,000	1,244.00	1,244,000		
日清オイリオグループ	8,500	3,170.00	26,945,000	貸付株式数	3,200株
不二製油グループ	16,500	2,584.00	42,636,000		
かどや製油	700	4,065.00	2,845,500	貸付株式数	200株
J-オイルミルズ	6,200	1,853.00	11,488,600	貸付株式数	2,400株
ローソン	16,600	5,580.00	92,628,000		
サンエー	4,800	4,175.00	20,040,000		
カワチ薬品	4,600	2,340.00	10,764,000	貸付株式数	800株
エービーシー・マート	10,300	5,970.00	61,491,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	779.00	1,947,500	貸付株式数	1,000株
高千穂交易	2,500	1,212.00	3,030,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	11,200	1,701.00	19,051,200	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	8,900	1,203.00	10,706,700	貸付株式数	3,400株
アダストリア	9,400	1,892.00	17,784,800	貸付株式数	3,500株
ジーフット	3,000	409.00	1,227,000	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	412.00	412,000	貸付株式数	400株
オルバヘルスケアHLDGS	1,100	1,580.00	1,738,000		
伊藤忠食品	1,600	5,420.00	8,672,000	貸付株式数	100株

くら寿司	7,100	4,130.00	29,323,000	貸付株式数	2,800株
キャンドウ	3,600	1,939.00	6,980,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,800	1,186.00	6,878,800	貸付株式数	1,200株
パルグループHLDGS	5,900	1,709.00	10,083,100		
JALUX	1,700	1,761.00	2,993,700	貸付株式数	700株
エディオン	27,500	1,092.00	30,030,000	貸付株式数	10,800株
あらた	5,100	4,465.00	22,771,500	貸付株式数	300株
サーラコーポレーション	13,600	624.00	8,486,400	貸付株式数	5,400株
ワッツ	3,400	885.00	3,009,000	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	900	5,470.00	4,923,000	貸付株式数	300株
ハローズ	2,700	3,075.00	8,302,500	貸付株式数	1,000株
J Pホールディングス	18,800	279.00	5,245,200	貸付株式数	6,900株
フジオフードG本社	5,600	1,370.00	7,672,000	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,300	2,915.00	3,789,500	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,200	6,400.00	14,080,000		
ひらまつ	12,700	207.00	2,628,900	貸付株式数	1,500株
フィールズ	5,900	494.00	2,914,600	貸付株式数	700株
双日	367,400	343.00	126,018,200		
アルフレッサホールディングス	68,600	1,808.00	124,028,800		
大黒天物産	2,200	7,280.00	16,016,000	貸付株式数	800株
ハニーズホールディングス	5,000	1,110.00	5,550,000		
ファーマライズHD	1,500	780.00	1,170,000	貸付株式数	600株
キッコーマン	48,500	9,120.00	442,320,000		
味の素	160,300	3,430.00	549,829,000		
キューピー	37,800	2,715.00	102,627,000	貸付株式数	14,700株
ハウス食品G本社	25,100	3,675.00	92,242,500		
カゴメ	25,400	3,000.00	76,200,000	貸付株式数	10,400株
焼津水産化工	3,100	996.00	3,087,600	貸付株式数	600株
アリアケジャパン	6,200	6,540.00	40,548,000		
ピエトロ	900	1,819.00	1,637,100	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	2,607.00	4,431,900		
やまみ	800	1,982.00	1,585,600		
ニチレイ	32,100	2,892.00	92,833,200		
横浜冷凍	17,400	908.00	15,799,200	貸付株式数	6,900株
東洋水産	34,700	4,730.00	164,131,000		
イトアンドHLDGS	2,300	2,209.00	5,080,700	貸付株式数	900株
大冷	1,100	2,003.00	2,203,300	貸付株式数	200株

ヨシムラ・フード・HLDGS	4,000	773.00	3,092,000	貸付株式数	1,400株
日清食品HD	26,400	8,740.00	230,736,000		
永谷園ホールディングス	3,500	2,162.00	7,567,000	貸付株式数	1,200株
一正蒲鉾	2,800	935.00	2,618,000		
フジッコ	7,500	1,913.00	14,347,500		
ロックフィールド	7,500	1,594.00	11,955,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	360,400	2,191.50	789,816,600	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,545.00	6,180,000	貸付株式数	1,600株
わらべや日洋HD	4,600	2,430.00	11,178,000	貸付株式数	1,600株
なとり	4,100	1,972.00	8,085,200		
イフジ産業	1,500	956.00	1,434,000	貸付株式数	300株
ピクルスコーポレーション	3,400	1,970.00	6,698,000		
北の達人コーポ	24,000	504.00	12,096,000	貸付株式数	9,400株 (2,500株)
ユウグレナ	35,300	900.00	31,770,000	貸付株式数	13,400株
スター・マイカ・HLDGS	3,500	1,402.00	4,907,000	貸付株式数	1,300株
ADワークスグループ	13,100	160.00	2,096,000		
片倉工業	8,800	1,528.00	13,446,400	貸付株式数	2,800株
グンゼ	4,800	4,565.00	21,912,000		
ヒューリック	139,700	1,348.00	188,315,600	貸付株式数	54,800株
神栄	1,200	1,084.00	1,300,800		
ラサ商事	3,300	920.00	3,036,000	貸付株式数	900株
アルペン	5,300	3,535.00	18,735,500	貸付株式数	2,000株
ハブ	2,100	743.00	1,560,300	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	5,000	1,518.00	7,590,000	貸付株式数	1,800株
クオールホールディングス	8,800	1,603.00	14,106,400		
アルコニックス	7,200	1,686.00	12,139,200		
神戸物産	51,600	4,430.00	228,588,000	貸付株式数	20,100株
ソリトンシステムズ	3,600	1,525.00	5,490,000		
ジンスホールディングス	4,600	7,540.00	34,684,000	貸付株式数	1,700株
ビックカメラ	38,500	1,089.00	41,926,500	貸付株式数	10,400株
DCMホールディングス	40,700	1,098.00	44,688,600		
ペッパーフードサービス	9,200	382.00	3,514,400	貸付株式数	2,400株 (300株)
ハイパー	1,600	541.00	865,600		
Monotaro	84,200	2,504.00	210,836,800	貸付株式数	32,800株
東京一番フーズ	1,600	600.00	960,000	貸付株式数	600株

DDホールディングス	3,400	479.00	1,628,600	貸付株式数	1,200株
あいホールディングス	9,300	2,379.00	22,124,700		
ディーブイエックス	2,100	1,052.00	2,209,200	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	617.00	863,800		
アークランドサービスHD	5,500	2,298.00	12,639,000	貸付株式数	2,100株
J. フロントリテイリング	79,400	1,017.00	80,749,800		
ドトール・日レスHD	10,400	1,669.00	17,357,600		
マツモトキヨシHLDGS	27,500	5,400.00	148,500,000		
ブロンコビリー	3,600	2,500.00	9,000,000	貸付株式数	1,400株
ZOZO	39,200	3,955.00	155,036,000		
トレジャー・ファクトリー	2,100	933.00	1,959,300		
物語コーポレーション	3,700	7,000.00	25,900,000	貸付株式数	1,300株
ココカラファイン	5,900	9,180.00	54,162,000		
三越伊勢丹HD	116,500	789.00	91,918,500		
東洋紡	25,600	1,413.00	36,172,800		
ユニチカ	18,500	356.00	6,586,000		
富士紡ホールディングス	3,200	4,375.00	14,000,000		
日清紡ホールディングス	40,400	844.00	34,097,600		
倉敷紡績	5,600	1,998.00	11,188,800	貸付株式数	1,200株
ダイワボウHD	30,300	2,109.00	63,902,700		
シキボウ	3,700	942.00	3,485,400	貸付株式数	1,400株
日東紡績	10,000	3,620.00	36,200,000		
トヨタ紡織	19,800	2,125.00	42,075,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	16,000	2,728.00	43,648,000	貸付株式数	1,800株
Hamee	1,900	1,621.00	3,079,900	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,795.00	8,385,000	貸付株式数	1,100株
ウエルシアHD	35,200	4,050.00	142,560,000		
クリエイトSDH	9,700	3,990.00	38,703,000	貸付株式数	3,800株
バイタルKSKHD	11,300	820.00	9,266,000	貸付株式数	2,200株
八洲電機	4,600	1,017.00	4,678,200	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	3,900	916.00	3,572,400	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,500	1,976.00	12,844,000		
ジューテックHD	1,400	1,113.00	1,558,200	貸付株式数	500株
丸善CHIHD	5,100	390.00	1,989,000	貸付株式数	2,500株
大光	3,000	696.00	2,088,000	貸付株式数	900株
OCHIホールディングス	1,900	1,290.00	2,451,000	貸付株式数	200株

TO K A Iホールディングス	31,500	921.00	29,011,500		
黒谷	2,400	840.00	2,016,000	貸付株式数	600株
ミサワ	1,900	686.00	1,303,400		
ティーライフ	1,400	1,560.00	2,184,000	貸付株式数	300株
Cominix	1,300	728.00	946,400	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	457.00	776,900	貸付株式数	500株
三洋貿易	6,900	1,225.00	8,452,500		
チムニー	2,100	1,490.00	3,129,000	貸付株式数	800株
シュッピン	4,800	1,186.00	5,692,800	貸付株式数	1,700株
ビューティガレージ	1,200	4,810.00	5,772,000		
オイシックス・ラ・大地	9,000	3,885.00	34,965,000	貸付株式数	3,400株
ウイン・パートナーズ	4,600	998.00	4,590,800	貸付株式数	500株
ネクステージ	13,700	2,226.00	30,496,200		
ジョイフル本田	18,600	1,508.00	28,048,800	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,600	1,886.00	4,903,600	貸付株式数	900株
ホットランド	4,600	1,323.00	6,085,800	貸付株式数	1,800株 (200株)
すかいらくHD	92,600	1,590.00	147,234,000	貸付株式数	31,000株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,900	1,411.00	4,091,900	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	4,900	1,282.00	6,281,800	貸付株式数	1,900株
日本毛織	20,200	1,038.00	20,967,600	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	12,100	101.00	1,222,100	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,300	435.00	1,000,500	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	7,600	171.00	1,299,600	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,300	2,194.00	2,852,200	貸付株式数	500株
ユナイテッド・スーパー マケ	19,000	1,140.00	21,660,000	貸付株式数	7,400株
三栄建築設計	3,000	1,917.00	5,751,000		
野村不動産HLDGS	38,300	3,025.00	115,857,500		
三重交通グループHD	12,800	519.00	6,643,200	貸付株式数	5,100株
サムティ	9,700	2,303.00	22,339,100	貸付株式数	3,700株
日本商業開発	4,600	1,728.00	7,948,800	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	11,000	1,858.00	20,438,000	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,300	2,867.00	3,727,100	貸付株式数	400株
ハウスコム	1,200	1,279.00	1,534,800	貸付株式数	200株

日本管理センター	3,700	1,288.00	4,765,600		
サンセイランディック	2,000	821.00	1,642,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	664.00	730,400		
フージャースHD	10,400	675.00	7,020,000		
オープンハウス	21,200	5,610.00	118,932,000		
東急不動産HD	180,400	681.00	122,852,400		
飯田GHD	55,300	2,840.00	157,052,000		
イーグランド	1,300	1,483.00	1,927,900	貸付株式数	200株
帝国繊維	7,600	2,095.00	15,922,000	貸付株式数	1,700株
日本コークス工業	58,300	130.00	7,579,000		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,380.00	5,382,000	貸付株式数	200株
ミタチ産業	1,100	799.00	878,900	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,600	3,080.00	11,088,000	貸付株式数	1,300株
あさひ	5,000	1,401.00	7,005,000	貸付株式数	2,000株
日本調剤	4,200	1,768.00	7,425,600	貸付株式数	1,000株
コスモス薬品	6,700	20,230.00	135,541,000	貸付株式数	2,600株
シップヘルスケアHD	23,500	2,875.00	67,562,500		
トーエル	3,100	878.00	2,721,800		
ソフトクリエイイトHD	2,700	3,265.00	8,815,500		
オンリー	1,100	763.00	839,300		
セブン&アイ・HLDGS	258,800	5,069.00	1,311,857,200		
クリエイイト・レストランツ・ホール	36,200	875.00	31,675,000	貸付株式数	13,900株
明治電機工業	2,100	1,350.00	2,835,000	貸付株式数	300株
ツルハホールディングス	14,500	14,160.00	205,320,000		
デリカフーズHLDGS	3,500	665.00	2,327,500	貸付株式数	900株
スターティアホールディングス	1,600	1,789.00	2,862,400	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,100	1,577.00	8,042,700	貸付株式数	700株
フェリシモ	1,700	1,500.00	2,550,000	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	16,600	2,394.00	39,740,400	貸付株式数	6,400株
帝人	61,600	1,617.00	99,607,200		
東レ	476,300	759.60	361,797,480		
クラレ	96,300	1,063.00	102,366,900	貸付株式数	37,600株
旭化成	435,400	1,174.50	511,377,300		
サカイオーベックス	1,700	3,800.00	6,460,000		
TOKYO BASE	6,900	630.00	4,347,000	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	4,900	1,496.00	7,330,400	貸付株式数	1,400株

宮地エンジニアリングG	2,300	2,667.00	6,134,100	貸付株式数	800株
トーカロ	16,700	1,396.00	23,313,200		
アルファCO	2,200	1,251.00	2,752,200	貸付株式数	800株
SUMCO	84,600	2,514.00	212,684,400	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,300	3,830.00	4,979,000		
RS TECHNOLOGIES	2,200	6,320.00	13,904,000		
信和	3,500	730.00	2,555,000		
ビーロット	4,700	557.00	2,617,900		
ファーストブラザーズ	1,200	1,018.00	1,221,600	貸付株式数	400株
ハウストゥ	3,300	1,031.00	3,402,300	貸付株式数	1,300株
シーアールイー	1,900	1,946.00	3,697,400	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,400	3,175.00	4,445,000	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	2,300	5,310.00	12,213,000	貸付株式数	800株
アグレ都市デザイン	1,700	1,025.00	1,742,500	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,400	3,400.00	4,760,000		
テンポイノベーション	2,200	925.00	2,035,000	貸付株式数	700株
グローバルリンクマネジメント	1,300	939.00	1,220,700	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	1,919.00	2,686,600	貸付株式数	200株
日本フェルト	3,000	455.00	1,365,000		
イチカワ	800	1,368.00	1,094,400		
エコナックホールディングス	13,500	88.00	1,188,000	貸付株式数	900株
日東製網	900	1,522.00	1,369,800		
芦森工業	1,200	1,049.00	1,258,800	貸付株式数	300株
アツギ	5,200	640.00	3,328,000	貸付株式数	1,200株
ウイルプラスHLDGS	1,200	993.00	1,191,600	貸付株式数	400株
JMホールディングス	4,900	2,337.00	11,451,300		
コメダホールディングス	14,600	2,059.00	30,061,400	貸付株式数	5,700株
サツドラホールディングス	900	2,168.00	1,951,200		
アレンザホールディングス	4,900	1,432.00	7,016,800	貸付株式数	300株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,900	2,049.00	3,893,100	貸付株式数	700株
パロックジャパン	4,900	863.00	4,228,700	貸付株式数	1,700株
クスリのアオキHLDGS	6,600	8,130.00	53,658,000	貸付株式数	2,600株
ダイニック	2,500	753.00	1,882,500	貸付株式数	1,000株
共和レザー	3,300	695.00	2,293,500	貸付株式数	100株
ピーバンドットコム	1,200	692.00	830,400	貸付株式数	300株
力の源HD	2,300	613.00	1,409,900	貸付株式数	900株

FOOD&LIFE COMPANY	38,900	4,915.00	191,193,500	
アセンテック	2,000	1,274.00	2,548,000	貸付株式数 600株
セーレン	16,400	2,098.00	34,407,200	貸付株式数 6,300株
ソトー	1,800	810.00	1,458,000	貸付株式数 400株
東海染工	800	1,150.00	920,000	貸付株式数 100株
小松マテーレ	10,500	994.00	10,437,000	貸付株式数 3,300株
ワコールホールディングス	16,300	2,404.00	39,185,200	
ホギメディカル	8,700	3,465.00	30,145,500	貸付株式数 3,300株
クラウドシアHLDGS	2,100	296.00	621,600	貸付株式数 600株
TSIホールディングス	19,700	336.00	6,619,200	貸付株式数 7,700株
マツオカコーポレーション	2,000	1,471.00	2,942,000	貸付株式数 800株
ワールド	8,500	1,423.00	12,095,500	貸付株式数 2,900株
TIS	66,300	3,250.00	215,475,000	
JNSホールディングス	4,300	544.00	2,339,200	貸付株式数 1,300株
グリー	42,600	675.00	28,755,000	貸付株式数 4,100株
コーエーテクモHD	17,900	5,220.00	93,438,000	
三菱総合研究所	2,800	4,400.00	12,320,000	
ボルテージ	3,100	445.00	1,379,500	貸付株式数 400株
電算	800	2,338.00	1,870,400	貸付株式数 200株
AGS	3,100	897.00	2,780,700	貸付株式数 1,200株
ファインデックス	6,100	1,064.00	6,490,400	貸付株式数 2,100株
ブレインパッド	1,900	5,820.00	11,058,000	
KLab	12,000	685.00	8,220,000	貸付株式数 4,700株
ポールトゥウィン・ピットクル	8,900	1,053.00	9,371,700	
イーブックイニシアティブ	1,300	3,775.00	4,907,500	貸付株式数 400株
ネクソン	148,600	2,296.00	341,185,600	
アイスタイル	21,600	438.00	9,460,800	貸付株式数 7,900株
エムアップホールディングス	2,000	3,080.00	6,160,000	貸付株式数 600株
エイチーム	5,100	1,503.00	7,665,300	貸付株式数 1,700株
エニグモ	6,500	1,528.00	9,932,000	
テクノスジャパン	5,300	638.00	3,381,400	貸付株式数 1,400株
enish	3,900	502.00	1,957,800	貸付株式数 1,400株
コロプラ	21,300	855.00	18,211,500	貸付株式数 1,900株
オルトプラス	5,100	455.00	2,320,500	貸付株式数 400株
ブロードリーフ	33,800	535.00	18,083,000	貸付株式数 12,800株
クロス・マーケティングG	3,300	939.00	3,098,700	貸付株式数 1,100株
デジタルハーツHLDGS	3,400	2,064.00	7,017,600	貸付株式数 1,000株

システム情報	5,400	1,020.00	5,508,000	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,800	5,310.00	14,868,000	貸付株式数	1,000株
じげん	17,000	423.00	7,191,000		
ブイキューブ	7,000	1,845.00	12,915,000	貸付株式数	2,600株
エンカレッジ・テクノロジー	1,100	631.00	694,100	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,600	1,612.00	4,191,200	貸付株式数	800株
ディー・エル・イー	4,300	315.00	1,354,500		
フィックスターズ	7,100	805.00	5,715,500	貸付株式数	2,700株
CARTA HOLDINGS	3,000	2,251.00	6,753,000	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,000	2,060.00	10,300,000	貸付株式数	1,800株
セレス	2,600	3,230.00	8,398,000	貸付株式数	800株
SHIFT	3,400	26,230.00	89,182,000	貸付株式数	500株
特種東海製紙	3,900	4,555.00	17,764,500		
ティーガイア	6,700	2,007.00	13,446,900	貸付株式数	2,700株
セック	1,000	2,445.00	2,445,000	貸付株式数	300株
テクマトリックス	11,100	1,981.00	21,989,100		
プロシッパ	2,200	1,658.00	3,647,600		
ガンホー・オンライン・エンター	17,800	2,290.00	40,762,000	貸付株式数	7,000株
GMOペイメントゲートウェイ	12,900	15,020.00	193,758,000		
ザッパラス	4,100	600.00	2,460,000		
システムリサーチ	2,100	2,052.00	4,309,200	貸付株式数	700株
インターネットイニシアティブ	18,000	4,010.00	72,180,000		
さくらインターネット	7,800	639.00	4,984,200	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,900	1,037.00	1,970,300	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,600	5,330.00	8,528,000	貸付株式数	500株 (400株)
SRAホールディングス	3,600	2,841.00	10,227,600		
システムインテグレータ	1,800	638.00	1,148,400	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,000	746.00	4,476,000	貸付株式数	700株
eBASE	8,600	814.00	7,000,400	貸付株式数	3,100株
アバント	7,700	1,517.00	11,680,900		
アドソル日進	2,700	2,288.00	6,177,600	貸付株式数	900株
フリービット	4,700	850.00	3,995,000	貸付株式数	1,500株
コムチュア	6,200	3,070.00	19,034,000	貸付株式数	900株
サイバーコム	1,100	1,322.00	1,454,200	貸付株式数	400株
アステリア	5,200	703.00	3,655,600	貸付株式数	1,800株

アイル	3,900	1,930.00	7,527,000	貸付株式数	400株
王子ホールディングス	297,600	584.00	173,798,400		
日本製紙	29,500	1,213.00	35,783,500	貸付株式数	11,300株
三菱製紙	7,800	379.00	2,956,200		
北越コーポレーション	48,700	642.00	31,265,400	貸付株式数	14,300株
中越パルプ	2,300	1,238.00	2,847,400		
巴川製紙	2,100	907.00	1,904,700	貸付株式数	500株
大王製紙	31,800	2,132.00	67,797,600		
阿波製紙	1,600	396.00	633,600	貸付株式数	100株
マークライنز	3,600	2,938.00	10,576,800		
メディカル・データ・ビジ	8,900	1,699.00	15,121,100	貸付株式数	3,300株
g u m i	9,500	988.00	9,386,000	貸付株式数	3,500株
ショーケース	1,900	669.00	1,271,100	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	2,100	1,083.00	2,274,300	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,500	2,170.00	5,425,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメー ション	3,400	2,005.00	6,817,000	貸付株式数	1,100株
P C Iホールディングス	3,600	1,127.00	4,057,200	貸付株式数	1,100株
パイプドHD	1,600	2,489.00	3,982,400	貸付株式数	500株
アイビーシー	1,400	855.00	1,197,000	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,700	1,523.00	2,589,100	貸付株式数	400株
P R T I M E S	1,800	3,110.00	5,598,000	貸付株式数	500株
ラクス	20,400	3,895.00	79,458,000		
ランドコンピュータ	1,000	1,262.00	1,262,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	1,000	7,710.00	7,710,000	貸付株式数	100株
オープンドア	4,300	2,314.00	9,950,200	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,600	692.00	1,799,200	貸付株式数	900株
アカツキ	2,900	3,290.00	9,541,000		
ベネフィットジャパン	700	2,356.00	1,649,200		
U B I C O Mホールディ ングス	2,000	3,070.00	6,140,000	貸付株式数	600株
カナミックネットワーク	7,500	622.00	4,665,000	貸付株式数	700株
ノムラシステムコーポー レーション	3,900	301.00	1,173,900	貸付株式数	1,300株
レンゴー	68,300	904.00	61,743,200		
トーモク	4,100	1,937.00	7,941,700		
ザ・パック	4,800	2,982.00	14,313,600	貸付株式数	1,000株
チェンジ	12,600	2,453.00	30,907,800		
シンクロ・フード	5,200	407.00	2,116,400	貸付株式数	1,500株
オークネット	3,900	1,933.00	7,538,700	貸付株式数	800株

セグエグループ	2,000	821.00	1,642,000		
エイトレッド	1,600	2,442.00	3,907,200	貸付株式数	400株
マクロミル	13,500	804.00	10,854,000	貸付株式数	1,300株
ビーグリー	1,700	1,472.00	2,502,400		
オロ	2,300	3,850.00	8,855,000		
ユーザーローカル	2,700	2,014.00	5,437,800	貸付株式数	700株
テモナ	2,000	810.00	1,620,000	貸付株式数	500株
ニーズウェル	1,800	723.00	1,301,400	貸付株式数	300株
サインポスト	1,800	700.00	1,260,000	貸付株式数	600株
昭和電工	47,000	2,570.00	120,790,000	貸付株式数	18,300株
住友化学	518,100	584.00	302,570,400		
住友精化	3,200	3,645.00	11,664,000		
日産化学	36,000	6,640.00	239,040,000		
ラサ工業	2,200	1,919.00	4,221,800	貸付株式数	300株
クレハ	5,600	7,880.00	44,128,000		
多木化学	2,600	6,500.00	16,900,000	貸付株式数	800株
テイカ	4,600	1,356.00	6,237,600		
石原産業	12,100	1,204.00	14,568,400		
片倉コープアグリ	1,600	1,215.00	1,944,000	貸付株式数	500株
日本曹達	9,100	3,725.00	33,897,500		
東ソー	101,600	2,136.00	217,017,600		
トクヤマ	19,300	2,275.00	43,907,500		
セントラル硝子	12,000	2,200.00	26,400,000		
東亜合成	39,000	1,321.00	51,519,000	貸付株式数	14,600株
大阪ソーダ	6,400	2,785.00	17,824,000		
関東電化	15,000	1,101.00	16,515,000		
デンカ	24,000	4,005.00	96,120,000		
イビデン	32,600	6,450.00	210,270,000		
信越化学	121,600	19,835.00	2,411,936,000		
日本カ - バイド	2,200	1,396.00	3,071,200	貸付株式数	300株
電算システムHD	2,900	2,838.00	8,230,200		
堺 化 学	4,400	2,221.00	9,772,400		
第一稀元素化学工	7,300	1,679.00	12,256,700	貸付株式数	300株
エア・ウォーター	67,300	1,893.00	127,398,900		
日本酸素HLDGS	54,300	2,956.00	160,510,800		
日本化学工業	1,900	3,565.00	6,773,500	貸付株式数	100株
東邦アセチレン	1,200	1,463.00	1,755,600	貸付株式数	300株
日本パ - カライジング	32,000	1,213.00	38,816,000		
高压ガス	9,800	749.00	7,340,200		
チタン工業	900	1,841.00	1,656,900	貸付株式数	300株

四国化成	8,000	1,424.00	11,392,000	
戸田工業	1,500	3,075.00	4,612,500	貸付株式数 300株
ステラ ケミファ	3,500	2,898.00	10,143,000	貸付株式数 1,400株
保土谷化学	1,900	5,240.00	9,956,000	貸付株式数 400株
日本触媒	11,700	5,970.00	69,849,000	
大日精化	5,000	2,662.00	13,310,000	
カネカ	17,000	4,660.00	79,220,000	
協和キリン	79,000	4,025.00	317,975,000	
三菱瓦斯化学	65,800	2,324.00	152,919,200	
三井化学	57,000	3,885.00	221,445,000	
J S R	66,300	4,035.00	267,520,500	
東京応化工業	11,400	7,440.00	84,816,000	貸付株式数 4,400株
大阪有機化学	6,100	3,975.00	24,247,500	
三菱ケミカルH L D G S	439,100	990.80	435,060,280	
K H ネオケム	11,100	3,070.00	34,077,000	貸付株式数 1,900株
ダイセル	88,500	909.00	80,446,500	
住友ベークライト	10,400	5,270.00	54,808,000	
積水化学	137,300	1,986.00	272,677,800	
日本ゼオン	59,300	1,607.00	95,295,100	
アイカ工業	18,200	3,790.00	68,978,000	
宇部興産	33,100	2,312.00	76,527,200	
積水樹脂	10,200	2,258.00	23,031,600	貸付株式数 300株
タキロンシーアイ	13,800	649.00	8,956,200	
旭有機材	3,600	1,518.00	5,464,800	
ニチバン	3,200	1,836.00	5,875,200	貸付株式数 1,200株
リケンテクノス	16,200	602.00	9,752,400	
大倉工業	3,500	2,249.00	7,871,500	貸付株式数 100株
積水化成成品	7,900	610.00	4,819,000	
群栄化学	1,400	2,875.00	4,025,000	
タイガース ポリマー	2,200	438.00	963,600	貸付株式数 200株
ミライアル	1,900	1,483.00	2,817,700	
ダイキアクシス	2,600	890.00	2,314,000	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	13,700	702.00	9,617,400	貸付株式数 5,400株
竹本容器	2,900	933.00	2,705,700	
森六ホールディングス	3,500	2,181.00	7,633,500	
日本化薬	39,900	1,270.00	50,673,000	
カーリットホールディングス	6,300	870.00	5,481,000	貸付株式数 300株
ソルクシーズ	3,000	1,037.00	3,111,000	貸付株式数 1,000株
レグス	1,700	2,300.00	3,910,000	貸付株式数 600株

プレステージ・インター	23,600	792.00	18,691,200		
フェイス	2,500	719.00	1,797,500		
プロトコーポレーション	8,100	1,569.00	12,708,900	貸付株式数	1,300株
ハイマックス	2,200	1,105.00	2,431,000	貸付株式数	700株
アミューズ	3,500	2,374.00	8,309,000	貸付株式数	900株
野村総合研究所	114,800	4,395.00	504,546,000		
ドリームインキュベータ	2,100	931.00	1,955,100	貸付株式数	100株
サイバネットシステム	5,300	700.00	3,710,000	貸付株式数	1,800株
クイック	3,900	1,409.00	5,495,100	貸付株式数	500株
T A C	4,000	246.00	984,000	貸付株式数	200株
C E ホールディングス	3,800	589.00	2,238,200	貸付株式数	1,300株
日本システム技術	1,200	1,805.00	2,166,000		
電通グループ	66,200	4,200.00	278,040,000		
インテージホールディングス	8,800	1,659.00	14,599,200	貸付株式数	1,400株
テイクアンドギヴニーズ	3,400	1,080.00	3,672,000	貸付株式数	300株
東邦システムサイエンス	1,400	963.00	1,348,200	貸付株式数	600株
びあ	1,900	3,390.00	6,441,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,500	1,954.00	4,885,000	貸付株式数	900株
ソースネクスト	33,400	238.00	7,949,200	貸付株式数	11,700株
シーティーエス	7,300	816.00	5,956,800	貸付株式数	2,800株
ネクシィーズグループ	2,300	908.00	2,088,400	貸付株式数	800株
インフォコム	6,600	2,521.00	16,638,600		
メディカルシステムネットワーク	6,200	787.00	4,879,400	貸付株式数	700株
日本精化	4,800	2,234.00	10,723,200	貸付株式数	1,400株
扶桑化学工業	5,300	4,910.00	26,023,000		
トリケミカル	6,400	3,605.00	23,072,000	貸付株式数	1,300株
HEROZ	2,000	2,008.00	4,016,000	貸付株式数	700株 (700株)
ラクスル	7,400	5,940.00	43,956,000	貸付株式数	2,000株
F I G	6,800	285.00	1,938,000	貸付株式数	900株
システムサポート	1,900	1,359.00	2,582,100		
A D E K A	30,200	2,659.00	80,301,800		
日油	24,900	6,770.00	168,573,000		
ミヨシ油脂	2,300	1,298.00	2,985,400		
新日本理化	13,000	288.00	3,744,000	貸付株式数	4,200株
ハリマ化成グループ	4,700	907.00	4,262,900		
イーソル	4,000	953.00	3,812,000	貸付株式数	1,600株

アルテリア・ネットワークス	7,800	1,773.00	13,829,400	貸付株式数	700株
東海ソフト	1,300	1,300.00	1,690,000	貸付株式数	400株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,900	1,892.00	3,594,800	貸付株式数	500株
トピラスシステムズ	1,600	1,298.00	2,076,800	貸付株式数	100株
Sansan	6,000	11,840.00	71,040,000		
花王	148,300	6,925.00	1,026,977,500	貸付株式数	62,200株
第一工業製薬	2,300	3,415.00	7,854,500		
石原ケミカル	1,700	2,809.00	4,775,300	貸付株式数	700株
日華化学	2,700	1,082.00	2,921,400	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,500	2,337.00	3,505,500	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	6,000.00	23,400,000		
武田薬品	558,400	3,778.00	2,109,635,200		
アステラス製薬	581,900	1,921.00	1,117,829,900		
大日本住友製薬	50,200	2,073.00	104,064,600		
塩野義製薬	84,300	7,489.00	631,322,700		
わかもと製薬	8,500	343.00	2,915,500	貸付株式数	3,100株
日本新薬	19,100	9,290.00	177,439,000		
中外製薬	210,100	4,409.00	926,330,900	貸付株式数	82,400株
科研製薬	11,300	5,150.00	58,195,000		
エーザイ	74,400	9,151.00	680,834,400		
理研ビタミン	6,400	1,866.00	11,942,400		
ロート製薬	31,800	3,555.00	113,049,000		
小野薬品	153,700	2,751.50	422,905,550		
久光製薬	19,400	4,605.00	89,337,000	貸付株式数	7,600株
有機合成薬品	5,700	337.00	1,920,900	貸付株式数	2,000株
持田製薬	9,200	3,660.00	33,672,000		
参天製薬	117,000	1,703.00	199,251,000		
扶桑薬品	2,100	2,560.00	5,376,000		
日本ケミファ	800	2,242.00	1,793,600	貸付株式数	300株
ツムラ	22,500	3,875.00	87,187,500	貸付株式数	6,800株
日医工	19,000	929.00	17,651,000	貸付株式数	7,400株
テルモ	205,800	5,070.00	1,043,406,000		
HUGグループHD	18,100	3,220.00	58,282,000	貸付株式数	800株
キッセイ薬品工業	11,500	2,524.00	29,026,000		
生化学工業	11,500	1,110.00	12,765,000		
栄研化学	12,000	2,270.00	27,240,000		
日水製薬	2,500	1,026.00	2,565,000		
鳥居薬品	4,200	2,980.00	12,516,000		

J C R ファーマ	19,300	2,978.00	57,475,400		
東和薬品	9,800	3,155.00	30,919,000		
富士製薬工業	4,500	1,169.00	5,260,500		
ゼリア新薬工業	12,100	2,197.00	26,583,700	貸付株式数	4,900株
第一三共	527,700	2,790.00	1,472,283,000		
キョーリン製薬HD	14,800	1,880.00	27,824,000		
大幸薬品	10,500	910.00	9,555,000	貸付株式数	3,300株
ダイト	4,300	3,730.00	16,039,000	貸付株式数	1,200株
大塚ホールディングス	139,000	4,970.00	690,830,000	貸付株式数	54,600株
大正製薬HD	16,800	6,590.00	110,712,000		
ペプチドリーム	35,400	3,980.00	140,892,000		
大日本塗料	7,000	882.00	6,174,000		
日本ペイントHOLD	247,600	1,446.00	358,029,600	貸付株式数	97,000株
関西ペイント	74,000	2,992.00	221,408,000		
神東塗料	5,800	196.00	1,136,800		
中国塗料	16,400	893.00	14,645,200		
日本特殊塗料	4,900	1,079.00	5,287,100	貸付株式数	600株
藤倉化成	8,200	557.00	4,567,400		
太陽ホールディングス	4,900	6,150.00	30,135,000		
D I C	27,200	3,245.00	88,264,000	貸付株式数	10,800株
サカタインクス	13,700	1,168.00	16,001,600		
東洋インキS Cホールディングン	13,300	2,084.00	27,717,200	貸付株式数	100株
T & K TOKA	4,600	860.00	3,956,000		
アルプス技研	5,500	2,010.00	11,055,000		
サニックス	10,800	348.00	3,758,400	貸付株式数	4,000株
ダイオーズ	800	1,081.00	864,800	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,300	729.00	4,592,700		
オリエンタルランド	68,100	16,540.00	1,126,374,000		
フォーカスシステムズ	5,600	1,033.00	5,784,800	貸付株式数	1,400株
ダスキン	14,500	2,697.00	39,106,500	貸付株式数	2,700株
パーク24	35,800	2,170.00	77,686,000	貸付株式数	13,900株
明光ネットワークジャパン	8,100	594.00	4,811,400	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,759.00	5,101,100	貸付株式数	1,100株
クレスコ	4,700	2,033.00	9,555,100	貸付株式数	100株
フジ・メディア・HD	68,500	1,191.00	81,583,500		
秀英予備校	2,000	424.00	848,000	貸付株式数	600株
田谷	1,500	585.00	877,500	貸付株式数	600株
ラウンドワン	22,700	1,436.00	32,597,200		
リゾートトラスト	29,800	1,925.00	57,365,000	貸付株式数	11,200株

オービック	20,800	22,120.00	460,096,000	
ジャストシステム	9,500	6,990.00	66,405,000	
TDCソフト	5,900	1,402.00	8,271,800	貸付株式数 1,900株
Zホールディングス	869,700	717.20	623,748,840	
ビー・エム・エル	8,400	4,445.00	37,338,000	
トレンドマイクロ	35,300	6,230.00	219,919,000	
りらいあコミュニケーション	9,900	1,272.00	12,592,800	
IDホールディングス	3,600	958.00	3,448,800	
リソー教育	34,200	417.00	14,261,400	
日本オラクル	13,500	9,560.00	129,060,000	
早稲田アカデミー	2,800	969.00	2,713,200	貸付株式数 1,000株
アルファシステムズ	1,900	4,000.00	7,600,000	貸付株式数 600株
フューチャー	7,900	2,598.00	20,524,200	貸付株式数 300株
CAC HOLDINGS	4,100	1,675.00	6,867,500	
SBテクノロジー	2,800	3,125.00	8,750,000	
トーセ	1,700	787.00	1,337,900	貸付株式数 600株
ユー・エス・エス	71,500	1,931.00	138,066,500	
オービックビジネスC	6,500	5,350.00	34,775,000	貸付株式数 2,500株
伊藤忠テクノソリュー	30,500	3,575.00	109,037,500	
アイティフォー	8,800	876.00	7,708,800	貸付株式数 3,000株
東京個別指導学院	5,700	657.00	3,744,900	貸付株式数 900株
東計電算	900	4,845.00	4,360,500	
サイバーエージェント	159,100	2,177.00	346,360,700	
楽天グループ	330,200	1,104.00	364,540,800	貸付株式数 129,100株
エクスネット	1,600	1,063.00	1,700,800	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,830.00	6,405,000	貸付株式数 1,000株
テー・オー・ダブリュー	10,800	324.00	3,499,200	貸付株式数 4,300株
大塚商会	35,900	6,060.00	217,554,000	貸付株式数 13,900株
サイボウズ	9,200	2,583.00	23,763,600	
山田コンサルティングGP	3,600	1,166.00	4,197,600	貸付株式数 1,000株
セントラルスポーツ	2,400	2,495.00	5,988,000	貸付株式数 900株
パラカ	1,600	1,884.00	3,014,400	貸付株式数 600株
電通国際情報S	9,800	4,580.00	44,884,000	
ACCESS	8,400	1,126.00	9,458,400	貸付株式数 800株
デジタルガレージ	10,900	5,170.00	56,353,000	貸付株式数 400株
イーエムシステムズ	11,700	834.00	9,757,800	貸付株式数 4,200株
ウェザーニューズ	2,100	6,130.00	12,873,000	
CIJ	4,000	879.00	3,516,000	
ビジネスエンジニアリング	800	3,530.00	2,824,000	貸付株式数 200株

日本エンタープライズ	8,400	213.00	1,789,200	貸付株式数	2,700株
WOWOW	3,300	2,476.00	8,170,800	貸付株式数	1,200株
スカラ	6,500	748.00	4,862,000	貸付株式数	400株
インテリジェント ウェイブ	3,700	636.00	2,353,200		
フルキャストホールディングス	5,700	2,241.00	12,773,700	貸付株式数	2,100株
エン・ジャパン	11,500	3,890.00	44,735,000		
あすか製薬HD	7,800	1,099.00	8,572,200		
サワイグループHD	14,800	5,230.00	77,404,000		
富士フイルムHLDS	118,100	9,553.00	1,128,209,300		
コニカミノルタ	137,200	587.00	80,536,400		
資生堂	125,300	7,906.00	990,621,800		
ライオン	81,100	1,917.00	155,468,700	貸付株式数	34,300株
高砂香料	4,200	2,919.00	12,259,800		
マンダム	14,500	1,708.00	24,766,000	貸付株式数	5,300株
ミルボン	8,500	6,730.00	57,205,000		
ファンケル	24,700	3,830.00	94,601,000		
コーセー	12,800	13,470.00	172,416,000		
コタ	4,700	1,645.00	7,731,500	貸付株式数	300株
シーボン	800	1,902.00	1,521,600		
ポーラ・オルビスHD	28,900	2,615.00	75,573,500	貸付株式数	11,200株
ノエビアホールディングス	5,600	5,950.00	33,320,000	貸付株式数	2,100株
アジュバンコスメジャパン	1,900	1,060.00	2,014,000	貸付株式数	500株
エステー	4,200	1,823.00	7,656,600		
アグロカネショウ	2,500	1,499.00	3,747,500	貸付株式数	900株
コニシ	10,900	1,765.00	19,238,500		
長谷川香料	11,500	2,972.00	34,178,000	貸付株式数	3,800株
星光PMC	3,800	864.00	3,283,200		
小林製薬	18,800	9,170.00	172,396,000	貸付株式数	7,300株
荒川化学工業	5,000	1,301.00	6,505,000	貸付株式数	1,700株
メック	5,200	3,620.00	18,824,000	貸付株式数	1,800株
日本高純度化学	2,000	2,900.00	5,800,000	貸付株式数	100株
タカラバイオ	17,700	3,230.00	57,171,000		
JCU	7,500	4,325.00	32,437,500	貸付株式数	300株
新田ゼラチン	4,000	635.00	2,540,000	貸付株式数	1,100株
OATアグリオ	1,200	1,899.00	2,278,800		
デクセリアルズ	19,600	2,198.00	43,080,800		
アース製薬	5,600	6,650.00	37,240,000		
北興化学	6,400	1,150.00	7,360,000		

大成ラミック	2,400	2,812.00	6,748,800	
クミアイ化学	27,100	932.00	25,257,200	貸付株式数 1,900株
日本農薬	12,100	567.00	6,860,700	
富士興産	2,100	988.00	2,074,800	
ニチレキ	7,700	1,349.00	10,387,300	
ユシロ化学	3,400	1,205.00	4,097,000	
ビーピー・カストロール	2,400	1,350.00	3,240,000	
富士石油	18,900	254.00	4,800,600	貸付株式数 6,400株
MORESCO	2,100	1,180.00	2,478,000	
出光興産	73,900	2,720.00	201,008,000	
ENEOSホールディングス	1,004,400	446.20	448,163,280	
コスモエネルギーHLDGS	21,300	2,298.00	48,947,400	
横浜ゴム	39,200	1,964.00	76,988,800	
TOYO TIRE	35,700	2,054.00	73,327,800	
ブリヂストン	193,500	5,320.00	1,029,420,000	貸付株式数 75,900株
住友ゴム	60,900	1,378.00	83,920,200	貸付株式数 23,600株
藤倉コンポジット	6,200	708.00	4,389,600	
オカモト	3,900	4,375.00	17,062,500	貸付株式数 400株
アキレス	4,500	1,370.00	6,165,000	
フコク	3,100	1,011.00	3,134,100	貸付株式数 1,100株
ニッタ	6,800	2,875.00	19,550,000	
クリエートメディック	1,800	987.00	1,776,600	
住友理工	13,300	727.00	9,669,100	
三ツ星ベルト	7,700	2,105.00	16,208,500	
バンドー化学	11,100	953.00	10,578,300	
AGC	61,700	5,610.00	346,137,000	貸付株式数 24,200株
日本板硝子	34,600	579.00	20,033,400	
石塚硝子	1,000	2,075.00	2,075,000	貸付株式数 400株
有沢製作所	9,000	946.00	8,514,000	
日本山村硝子	2,400	933.00	2,239,200	
日本電気硝子	26,900	2,450.00	65,905,000	貸付株式数 10,500株
オハラ	2,800	1,432.00	4,009,600	貸付株式数 1,000株
住友大阪セメント	11,900	3,100.00	36,890,000	
太平洋セメント	38,000	2,620.00	99,560,000	
リソルホールディングス	700	4,000.00	2,800,000	
日本ヒューム	5,600	750.00	4,200,000	
日本コンクリート	15,000	312.00	4,680,000	
三谷セキサン	3,100	6,520.00	20,212,000	

アジアパイルHD	9,600	501.00	4,809,600		
東海カーボン	56,900	1,590.00	90,471,000		
日本カーボン	3,700	4,305.00	15,928,500	貸付株式数	1,200株
東洋炭素	4,600	2,935.00	13,501,000	貸付株式数	1,600株
ノリタケ	3,700	4,270.00	15,799,000	貸付株式数	500株
TOTO	47,900	6,470.00	309,913,000		
日本碍子	73,300	1,912.00	140,149,600		
日本特殊陶業	51,500	1,755.00	90,382,500		
ダントーホールディングス	6,200	254.00	1,574,800	貸付株式数	1,800株
MARUWA	2,400	11,390.00	27,336,000		
品川リフラクトリーズ	1,500	4,110.00	6,165,000		
黒崎播磨	1,100	5,150.00	5,665,000		
ヨータイ	5,000	1,325.00	6,625,000	貸付株式数	200株
イソライト	3,000	695.00	2,085,000		
東京窯業	7,700	332.00	2,556,400	貸付株式数	1,700株
ニッカトー	2,900	701.00	2,032,900	貸付株式数	1,100株
フジミインコーポレーテッド	5,500	6,610.00	36,355,000		
クニミネ工業	2,200	1,124.00	2,472,800	貸付株式数	800株
エーアンドエーマテリアル	900	1,007.00	906,300		
ニチアス	16,900	2,930.00	49,517,000		
日本製鉄	317,000	2,311.50	732,745,500		
神戸製鋼所	122,500	719.00	88,077,500		
中山製鋼所	8,400	469.00	3,939,600		
合同製鐵	3,500	1,555.00	5,442,500	貸付株式数	1,300株
JFEホールディングス	192,400	1,912.00	367,868,800		
東京製鐵	26,200	1,232.00	32,278,400		
共英製鋼	7,400	1,508.00	11,159,200	貸付株式数	2,800株
大和工業	14,100	4,165.00	58,726,500		
東京鐵鋼	2,700	1,637.00	4,419,900		
大阪製鐵	3,300	1,239.00	4,088,700	貸付株式数	700株
淀川製鋼所	8,400	2,577.00	21,646,800	貸付株式数	1,400株
丸一鋼管	21,400	2,892.00	61,888,800		
モリ工業	1,900	2,440.00	4,636,000		
大同特殊鋼	11,000	5,150.00	56,650,000	貸付株式数	4,100株
日本高周波	2,300	411.00	945,300	貸付株式数	400株
日本冶金工	5,100	2,808.00	14,320,800		
山陽特殊製鋼	7,800	1,867.00	14,562,600		
愛知製鋼	3,800	2,848.00	10,822,400		
日立金属	63,100	2,136.00	134,781,600		

日本金属	1,700	1,043.00	1,773,100	貸付株式数	600株
大平洋金属	4,500	1,890.00	8,505,000		
新日本電工	44,300	319.00	14,131,700	貸付株式数	6,900株
栗本鉄工所	2,900	1,668.00	4,837,200		
虹 技	800	1,145.00	916,000	貸付株式数	200株
日本鋳鉄管	700	1,222.00	855,400	貸付株式数	100株
日本製鋼所	20,300	3,005.00	61,001,500		
三菱製鋼	5,000	1,315.00	6,575,000	貸付株式数	1,800株
日亜鋼業	8,800	298.00	2,622,400	貸付株式数	1,900株
日本精線	1,000	5,080.00	5,080,000	貸付株式数	100株
エンビプロHD	3,200	1,558.00	4,985,600	貸付株式数	1,100株
大紀アルミニウム	10,100	1,684.00	17,008,400		
日本軽金属HD	17,700	2,008.00	35,541,600		
三井金属	18,000	3,520.00	63,360,000		
東邦亜鉛	3,600	2,450.00	8,820,000		
三菱マテリアル	43,600	2,318.00	101,064,800		
住友鉱山	85,000	4,345.00	369,325,000		
DOWAホールディングス	17,000	4,900.00	83,300,000		
古河機金	10,300	1,279.00	13,173,700	貸付株式数	1,600株
エス・サイエンス	35,400	36.00	1,274,400	貸付株式数	9,100株
大阪チタニウム	6,700	821.00	5,500,700	貸付株式数	2,500株
東邦チタニウム	12,500	1,240.00	15,500,000	貸付株式数	2,300株
U A C J	10,000	2,852.00	28,520,000		
C Kサンエツ	1,400	3,365.00	4,711,000	貸付株式数	500株
古河電工	20,600	2,388.00	49,192,800		
住友電工	230,900	1,537.50	355,008,750		
フジクラ	80,700	650.00	52,455,000		
昭和電線HLDGS	6,700	2,376.00	15,919,200	貸付株式数	900株
東京特殊電線	700	2,779.00	1,945,300	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,500	548.00	6,850,000		
カナレ電気	900	1,732.00	1,558,800	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,700	1,213.00	4,488,100		
リョービ	7,800	1,355.00	10,569,000	貸付株式数	3,000株
アーレステイ	8,100	461.00	3,734,100	貸付株式数	1,700株
アサヒHD	25,600	2,267.00	58,035,200		
東洋製罐グループHD	42,400	1,367.00	57,960,800		
ホッカンホールディングス	3,100	1,454.00	4,507,400		
コロナ	3,700	916.00	3,389,200	貸付株式数	1,300株
横河ブリッジHLDGS	11,600	2,301.00	26,691,600	貸付株式数	800株
駒井ハルテック	1,400	1,689.00	2,364,600		

高田機工	600	2,841.00	1,704,600	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	62,700	1,535.00	96,244,500		
文化シャツタ -	20,200	1,167.00	23,573,400	貸付株式数	7,700株
三協立山	8,700	787.00	6,846,900		
アルインコ	4,400	1,046.00	4,602,400	貸付株式数	800株
東洋シャツタ -	1,700	666.00	1,132,200	貸付株式数	300株
L I X I L	91,300	3,330.00	304,029,000		
日本フィルコン	4,200	519.00	2,179,800		
ノーリツ	13,600	1,894.00	25,758,400	貸付株式数	1,500株
長府製作所	6,500	2,085.00	13,552,500		
リンナイ	12,900	12,620.00	162,798,000		
ユニプレス	10,600	972.00	10,303,200		
ダイニチ工業	3,800	754.00	2,865,200		
日東精工	8,600	664.00	5,710,400		
三洋工業	700	1,891.00	1,323,700	貸付株式数	100株
岡 部	12,200	687.00	8,381,400	貸付株式数	3,900株
ジーテクト	7,900	1,524.00	12,039,600		
東 プ レ	12,300	1,392.00	17,121,600		
高周波熱錬	11,800	681.00	8,035,800	貸付株式数	4,200株
東京製綱	2,900	1,042.00	3,021,800		
サンコール	5,400	471.00	2,543,400		
モリテックスチル	5,400	460.00	2,484,000	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,300	1,579.00	14,684,700		
エイチワン	6,400	737.00	4,716,800		
日本発条	66,500	831.00	55,261,500		
中央発條	4,400	1,126.00	4,954,400	貸付株式数	1,000株
アドバネクス	1,100	1,228.00	1,350,800	貸付株式数	300株
三浦工業	28,800	5,160.00	148,608,000		
タ ク マ	22,900	1,717.00	39,319,300		
テクノプロ・ホールディング グ	38,600	3,160.00	121,976,000	貸付株式数	15,000株
アトラグループ	1,900	317.00	602,300	貸付株式数	600株
インターワークス	1,600	402.00	643,200	貸付株式数	100株
アイ・アールジャパンHD	2,700	13,400.00	36,180,000	貸付株式数	1,000株
K e e P e r 技研	4,400	3,835.00	16,874,000		
ファーストロジック	2,200	777.00	1,709,400		
三機サービス	1,500	1,110.00	1,665,000	貸付株式数	400株
G u n o s y	4,800	696.00	3,340,800		
デザインワン・ジャパン	3,500	226.00	791,000	貸付株式数	700株
イー・ガーディアン	3,200	3,195.00	10,224,000		

リブセンス	6,600	204.00	1,346,400	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ジャパンマテリアル	19,100	1,300.00	24,830,000	
ベクトル	8,300	1,109.00	9,204,700	貸付株式数 1,900株
ウチヤマホールディングス	3,000	353.00	1,059,000	
チャームケアコーポレーション	5,400	1,598.00	8,629,200	
キャリアリンク	2,500	1,930.00	4,825,000	貸付株式数 800株
I B J	5,900	1,012.00	5,970,800	貸付株式数 2,000株
アサンテ	2,600	1,826.00	4,747,600	貸付株式数 800株
バリューHR	2,700	1,773.00	4,787,100	貸付株式数 900株
M & Aキャピタルパートナー	5,500	5,360.00	29,480,000	貸付株式数 2,000株
ライドオンエクスプレスHD	2,600	1,522.00	3,957,200	貸付株式数 900株
E R Iホールディングス	1,800	1,105.00	1,989,000	貸付株式数 500株
アビスト	1,100	3,010.00	3,311,000	貸付株式数 300株 (300株)
シグマクシス	3,800	2,659.00	10,104,200	貸付株式数 1,300株
ウィルグループ	4,700	1,318.00	6,194,600	貸付株式数 1,800株
エスクローAJ	10,300	216.00	2,224,800	
リクルートホールディングス	459,600	6,713.00	3,085,294,800	
エラン	9,700	1,314.00	12,745,800	
ツガミ	14,300	1,901.00	27,184,300	貸付株式数 1,100株
オークマ	7,600	5,710.00	43,396,000	
芝浦機械	6,800	2,733.00	18,584,400	
アマダ	97,100	1,228.00	119,238,800	
アイダエンジニア	16,900	1,137.00	19,215,300	
滝澤鉄工所	1,800	1,114.00	2,005,200	
F U J I	26,400	3,060.00	80,784,000	
牧野フライス	7,700	4,435.00	34,149,500	貸付株式数 2,600株
オーエスジー	30,300	2,125.00	64,387,500	貸付株式数 1,700株
ダイジェット	700	1,169.00	818,300	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	16,300	540.00	8,802,000	
D M G 森精機	39,700	2,193.00	87,062,100	貸付株式数 16,500株
ソディック	16,100	927.00	14,924,700	
ディスコ	9,000	33,550.00	301,950,000	
日東工器	3,200	1,982.00	6,342,400	
日進工具	5,100	1,458.00	7,435,800	貸付株式数 600株

パンチ工業	5,800	591.00	3,427,800	貸付株式数	300株
富士ダイス	2,800	685.00	1,918,000	貸付株式数	500株
土木管理総合試験	3,400	367.00	1,247,800	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	4,600	450.00	2,070,000	貸付株式数	1,200株
日本郵政	484,900	975.00	472,777,500		
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,688.00	18,399,200		
鎌倉新書	6,900	1,051.00	7,251,900	貸付株式数	2,500株 (1,800株)
SMN	2,100	675.00	1,417,500	貸付株式数	500株
一蔵	900	399.00	359,100		
グローバルキッズCOMP	1,700	730.00	1,241,000	貸付株式数	400株
エアトリ	4,600	3,100.00	14,260,000	貸付株式数	1,500株
アトラエ	4,900	2,767.00	13,558,300		
ストライク	2,600	4,060.00	10,556,000	貸付株式数	900株
ソラスト	16,200	1,517.00	24,575,400	貸付株式数	3,000株
セラク	2,600	2,145.00	5,577,000	貸付株式数	700株
インソース	6,700	2,163.00	14,492,100	貸付株式数	2,400株
豊田自動織機	54,300	10,060.00	546,258,000		
豊和工業	3,800	837.00	3,180,600	貸付株式数	1,400株
OKK	2,900	390.00	1,131,000		
石川製作所	1,800	1,671.00	3,007,800	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,900	503.00	1,961,700		
津田駒工業	1,300	861.00	1,119,300	貸付株式数	100株
エンシュウ	1,400	840.00	1,176,000	貸付株式数	500株
島精機製作所	9,400	2,314.00	21,751,600	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,300	2,361.00	19,596,300	貸付株式数	2,100株
NCホールディングス	2,700	1,037.00	2,799,900	貸付株式数	400株
イワキポンプ	4,000	967.00	3,868,000	貸付株式数	1,600株
フリーー	6,800	1,626.00	11,056,800	貸付株式数	400株
ヤマシンフィルタ	13,800	662.00	9,135,600	貸付株式数	5,200株
日阪製作所	8,100	879.00	7,119,900		
やまびこ	12,600	1,318.00	16,606,800		
平田機工	3,000	6,820.00	20,460,000		
ペガサスミシン製造	6,600	425.00	2,805,000		
マルマエ	2,900	2,139.00	6,203,100	貸付株式数	1,000株
タツモ	3,100	1,708.00	5,294,800		
ナブテスコ	39,000	4,735.00	184,665,000	貸付株式数	14,800株
三井海洋開発	7,300	1,721.00	12,563,300	貸付株式数	2,500株
レオン自動機	6,300	1,531.00	9,645,300	貸付株式数	2,500株

S M C	19,600	76,640.00	1,502,144,000	
ホソカワミクロン	2,300	6,900.00	15,870,000	
ユニオンツール	2,600	4,040.00	10,504,000	貸付株式数 600株
オйлレス工業	8,900	1,712.00	15,236,800	貸付株式数 3,500株
日精エーエスビー	2,200	4,410.00	9,702,000	
サト - ホールディングス	8,600	2,790.00	23,994,000	
技研製作所	5,900	4,820.00	28,438,000	
日本エアーテック	3,200	1,265.00	4,048,000	貸付株式数 900株
カワタ	1,800	911.00	1,639,800	貸付株式数 700株
日精樹脂工業	5,500	1,189.00	6,539,500	貸付株式数 500株
オカダアイヨン	2,100	1,355.00	2,845,500	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,800	953.00	2,668,400	貸付株式数 600株
小松製作所	304,000	2,836.50	862,296,000	
住友重機械	38,500	3,085.00	118,772,500	
日立建機	31,600	3,355.00	106,018,000	
日工	10,100	687.00	6,938,700	貸付株式数 2,600株
巴工業	2,600	2,365.00	6,149,000	貸付株式数 1,000株
井関農機	6,300	1,801.00	11,346,300	
T O W A	6,300	2,825.00	17,797,500	
丸山製作所	1,300	1,658.00	2,155,400	
北川鉄工所	2,700	1,634.00	4,411,800	貸付株式数 100株
シンニッタン	8,500	252.00	2,142,000	貸付株式数 3,100株
ローツェ	3,100	8,960.00	27,776,000	
タカキタ	2,200	653.00	1,436,600	貸付株式数 800株
クボタ	327,400	2,441.00	799,183,400	
荏原実業	3,400	2,724.00	9,261,600	貸付株式数 400株
東洋エンジニア	9,100	879.00	7,998,900	貸付株式数 3,400株
三菱化工機	2,300	2,467.00	5,674,100	貸付株式数 700株
月島機械	11,800	1,198.00	14,136,400	
帝国電機製作所	4,500	1,400.00	6,300,000	貸付株式数 400株
東京機械	3,400	2,358.00	8,017,200	貸付株式数 1,000株
新東工業	15,300	798.00	12,209,400	貸付株式数 1,100株
渋谷工業	5,900	3,175.00	18,732,500	貸付株式数 300株
アイチ コーポレーション	11,200	780.00	8,736,000	貸付株式数 4,100株
小森コーポレーション	16,800	859.00	14,431,200	貸付株式数 5,400株
鶴見製作所	5,000	1,800.00	9,000,000	貸付株式数 400株
住友精密	900	2,475.00	2,227,500	
日本ギア工業	2,400	304.00	729,600	貸付株式数 900株
酒井重工業	1,100	2,517.00	2,768,700	

荏原製作所	28,000	6,280.00	175,840,000	貸付株式数	10,900株
石井鉄工所	900	3,015.00	2,713,500	貸付株式数	200株
西島製作所	6,600	955.00	6,303,000		
北越工業	6,800	1,047.00	7,119,600		
ダイキン工業	85,500	29,445.00	2,517,547,500		
オルガノ	2,300	6,610.00	15,203,000		
ト - ヨ - カネツ	2,600	2,554.00	6,640,400	貸付株式数	400株
栗田工業	36,700	5,450.00	200,015,000	貸付株式数	6,800株
椿本チエイン	9,600	3,550.00	34,080,000		
大同工業	3,300	1,075.00	3,547,500		
日 機 装	21,500	929.00	19,973,500		
木村化工機	6,300	747.00	4,706,100	貸付株式数	2,200株
レイズネクスト	11,100	1,174.00	13,031,400	貸付株式数	4,100株
アネスト岩田	10,900	1,065.00	11,608,500	貸付株式数	3,500株
ダイフク	37,000	10,930.00	404,410,000		
サムコ	1,700	3,170.00	5,389,000	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,400	926.00	3,148,400		
油研工業	900	1,800.00	1,620,000	貸付株式数	300株
タダノ	32,700	1,230.00	40,221,000		
フジテック	23,300	3,040.00	70,832,000	貸付株式数	8,900株
C K D	15,700	2,501.00	39,265,700		
キトー	5,600	1,765.00	9,884,000		
平和	18,300	2,039.00	37,313,700	貸付株式数	7,100株
理想科学工業	5,000	2,323.00	11,615,000		
S A N K Y O	16,000	2,826.00	45,216,000	貸付株式数	6,200株
日本金銭機械	6,600	595.00	3,927,000	貸付株式数	2,600株
マースグループH L D G S	3,800	1,710.00	6,498,000		
フクシマガリレイ	4,700	4,985.00	23,429,500		
オーイズミ	2,300	385.00	885,500	貸付株式数	100株
ダイコク電機	2,600	1,205.00	3,133,000	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	11,600	2,759.00	32,004,400		
ア マ ノ	17,600	2,907.00	51,163,200	貸付株式数	5,600株
J U K I	9,200	797.00	7,332,400	貸付株式数	2,800株
サンデンホールディングス	9,200	314.00	2,888,800		
蛇の目ミシン	6,500	723.00	4,699,500	貸付株式数	800株
ブラザー工業	81,600	2,426.00	197,961,600		
マックス	8,800	1,983.00	17,450,400	貸付株式数	800株
モリタホールディングス	10,200	1,650.00	16,830,000	貸付株式数	200株
グローリー	16,900	2,434.00	41,134,600		
新晃工業	6,300	2,204.00	13,885,200	貸付株式数	100株

大和冷機工業	10,900	1,283.00	13,984,700	
セガサミーホールディングス	60,800	1,565.00	95,152,000	
日本ピストンリング	2,700	1,442.00	3,893,400	
リケン	2,900	2,904.00	8,421,600	貸付株式数 600株
T P R	8,600	1,528.00	13,140,800	貸付株式数 3,300株
ツバキ・ナカシマ	15,000	1,604.00	24,060,000	貸付株式数 5,000株
ホシザキ	19,600	10,870.00	213,052,000	
大豊工業	6,000	874.00	5,244,000	
日本精工	138,000	782.00	107,916,000	
N T N	154,300	256.00	39,500,800	
ジェイテクト	64,700	992.00	64,182,400	
不二越	6,000	4,640.00	27,840,000	貸付株式数 2,200株
ミネベアミツミ	115,700	3,045.00	352,306,500	
日本トムソン	18,600	590.00	10,974,000	
T H K	39,000	2,748.00	107,172,000	貸付株式数 16,400株
ユーシン精機	4,300	850.00	3,655,000	
前澤給装工業	4,700	1,065.00	5,005,500	貸付株式数 300株
イーグル工業	8,100	1,276.00	10,335,600	
前澤工業	4,900	784.00	3,841,600	
日本ピラ - 工業	7,300	2,597.00	18,958,100	貸付株式数 2,600株
キッツ	22,600	851.00	19,232,600	貸付株式数 1,600株
日立	322,900	6,563.00	2,119,192,700	
東芝	133,000	4,755.00	632,415,000	貸付株式数 51,100株
三菱電機	670,300	1,547.50	1,037,289,250	
富士電機	40,600	5,100.00	207,060,000	
東洋電機製造	2,400	1,120.00	2,688,000	
安川電機	72,200	5,820.00	420,204,000	
シンフォニアテクノロジー	8,600	1,235.00	10,621,000	貸付株式数 2,000株
明電舎	11,300	2,507.00	28,329,100	
オリジン	1,600	1,301.00	2,081,600	
山洋電気	3,300	7,360.00	24,288,000	
デンヨー	5,600	2,129.00	11,922,400	
ベイクレントコンサルティング	4,200	55,600.00	233,520,000	
ORCHESTRA HLDGS	1,600	3,455.00	5,528,000	貸付株式数 200株
アイモバイル	2,600	1,461.00	3,798,600	貸付株式数 700株
キャリアインデックス	3,200	1,060.00	3,392,000	貸付株式数 500株

MS - J a p a n	3,000	1,055.00	3,165,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
船場	900	781.00	702,900	
グレイステクノロジー	7,200	1,154.00	8,308,800	貸付株式数 2,500株
ジャパニーズエレベーターSH D	19,100	2,787.00	53,231,700	
フルテック	900	1,344.00	1,209,600	貸付株式数 300株
グリーンズ	2,800	549.00	1,537,200	貸付株式数 900株
ツナググループHLDGS	2,100	313.00	657,300	貸付株式数 500株
GAMEWITH	2,400	554.00	1,329,600	貸付株式数 600株
ソウルドアウト	1,600	1,659.00	2,654,400	貸付株式数 600株
MS&CONSULTIN G	1,300	606.00	787,800	
ミダックホールディングス	2,900	4,670.00	13,543,000	貸付株式数 1,000株
日総工産	5,300	775.00	4,107,500	貸付株式数 1,500株
キュービーネットHLDG S	3,000	1,853.00	5,559,000	
RPAホールディングス	8,800	608.00	5,350,400	貸付株式数 3,000株
三桜工業	9,500	1,106.00	10,507,000	
マキタ	87,600	6,850.00	600,060,000	
東芝テック	7,200	4,865.00	35,028,000	
芝浦メカトロニクス	1,300	7,170.00	9,321,000	貸付株式数 200株
マブチモーター	15,700	3,975.00	62,407,500	貸付株式数 1,800株
日本電産	161,600	13,315.00	2,151,704,000	
ユーエムシーエレクトロニ クス	3,900	824.00	3,213,600	貸付株式数 1,300株
トレックス・セミコンダク ター	3,800	2,734.00	10,389,200	貸付株式数 600株
東光高岳	3,400	1,513.00	5,144,200	貸付株式数 1,300株
ダブル・スコープ	19,300	887.00	17,119,100	貸付株式数 7,700株
宮越ホールディングス	2,700	1,641.00	4,430,700	貸付株式数 900株
ダイヘン	7,400	4,995.00	36,963,000	
ヤーマン	11,500	1,128.00	12,972,000	貸付株式数 4,300株
JVCケンウッド	60,100	215.00	12,921,500	
ミマキエンジニアリング	6,200	917.00	5,685,400	貸付株式数 900株
I - P E X	3,200	2,045.00	6,544,000	貸付株式数 600株
日新電機	15,800	1,340.00	21,172,000	貸付株式数 1,000株
大崎電気	13,200	573.00	7,563,600	貸付株式数 1,600株
オムロン	55,800	11,420.00	637,236,000	
日東工業	9,800	1,763.00	17,277,400	

I D E C	9,200	2,378.00	21,877,600	貸付株式数	400株
正興電機製作所	2,500	1,495.00	3,737,500	貸付株式数	600株
不二電機工業	1,000	1,272.00	1,272,000		
ジーエス・ユアサ コーポ	24,400	2,635.00	64,294,000		
サクサホールディングス	1,500	1,379.00	2,068,500	貸付株式数	100株
メルコホールディングス	2,400	4,985.00	11,964,000		
テクノメディカ	1,400	1,663.00	2,328,200	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリク H D	2,000	2,538.00	5,076,000	貸付株式数	700株
日本電気	85,500	6,080.00	519,840,000		
富 士 通	60,500	21,500.00	1,300,750,000		
沖 電 気	27,100	1,004.00	27,208,400		
岩崎通信機	2,900	905.00	2,624,500	貸付株式数	1,100株
電気興業	3,100	2,295.00	7,114,500	貸付株式数	100株
サンケン電気	7,500	5,670.00	42,525,000		
ナカヨ	1,100	1,414.00	1,555,400	貸付株式数	400株
アイホン	4,300	2,209.00	9,498,700		
ルネサスエレクトロニクス	362,200	1,272.00	460,718,400	貸付株式数	142,300株
セイコーエプソン	83,400	2,222.00	185,314,800		
ワコム	49,200	729.00	35,866,800	貸付株式数	19,100株
アルバック	12,500	6,370.00	79,625,000	貸付株式数	4,800株
アクセル	2,800	788.00	2,206,400	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,800	4,345.00	25,201,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	39.00	2,406,300		
日本信号	15,500	942.00	14,601,000		
京三製作所	13,400	471.00	6,311,400	貸付株式数	700株
能美防災	8,800	2,095.00	18,436,000		
ホーチキ	4,600	1,219.00	5,607,400		
星和電機	3,400	530.00	1,802,000	貸付株式数	200株
エレコム	15,600	1,905.00	29,718,000		
パナソニック	715,600	1,412.00	1,010,427,200		
シャープ	89,600	1,450.00	129,920,000	貸付株式数	29,400株
アンリツ	40,900	2,007.00	82,086,300	貸付株式数	15,800株
富士通ゼネラル	20,800	2,947.00	61,297,600		
ソニーグループ	420,600	11,985.00	5,040,891,000		
T D K	32,500	12,430.00	403,975,000		
帝国通信工業	2,700	1,588.00	4,287,600	貸付株式数	800株
タムラ製作所	25,200	758.00	19,101,600	貸付株式数	9,400株
アルプスアルパイン	54,700	1,277.00	69,851,900		
池上通信機	2,400	802.00	1,924,800	貸付株式数	800株

日本電波工業	7,100	887.00	6,297,700	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,100	872.00	2,703,200	貸付株式数	1,100株
日本トリム	1,600	3,825.00	6,120,000	貸付株式数	300株
ローランド ディー . ジー .	4,000	3,100.00	12,400,000	貸付株式数	1,000株
フオスタ - 電機	6,600	944.00	6,230,400	貸付株式数	300株
S M K	1,600	2,450.00	3,920,000	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,500	2,692.00	14,806,000		
ティアック	5,200	123.00	639,600	貸付株式数	1,400株
ホシデン	18,000	949.00	17,082,000		
ヒロセ電機	10,400	19,290.00	200,616,000	貸付株式数	100株
日本航空電子	15,800	1,676.00	26,480,800		
T O A	7,400	862.00	6,378,800		
マクセルホールディングス	13,100	1,333.00	17,462,300		
古野電気	8,500	1,118.00	9,503,000	貸付株式数	3,400株
ユニデンホールディングス	1,800	2,807.00	5,052,600		
スミダコーポレーション	6,200	1,348.00	8,357,600		
アイコム	2,800	2,457.00	6,879,600	貸付株式数	300株
リオン	2,900	2,675.00	7,757,500		
本多通信工業	4,400	472.00	2,076,800	貸付株式数	1,700株
横河電機	66,600	1,895.00	126,207,000		
新電元工業	2,700	4,155.00	11,218,500	貸付株式数	100株
アズビル	45,600	5,200.00	237,120,000		
東亜ディーケーケー	2,800	873.00	2,444,400	貸付株式数	1,100株
日本光電工業	27,800	3,885.00	108,003,000		
チ ノ ー	1,800	1,468.00	2,642,400	貸付株式数	700株
共和電業	6,600	391.00	2,580,600		
日本電子材料	2,900	1,929.00	5,594,100	貸付株式数	1,100株
堀場製作所	12,300	8,000.00	98,400,000	貸付株式数	5,200株
アドバンテスト	50,000	10,250.00	512,500,000		
小野測器	2,500	566.00	1,415,000		
エスベック	5,800	2,288.00	13,270,400		
キーエンス	65,900	72,660.00	4,788,294,000		
日置電機	3,300	9,200.00	30,360,000		
シスメックス	52,400	14,015.00	734,386,000		
日本マイクロニクス	11,500	1,523.00	17,514,500	貸付株式数	4,500株
メガチップス	6,700	3,375.00	22,612,500		
O B A R A G R O U P	3,700	4,020.00	14,874,000	貸付株式数	1,400株
I M A G I C A G R O U P	5,400	535.00	2,889,000	貸付株式数	2,100株 (2,000株)

澤藤電機	800	2,022.00	1,617,600	貸付株式数 200株 (200株)
デンソー	147,800	8,058.00	1,190,972,400	
原田工業	2,700	938.00	2,532,600	貸付株式数 1,100株
コーセル	8,200	1,057.00	8,667,400	貸付株式数 3,100株
イリソ電子工業	5,700	4,815.00	27,445,500	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,100	1,565.00	17,371,500	
千代田インテグレ	2,700	1,942.00	5,243,400	
アイ・オー・データ	2,400	929.00	2,229,600	貸付株式数 900株
レーザーテック	29,600	27,620.00	817,552,000	貸付株式数 11,500株
スタンレー電気	46,900	2,843.00	133,336,700	
岩崎電気	2,400	2,001.00	4,802,400	
ウシオ電機	35,000	2,154.00	75,390,000	
岡谷電機	4,600	361.00	1,660,600	貸付株式数 700株
ヘリオステクノH	6,200	335.00	2,077,000	貸付株式数 800株
エノモト	2,100	1,735.00	3,643,500	貸付株式数 700株
日本セラミック	6,700	3,115.00	20,870,500	貸付株式数 2,500株
遠藤照明	3,300	974.00	3,214,200	貸付株式数 900株
古河電池	4,900	1,647.00	8,070,300	貸付株式数 1,900株
双信電機	3,300	835.00	2,755,500	
山一電機	4,500	1,691.00	7,609,500	
図 研	4,600	4,130.00	18,998,000	
日本電子	12,400	8,850.00	109,740,000	
カ シ オ	54,000	1,790.00	96,660,000	
ファナック	58,900	26,120.00	1,538,468,000	
日本シイエムケイ	13,900	420.00	5,838,000	貸付株式数 5,500株
エンプラス	3,100	3,410.00	10,571,000	
大真空	2,500	3,635.00	9,087,500	貸付株式数 800株
ロ - ム	27,900	11,210.00	312,759,000	
浜松ホトニクス	48,300	6,900.00	333,270,000	
三井ハイテック	6,700	6,950.00	46,565,000	
新光電気工業	22,900	3,940.00	90,226,000	
京 セ ラ	102,000	7,342.00	748,884,000	
協栄産業	700	1,439.00	1,007,300	貸付株式数 200株
太陽誘電	30,000	7,070.00	212,100,000	
村田製作所	197,200	10,300.00	2,031,160,000	
双葉電子工業	10,800	803.00	8,672,400	貸付株式数 3,900株
日東電工	40,500	8,960.00	362,880,000	
北陸電気工業	2,200	1,050.00	2,310,000	
東海理化電機	17,500	1,669.00	29,207,500	

ニチコン	21,800	1,150.00	25,070,000	貸付株式数	8,300株
日本ケミコン	7,000	2,239.00	15,673,000		
K O A	9,600	1,763.00	16,924,800		
三井E & S H D	21,700	482.00	10,459,400		
日立造船	54,600	872.00	47,611,200		
三菱重工業	105,700	3,043.00	321,645,100		
川崎重工業	52,700	2,455.00	129,378,500		
I H I	45,300	2,643.00	119,727,900		
名村造船所	21,900	228.00	4,993,200	貸付株式数	7,800株
サノヤスホールディングス	9,800	145.00	1,421,000	貸付株式数	400株
スプリックス	2,100	927.00	1,946,700	貸付株式数	600株
マネジメントソリューションズ	3,400	2,929.00	9,958,600	貸付株式数	1,200株
プロレド・パートナーズ	1,700	2,499.00	4,248,300	貸付株式数	500株
A N D F A C T O R Y	1,900	541.00	1,027,900	貸付株式数	500株
ギークス	1,500	1,632.00	2,448,000	貸付株式数	400株
カーブスホールディングス	18,200	880.00	16,016,000	貸付株式数	6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,700	916.00	4,305,200	貸付株式数	1,500株
日本車輛	2,200	2,135.00	4,697,000	貸付株式数	800株
三菱ロジスネクスト	9,100	1,127.00	10,255,700	貸付株式数	3,400株
近畿車輛	1,000	1,132.00	1,132,000	貸付株式数	400株
F P G	22,700	705.00	16,003,500	貸付株式数	6,000株
島根銀行	3,000	590.00	1,770,000	貸付株式数	500株
じもとホールディングス	4,300	697.00	2,997,100		
全国保証	17,200	5,670.00	97,524,000	貸付株式数	6,700株
めぶきフィナンシャルG	344,100	253.00	87,057,300		
東京きらぼしF G	8,800	1,620.00	14,256,000		
九州フィナンシャルG	134,900	430.00	58,007,000		
かんぼ生命保険	82,400	2,047.00	168,672,800		
ゆうちょ銀行	187,200	972.00	181,958,400	貸付株式数	73,200株
富山第一銀行	14,700	302.00	4,439,400	貸付株式数	1,100株
コンコルディア・フィナンシャル	402,800	444.00	178,843,200		
ジェイリース	2,500	1,648.00	4,120,000	貸付株式数	800株
西日本フィナンシャルH D	43,300	721.00	31,219,300		
イントラスト	2,700	739.00	1,995,300	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,700	1,097.00	4,058,900	貸付株式数	1,200株
C a s a	2,100	942.00	1,978,200	貸付株式数	900株
アルヒ	10,100	1,364.00	13,776,400	貸付株式数	3,800株

プレミアグループ	3,400	3,585.00	12,189,000	貸付株式数	100株
日産自動車	790,600	574.70	454,357,820		
いすゞ自動車	178,900	1,493.00	267,097,700		
トヨタ自動車	680,100	10,005.00	6,804,400,500		
日野自動車	84,600	1,008.00	85,276,800		
三菱自動車工業	250,800	287.00	71,979,600	貸付株式数	97,400株
エフテック	5,300	647.00	3,429,100	貸付株式数	1,200株
レシップホールディングス	2,900	593.00	1,719,700	貸付株式数	800株
GMB	1,600	923.00	1,476,800	貸付株式数	400株
ファルテック	1,400	747.00	1,045,800		
武蔵精密工業	15,400	2,017.00	31,061,800		
日産車体	9,300	746.00	6,937,800		
新明和工業	19,500	956.00	18,642,000	貸付株式数	4,300株
極東開発工業	11,600	1,740.00	20,184,000		
トピー工業	5,400	1,227.00	6,625,800	貸付株式数	700株
ティラド	2,200	3,325.00	7,315,000		
タチエス	10,500	1,386.00	14,553,000		
N O K	32,400	1,398.00	45,295,200	貸付株式数	200株
フタバ産業	16,100	496.00	7,985,600		
K Y B	7,700	3,205.00	24,678,500	貸付株式数	100株
市光工業	9,800	715.00	7,007,000	貸付株式数	2,300株
大同メタル工業	13,000	607.00	7,891,000	貸付株式数	2,600株
プレス工業	32,600	361.00	11,768,600		
ミクニ	7,900	320.00	2,528,000		
太平洋工業	14,100	1,283.00	18,090,300	貸付株式数	2,100株
河西工業	9,400	397.00	3,731,800	貸付株式数	1,000株
アイシン	49,200	4,405.00	216,726,000		
マ ッ ダ	211,900	975.00	206,602,500		
今仙電機製作所	5,600	715.00	4,004,000		
本田技研	528,200	3,431.00	1,812,254,200		
スズキ	133,100	5,030.00	669,493,000		
S U B A R U	192,000	2,071.50	397,728,000		
安永	3,200	1,152.00	3,686,400	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	87,800	2,950.00	259,010,000	貸付株式数	34,400株
小糸製作所	40,100	7,090.00	284,309,000		
T B K	7,400	416.00	3,078,400		
エクセディ	9,100	1,738.00	15,815,800		
ミツバ	12,700	679.00	8,623,300	貸付株式数	3,800株
豊田合成	22,000	2,389.00	52,558,000		
愛三工業	10,600	874.00	9,264,400		

盟和産業	1,100	1,044.00	1,148,400	貸付株式数	300株
日本プラスト	5,100	649.00	3,309,900	貸付株式数	2,000株
ヨロズ	5,500	1,259.00	6,924,500	貸付株式数	100株
エフ・シー・シー	10,500	1,602.00	16,821,000	貸付株式数	100株
新家工業	1,600	1,510.00	2,416,000		
シマノ	27,100	34,000.00	921,400,000	貸付株式数	10,600株
テイ・エス テック	30,800	1,548.00	47,678,400		
33FG	5,600	1,482.00	8,299,200		
第四北越フィナンシャルG	10,700	2,743.00	29,350,100	貸付株式数	300株
ひろぎんHLDGS	98,700	639.00	63,069,300	貸付株式数	38,300株
マーキュリアホールディングス	3,200	748.00	2,393,600		
LITALICO	2,800	6,430.00	18,004,000		
ジャムコ	4,300	1,024.00	4,403,200	貸付株式数	1,500株
小野建	5,500	1,620.00	8,910,000	貸付株式数	2,200株
はるやまHLDGS	2,300	578.00	1,329,400	貸付株式数	900株
南陽	1,200	1,979.00	2,374,800	貸付株式数	400株
ノジマ	11,700	2,865.00	33,520,500	貸付株式数	4,600株
佐鳥電機	4,000	890.00	3,560,000		
カッパ・クリエイト	9,100	1,397.00	12,712,700	貸付株式数	3,600株
エコートレーディング	1,900	653.00	1,240,700		
伯東	4,400	1,904.00	8,377,600		
コンドーテック	4,800	1,028.00	4,934,400	貸付株式数	700株
中山福	4,300	425.00	1,827,500	貸付株式数	800株
ライトオン	4,600	722.00	3,321,200	貸付株式数	300株
ナガイレーベン	8,400	2,653.00	22,285,200	貸付株式数	3,300株
三菱食品	7,000	2,978.00	20,846,000	貸付株式数	700株
良品計画	76,200	2,504.00	190,804,800		
三城ホールディングス	7,900	268.00	2,117,200	貸付株式数	3,100株
松田産業	5,200	3,035.00	15,782,000	貸付株式数	800株
第一興商	12,900	3,795.00	48,955,500	貸付株式数	4,900株
メディパルHD	66,200	2,200.00	145,640,000		
アドヴァングループ	6,600	943.00	6,223,800	貸付株式数	1,500株
SPK	2,900	1,410.00	4,089,000		
萩原電気HLDGS	2,400	2,380.00	5,712,000		
アルビス	1,900	2,422.00	4,601,800	貸付株式数	100株
アズワン	4,800	17,720.00	85,056,000		
スズデン	2,200	1,532.00	3,370,400	貸付株式数	300株
尾家産業	2,000	1,133.00	2,266,000	貸付株式数	700株
シモジマ	4,200	1,150.00	4,830,000	貸付株式数	1,600株

ドウシシャ	6,200	1,794.00	11,122,800		
小津産業	1,700	1,935.00	3,289,500	貸付株式数	500株
コナカ	7,800	359.00	2,800,200		
高速	3,500	1,640.00	5,740,000		
ハウス ローゼ	600	1,659.00	995,400	貸付株式数	200株
G - 7ホールディングス	3,900	4,340.00	16,926,000		
たけびし	2,200	1,619.00	3,561,800	貸付株式数	800株
イオン北海道	8,900	1,234.00	10,982,600	貸付株式数	2,300株
コジマ	12,300	679.00	8,351,700	貸付株式数	4,500株
ヒマラヤ	2,200	1,330.00	2,926,000		
コーナン商事	9,600	3,760.00	36,096,000		
ネットワンシステムズ	27,100	3,825.00	103,657,500		
エコス	2,500	2,007.00	5,017,500		
ワタミ	8,900	982.00	8,739,800	貸付株式数	3,300株
マルシェ	1,500	484.00	726,000	貸付株式数	600株
リックス	1,300	1,566.00	2,035,800		
システムソフト	18,400	200.00	3,680,000	貸付株式数	5,300株
パンパシフィックHD	132,500	2,176.00	288,320,000		
丸文	5,600	801.00	4,485,600	貸付株式数	1,100株
西松屋チェーン	14,900	1,413.00	21,053,700	貸付株式数	5,700株
ゼンショーホールディングス	35,400	2,807.00	99,367,800	貸付株式数	13,800株
ハピネット	6,000	1,504.00	9,024,000	貸付株式数	300株
幸楽苑ホールディングス	4,100	1,498.00	6,141,800	貸付株式数	1,600株
ハークスレイ	1,000	1,014.00	1,014,000		
橋本総業HLDGS	1,600	2,252.00	3,603,200	貸付株式数	500株
日本ライフライン	21,300	1,393.00	29,670,900		
サイゼリヤ	10,200	2,626.00	26,785,200	貸付株式数	3,800株
タカショー	5,100	1,051.00	5,360,100	貸付株式数	1,700株
V Tホールディングス	25,200	585.00	14,742,000	貸付株式数	9,500株
マルカ	2,300	2,722.00	6,260,600		
アルゴグラフィックス	5,300	3,450.00	18,285,000		
魚力	1,900	2,232.00	4,240,800	貸付株式数	700株
IDOM	22,700	985.00	22,359,500		
日本エム・ディ・エム	4,000	2,302.00	9,208,000		
ポプラ	3,100	225.00	697,500	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	3,400	1,208.00	4,107,200		
ユナイテッドアローズ	7,700	1,849.00	14,237,300	貸付株式数	1,100株
進和	3,800	2,400.00	9,120,000	貸付株式数	1,500株
エスケイジャパン	2,600	473.00	1,229,800	貸付株式数	400株

ダイترون	2,800	2,390.00	6,692,000	
ハイデイ日高	9,500	1,704.00	16,188,000	貸付株式数 3,600株
シークス	9,400	1,328.00	12,483,200	
京都きもの友禅	4,300	261.00	1,122,300	貸付株式数 300株
コロワイド	22,000	1,818.00	39,996,000	貸付株式数 8,600株
ピーシーデポコーポ	7,400	475.00	3,515,000	貸付株式数 3,500株
田中商事	1,700	659.00	1,120,300	貸付株式数 500株
オーハシテクニカ	3,400	1,477.00	5,021,800	
壱番屋	4,400	4,835.00	21,274,000	
白銅	2,300	2,919.00	6,713,700	貸付株式数 800株
トップカルチャー	2,500	348.00	870,000	貸付株式数 1,000株
P L A N T	1,600	742.00	1,187,200	貸付株式数 600株
スギホールディングス	13,300	8,460.00	112,518,000	
ダイコー通産	900	1,294.00	1,164,600	貸付株式数 300株
薬王堂ホールディングス	2,800	2,565.00	7,182,000	
島津製作所	86,500	5,340.00	461,910,000	
J M S	5,900	820.00	4,838,000	貸付株式数 2,100株
クボテック	1,800	306.00	550,800	貸付株式数 600株
長野計器	5,100	1,154.00	5,885,400	貸付株式数 200株
ブイ・テクノロジー	3,100	4,810.00	14,911,000	貸付株式数 1,200株
スター精密	10,400	1,607.00	16,712,800	貸付株式数 1,400株
東京計器	4,100	1,027.00	4,210,700	
愛知時計	700	4,745.00	3,321,500	
インターアクション	3,500	2,773.00	9,705,500	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
オーバル	6,600	275.00	1,815,000	貸付株式数 500株
東京精密	11,400	4,970.00	56,658,000	
マニー	26,700	2,329.00	62,184,300	
ニコン	102,700	1,219.00	125,191,300	
トプコン	34,000	1,952.00	66,368,000	
オリンパス	352,100	2,433.00	856,659,300	
理研計器	5,900	3,005.00	17,729,500	貸付株式数 600株
S C R E E Nホールディングス	11,700	10,110.00	118,287,000	
キヤノン電子	6,200	1,650.00	10,230,000	
タムロン	5,600	2,706.00	15,153,600	貸付株式数 2,000株
HOYA	131,000	18,205.00	2,384,855,000	
シード	2,400	714.00	1,713,600	貸付株式数 900株 (900株)
ノーリツ鋼機	6,200	2,783.00	17,254,600	

エー・アンド・デイ	5,800	1,133.00	6,571,400	貸付株式数	2,200株
朝日インテック	72,200	3,335.00	240,787,000	貸付株式数	28,200株
キヤノン	333,600	2,655.50	885,874,800	貸付株式数	141,500株
リコー	171,600	1,135.00	194,766,000		
シチズン時計	85,200	508.00	43,281,600		
リズム	1,900	1,450.00	2,755,000	貸付株式数	700株
大研医器	4,800	601.00	2,884,800	貸付株式数	1,200株
メニコン	10,500	8,740.00	91,770,000	貸付株式数	4,000株
シンシア	1,400	632.00	884,800		
中本パックス	1,600	1,860.00	2,976,000	貸付株式数	100株
スノーピーク	4,500	5,260.00	23,670,000	貸付株式数	1,600株
パラマウントベッドHD	12,500	2,214.00	27,675,000		
トランザクション	4,500	1,198.00	5,391,000	貸付株式数	600株
粧美堂	2,300	420.00	966,000	貸付株式数	800株
ニホンフラッシュ	5,700	1,259.00	7,176,300	貸付株式数	600株
前田工織	7,600	3,385.00	25,726,000	貸付株式数	1,000株
永大産業	8,600	305.00	2,623,000		
アートネイチャー	6,300	728.00	4,586,400		
バンダイナムコHLDGS	55,500	8,399.00	466,144,500		
アイフィスジャパン	1,800	712.00	1,281,600		
共立印刷	8,200	172.00	1,410,400	貸付株式数	500株
SHOEI	6,500	5,140.00	33,410,000	貸付株式数	100株
フランスベッドHLDGS	9,800	959.00	9,398,200	貸付株式数	3,400株
マーベラス	10,400	707.00	7,352,800	貸付株式数	2,200株
パイロットコーポレーション	11,100	4,430.00	49,173,000	貸付株式数	4,400株
萩原工業	3,800	1,550.00	5,890,000	貸付株式数	1,400株
エイベックス	11,700	1,504.00	17,596,800	貸付株式数	1,700株
トッパン・フォームズ	11,900	1,052.00	12,518,800		
フジシールインターナショナル	13,700	2,634.00	36,085,800	貸付株式数	5,400株
タカラトミー	30,300	1,140.00	34,542,000		
廣済堂	5,200	1,065.00	5,538,000	貸付株式数	300株
エステールホールディングス	4,000	662.00	2,648,000	貸付株式数	700株
レック	7,800	1,131.00	8,821,800		
タカノ	2,100	777.00	1,631,700	貸付株式数	800株
三光合成	7,200	451.00	3,247,200		
プロネクサス	5,300	1,089.00	5,771,700	貸付株式数	500株
ホクシン	6,900	167.00	1,152,300	貸付株式数	1,000株

ウッドワン	2,500	1,170.00	2,925,000	
大建工業	4,500	2,445.00	11,002,500	
きもと	12,700	251.00	3,187,700	貸付株式数 3,900株
凸版印刷	101,300	1,973.00	199,864,900	
大日本印刷	79,000	2,699.00	213,221,000	
共同印刷	2,000	2,696.00	5,392,000	
N I S S H A	13,800	1,826.00	25,198,800	貸付株式数 3,400株
光村印刷	600	1,692.00	1,015,200	貸付株式数 200株
藤森工業	6,000	4,735.00	28,410,000	貸付株式数 200株
ヴィア・ホールディングス	7,600	191.00	1,451,600	貸付株式数 3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,797.00	5,930,100	貸付株式数 1,200株
前澤化成工業	4,500	1,261.00	5,674,500	貸付株式数 1,600株
未来工業	2,500	1,674.00	4,185,000	貸付株式数 800株
アシックス	59,700	2,551.00	152,294,700	貸付株式数 23,300株
ツツミ	2,100	2,375.00	4,987,500	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	2,300	686.00	1,577,800	貸付株式数 900株
ジェイエスピー	4,300	1,648.00	7,086,400	貸付株式数 1,400株
ニチハ	9,200	3,315.00	30,498,000	貸付株式数 1,500株
エフピコ	12,500	4,310.00	53,875,000	貸付株式数 4,200株
小松ウオール工業	2,200	1,967.00	4,327,400	
ヤマハ	39,900	7,140.00	284,886,000	
河合楽器	2,000	4,235.00	8,470,000	
クリナップ	6,000	576.00	3,456,000	貸付株式数 1,400株
ビジョン	40,800	3,255.00	132,804,000	貸付株式数 16,600株
天馬	5,200	3,015.00	15,678,000	
兼松サステック	600	1,798.00	1,078,800	
キングジム	5,600	892.00	4,995,200	貸付株式数 1,500株
象印マホービン	17,900	1,790.00	32,041,000	貸付株式数 7,000株
リンテック	14,000	2,576.00	36,064,000	
信越ポリマー	9,900	1,007.00	9,969,300	
東リ	14,700	237.00	3,483,900	
イトーキ	12,900	366.00	4,721,400	貸付株式数 5,100株
任天堂	38,500	55,680.00	2,143,680,000	
三菱鉛筆	10,600	1,477.00	15,656,200	
松風	3,200	2,034.00	6,508,800	貸付株式数 1,200株
タカラスタンダ-ド	13,200	1,698.00	22,413,600	
コクヨ	32,500	1,941.00	63,082,500	
ナカバヤシ	5,800	597.00	3,462,600	
ニフコ	25,000	3,655.00	91,375,000	

立川プラインド	3,100	1,307.00	4,051,700	貸付株式数	1,100株
グロープライド	3,400	8,440.00	28,696,000		
オカムラ	23,600	1,725.00	40,710,000		
バルカー	5,300	2,208.00	11,702,400		
MUTOHホールディングス	900	1,600.00	1,440,000		
伊藤忠	462,500	3,414.00	1,578,975,000		
丸紅	652,200	909.10	592,915,020		
スクロール	9,900	892.00	8,830,800	貸付株式数	3,700株
高島	1,000	1,850.00	1,850,000		
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,796.00	11,135,200		
三陽商会	4,000	888.00	3,552,000		
長瀬産業	35,800	1,916.00	68,592,800	貸付株式数	7,200株
ナイガイ	3,200	341.00	1,091,200		
蝶理	4,300	1,933.00	8,311,900		
豊田通商	66,200	5,000.00	331,000,000		
オンワードホールディングス	41,800	317.00	13,250,600	貸付株式数	1,400株
三共生興	9,200	544.00	5,004,800		
兼松	26,100	1,437.00	37,505,700		
美津濃	6,800	2,615.00	17,782,000		
ツカモトコーポレーション	1,400	1,422.00	1,990,800		
ルックホールディングス	2,300	1,376.00	3,164,800		
三井物産	527,900	2,512.50	1,326,348,750		
日本紙パルプ	3,300	3,830.00	12,639,000		
東京エレクトロン	39,300	50,660.00	1,990,938,000		
カメイ	8,100	1,218.00	9,865,800		
東都水産	400	6,380.00	2,552,000		
OUGホールディングス	1,000	2,988.00	2,988,000	貸付株式数	300株
スターゼン	5,000	2,284.00	11,420,000		
セイコーHD	9,700	2,304.00	22,348,800	貸付株式数	500株
山善	25,000	1,149.00	28,725,000	貸付株式数	6,000株
椿本興業	1,200	3,830.00	4,596,000		
住友商事	416,200	1,608.50	669,457,700		
日本ユニシス	23,100	3,100.00	71,610,000		
内田洋行	2,900	5,550.00	16,095,000		
三菱商事	402,700	3,447.00	1,388,106,900		
第一実業	3,200	4,750.00	15,200,000	貸付株式数	300株

キヤノンマーケティングJ PN	16,300	2,570.00	41,891,000	貸付株式数	6,300株
西華産業	3,300	1,702.00	5,616,600	貸付株式数	600株
佐藤商事	5,100	1,251.00	6,380,100		
菱洋エレクトロ	5,100	2,366.00	12,066,600	貸付株式数	1,900株
東京産業	6,600	717.00	4,732,200	貸付株式数	200株
ユアサ商事	6,600	3,075.00	20,295,000	貸付株式数	200株
神鋼商事	1,500	3,345.00	5,017,500		
トルク	3,900	235.00	916,500	貸付株式数	1,100株
阪和興業	13,300	3,615.00	48,079,500		
正栄食品	4,200	4,290.00	18,018,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	5,300	1,057.00	5,602,100	貸付株式数	500株
菱電商事	4,700	1,847.00	8,680,900	貸付株式数	1,600株
ニプロ	49,800	1,301.00	64,789,800		
フルサト工業	3,400	2,113.00	7,184,200		
岩谷産業	16,100	6,550.00	105,455,000		
ナイス	2,500	1,903.00	4,757,500		
ニチモウ	1,000	2,068.00	2,068,000	貸付株式数	200株
極東貿易	2,100	2,564.00	5,384,400	貸付株式数	700株
アステナホールディングス	10,800	618.00	6,674,400	貸付株式数	3,500株
兼松エレクトロニクス	3,600	3,930.00	14,148,000		
三愛石油	16,200	1,442.00	23,360,400		
稲畑産業	16,000	1,780.00	28,480,000	貸付株式数	1,000株
G S Iクレオス	3,600	1,038.00	3,736,800	貸付株式数	1,200株
明和産業	5,900	1,211.00	7,144,900	貸付株式数	2,300株
クワザワホールディングス	2,500	627.00	1,567,500		
ヤマエ久野	4,600	1,160.00	5,336,000	貸付株式数	1,100株
ゴ-ルドウイン	11,000	7,080.00	77,880,000		
ユニ・チャ-ム	129,400	5,035.00	651,529,000		
デサント	11,400	3,730.00	42,522,000	貸付株式数	4,400株
キング	3,400	542.00	1,842,800	貸付株式数	900株
ワキタ	13,000	1,059.00	13,767,000		
ヤマトインタ-ナショナル	5,800	329.00	1,908,200	貸付株式数	2,200株
東邦ホールディングス	20,800	1,944.00	40,435,200		
サンゲツ	17,500	1,637.00	28,647,500		
ミツウロコグループ	9,900	1,383.00	13,691,700	貸付株式数	2,600株
シナネンホールディングス	2,500	3,555.00	8,887,500	貸付株式数	900株
伊藤忠エネクス	14,900	1,004.00	14,959,600		
サンリオ	19,100	2,376.00	45,381,600	貸付株式数	6,700株
サンワテクノス	4,400	1,463.00	6,437,200		

リョーサン	6,800	2,400.00	16,320,000	
新光商事	9,100	834.00	7,589,400	貸付株式数 400株
トーホー	3,000	1,648.00	4,944,000	貸付株式数 1,100株
三信電気	4,100	1,722.00	7,060,200	
東陽テクニカ	6,900	1,214.00	8,376,600	貸付株式数 300株
モスフード サービス	9,000	3,340.00	30,060,000	貸付株式数 3,400株
加賀電子	6,200	3,060.00	18,972,000	
三益半導体	5,000	2,485.00	12,425,000	
ソーダニツカ	6,300	600.00	3,780,000	
立花エレテック	4,600	1,591.00	7,318,600	貸付株式数 1,800株
木曽路	8,300	2,341.00	19,430,300	貸付株式数 3,300株
S R Sホールディングス	8,200	834.00	6,838,800	貸付株式数 3,200株
千趣会	11,800	393.00	4,637,400	貸付株式数 4,700株
タカキユー	7,300	133.00	970,900	貸付株式数 1,200株
リテールパートナーズ	7,900	1,273.00	10,056,700	貸付株式数 3,100株
ケーヨー	11,900	850.00	10,115,000	
上新電機	7,400	2,563.00	18,966,200	
日本瓦斯	32,600	1,585.00	51,671,000	
ロイヤルホールディングス	11,600	2,033.00	23,582,800	貸付株式数 4,400株
東天紅	500	1,115.00	557,500	
いなげや	7,300	1,485.00	10,840,500	
チヨダ	6,400	817.00	5,228,800	貸付株式数 2,100株
ライフコーポレーション	6,200	4,615.00	28,613,000	
リンガーハット	7,900	2,279.00	18,004,100	貸付株式数 3,100株
MrMaxHD	8,800	663.00	5,834,400	貸付株式数 3,500株
テナライド	5,300	316.00	1,674,800	貸付株式数 2,300株
AOKIホールディングス	13,300	673.00	8,950,900	貸付株式数 2,600株
オークワ	10,000	1,192.00	11,920,000	貸付株式数 1,500株
コメリ	10,000	2,602.00	26,020,000	
青山商事	15,300	721.00	11,031,300	貸付株式数 5,800株
しまむら	7,700	9,980.00	76,846,000	
はせがわ	3,300	274.00	904,200	貸付株式数 800株
高島屋	49,200	1,179.00	58,006,800	
松屋	14,400	998.00	14,371,200	
エイチ・ツー・オーリテイリング	32,500	900.00	29,250,000	
近鉄百貨店	2,500	2,495.00	6,237,500	貸付株式数 900株
丸井グループ	56,400	2,102.00	118,552,800	
クレディセゾン	38,900	1,284.00	49,947,600	
アクシアルリテイリング	5,300	4,225.00	22,392,500	

井筒屋	3,700	200.00	740,000	貸付株式数	1,200株
イオン	254,200	3,056.00	776,835,200		
イズミ	13,500	3,730.00	50,355,000	貸付株式数	5,200株
フオーバル	2,200	1,059.00	2,329,800		
平和堂	12,000	2,306.00	27,672,000	貸付株式数	5,200株
フジ	7,900	2,183.00	17,245,700	貸付株式数	3,100株
ヤオコー	7,500	7,380.00	55,350,000	貸付株式数	200株
ゼビオホールディングス	7,400	1,119.00	8,280,600	貸付株式数	300株
ケースホールディングス	56,600	1,228.00	69,504,800	貸付株式数	20,700株
PALTA C	10,700	4,825.00	51,627,500		
三谷産業	9,400	389.00	3,656,600	貸付株式数	3,500株
OLYMPICグループ	3,600	779.00	2,804,400	貸付株式数	700株
日産東京販売HD	8,900	245.00	2,180,500		
新生銀行	54,700	1,418.00	77,564,600		
あおぞら銀行	39,500	2,657.00	104,951,500		
三菱UFJフィナンシャルG	4,527,400	619.10	2,802,913,340		
りそなホールディングス	768,700	440.20	338,381,740		
三井住友トラストHD	125,200	3,738.00	467,997,600		
三井住友フィナンシャルG	457,600	3,929.00	1,797,910,400		
千葉銀行	221,200	699.00	154,618,800		
群馬銀行	136,600	357.00	48,766,200		
武蔵野銀行	9,700	1,819.00	17,644,300	貸付株式数	3,100株
千葉興業銀行	16,600	288.00	4,780,800		
筑波銀行	29,100	177.00	5,150,700		
七十七銀行	20,500	1,269.00	26,014,500	貸付株式数	6,000株
青森銀行	5,100	2,151.00	10,970,100	貸付株式数	100株
秋田銀行	4,000	1,479.00	5,916,000		
山形銀行	7,000	878.00	6,146,000		
岩手銀行	4,200	1,735.00	7,287,000	貸付株式数	800株
東邦銀行	56,700	216.00	12,247,200	貸付株式数	2,200株
東北銀行	3,300	1,035.00	3,415,500		
みちのく銀行	4,500	903.00	4,063,500		
ふくおかフィナンシャルG	60,100	2,088.00	125,488,800		
静岡銀行	161,800	895.00	144,811,000		
十六銀行	8,300	2,259.00	18,749,700		
スルガ銀行	63,000	379.00	23,877,000		
八十二銀行	148,500	387.00	57,469,500		
山梨中央銀行	7,400	852.00	6,304,800	貸付株式数	400株

大垣共立銀行	12,900	1,946.00	25,103,400	
福井銀行	5,900	1,609.00	9,493,100	貸付株式数 400株
北國銀行	6,200	2,146.00	13,305,200	
清水銀行	2,500	1,615.00	4,037,500	貸付株式数 100株
富山銀行	1,300	2,075.00	2,697,500	貸付株式数 300株
滋賀銀行	13,200	1,911.00	25,225,200	
南都銀行	9,300	2,025.00	18,832,500	
百五銀行	59,300	328.00	19,450,400	貸付株式数 3,000株
京都銀行	23,900	5,100.00	121,890,000	
紀陽銀行	23,000	1,592.00	36,616,000	
ほくほくフィナンシャルG	44,200	868.00	38,365,600	
山陰合同銀行	41,000	576.00	23,616,000	
中国銀行	56,000	900.00	50,400,000	
鳥取銀行	2,200	1,143.00	2,514,600	
伊予銀行	88,200	593.00	52,302,600	貸付株式数 600株
百十四銀行	6,500	1,599.00	10,393,500	
四国銀行	9,300	740.00	6,882,000	貸付株式数 3,600株
阿波銀行	9,900	2,199.00	21,770,100	
大分銀行	3,700	1,791.00	6,626,700	
宮崎銀行	4,100	2,097.00	8,597,700	
佐賀銀行	3,800	1,471.00	5,589,800	
沖縄銀行	5,800	2,808.00	16,286,400	貸付株式数 500株
琉球銀行	13,600	800.00	10,880,000	
セブン銀行	221,900	257.00	57,028,300	貸付株式数 3,200株
みずほフィナンシャルG	898,700	1,607.00	1,444,210,900	
高知銀行	2,500	834.00	2,085,000	貸付株式数 100株
山口フィナンシャルG	82,600	664.00	54,846,400	
芙蓉総合リース	6,800	7,760.00	52,768,000	貸付株式数 900株
みずほリース	10,500	3,680.00	38,640,000	貸付株式数 4,000株
東京センチュリー	15,300	6,510.00	99,603,000	貸付株式数 600株
SBIホールディングス	81,800	2,843.00	232,557,400	貸付株式数 32,000株
日本証券金融	29,000	896.00	25,984,000	
アイフル	113,800	353.00	40,171,400	貸付株式数 1,400株
日本アジア投資	6,100	275.00	1,677,500	貸付株式数 1,800株
長野銀行	2,400	1,170.00	2,808,000	貸付株式数 300株
名古屋銀行	5,200	2,694.00	14,008,800	
北洋銀行	101,200	260.00	26,312,000	貸付株式数 500株
愛知銀行	2,300	3,605.00	8,291,500	貸付株式数 100株
中京銀行	2,600	1,406.00	3,655,600	
大光銀行	2,200	1,421.00	3,126,200	貸付株式数 400株

愛媛銀行	8,900	792.00	7,048,800		
トマト銀行	2,300	1,105.00	2,541,500	貸付株式数	500株
京葉銀行	25,700	440.00	11,308,000	貸付株式数	500株
栃木銀行	31,600	181.00	5,719,600		
北日本銀行	1,900	1,588.00	3,017,200	貸付株式数	700株
東和銀行	12,200	523.00	6,380,600	貸付株式数	1,800株
福島銀行	7,700	247.00	1,901,900		
大東銀行	3,000	656.00	1,968,000		
リコーリース	5,200	3,745.00	19,474,000	貸付株式数	2,000株
イオンフィナンシャルサー ビス	40,400	1,320.00	53,328,000		
アコム	129,800	429.00	55,684,200		
ジャックス	7,700	2,815.00	21,675,500		
オリコ	179,600	153.00	27,478,800		
オリックス	401,500	2,144.00	860,816,000		
三菱HCキャピタル	227,000	605.00	137,335,000		
ジャフコグループ	8,700	7,040.00	61,248,000	貸付株式数	3,300株
九州リースサービス	3,000	602.00	1,806,000		
トモニホールディングス	48,200	335.00	16,147,000	貸付株式数	16,000株
大和証券G本社	495,500	665.90	329,953,450		
野村ホールディングス	1,013,000	575.90	583,386,700		
岡三証券グループ	53,900	422.00	22,745,800	貸付株式数	19,100株
丸三証券	19,600	654.00	12,818,400		
東洋証券	21,500	156.00	3,354,000		
東海東京HD	68,800	424.00	29,171,200		
光世証券	1,800	589.00	1,060,200	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	317.00	5,642,600	貸付株式数	4,300株
いちよし証券	13,300	660.00	8,778,000	貸付株式数	5,100株
松井証券	32,200	833.00	26,822,600		
SOMPOホールディング ス	116,600	5,087.00	593,144,200		
日本取引所グループ	178,700	2,907.50	519,570,250		
マネックスG	60,400	654.00	39,501,600	貸付株式数	23,000株
極東証券	8,500	840.00	7,140,000	貸付株式数	2,800株
岩井コスモホールディング	7,700	1,432.00	11,026,400		
藍澤証券	11,900	1,128.00	13,423,200	貸付株式数	2,500株
フィデアホール	66,200	127.00	8,407,400		
池田泉州HD	74,800	168.00	12,566,400	貸付株式数	6,400株
アニコムホールディング ス	19,500	919.00	17,920,500	貸付株式数	100株

M S & A D	160,300	3,817.00	611,865,100	
マナーパートナーズG P	9,100	216.00	1,965,600	貸付株式数 200株
スパークス・グループ	31,600	285.00	9,006,000	貸付株式数 5,700株
小林洋行	4,100	275.00	1,127,500	貸付株式数 400株
第一生命H L D G S	326,200	2,355.00	768,201,000	
東京海上H D	218,100	5,664.00	1,235,318,400	
アドバンテッジリスクマネ	3,600	1,184.00	4,262,400	貸付株式数 1,200株
イー・ギャランティ	8,000	2,556.00	20,448,000	
アサックス	3,900	695.00	2,710,500	貸付株式数 1,400株
N E C キャピタルソリュー ション	2,800	2,183.00	6,112,400	
T & D ホールディングス	198,300	1,430.00	283,569,000	
アドバンスクリエイト	3,400	1,047.00	3,559,800	貸付株式数 1,200株
三井不動産	301,500	2,696.00	812,844,000	
三菱地所	433,900	1,793.50	778,199,650	
平和不動産	11,500	4,285.00	49,277,500	
東京建物	65,400	1,748.00	114,319,200	
ダイビル	16,900	1,431.00	24,183,900	
京阪神ビルディング	10,500	1,495.00	15,697,500	
住友不動産	148,900	3,875.00	576,987,500	
太平洋興発	2,600	648.00	1,684,800	貸付株式数 900株
テーオーシー	12,100	672.00	8,131,200	貸付株式数 3,900株
東京楽天地	1,000	4,225.00	4,225,000	貸付株式数 400株
スターツコーポレーション	7,700	2,983.00	22,969,100	
フジ住宅	7,700	712.00	5,482,400	
空港施設	7,200	607.00	4,370,400	貸付株式数 1,700株
明和地所	3,400	605.00	2,057,000	貸付株式数 300株
ゴールドクレスト	5,800	1,775.00	10,295,000	貸付株式数 2,300株
リログループ	35,200	2,436.00	85,747,200	貸付株式数 13,700株
エスリード	2,500	1,635.00	4,087,500	貸付株式数 1,000株
日神グループH L D G S	9,300	513.00	4,770,900	貸付株式数 4,100株
日本エスコン	13,100	808.00	10,584,800	貸付株式数 4,600株
タカラレーベン	29,300	323.00	9,463,900	貸付株式数 10,600株
A V A N T I A	3,600	883.00	3,178,800	貸付株式数 1,300株
イオンモール	33,100	1,720.00	56,932,000	
毎日コムネット	2,700	749.00	2,022,300	
ファースト住建	2,900	1,322.00	3,833,800	貸付株式数 900株
ランド	371,200	12.00	4,454,400	貸付株式数 140,900株
カチタス	16,400	4,065.00	66,666,000	
東祥	4,300	1,820.00	7,826,000	貸付株式数 1,500株

トーセイ	9,300	1,169.00	10,871,700	貸付株式数	3,500株
穴吹興産	1,800	2,048.00	3,686,400	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	8,100	1,208.00	9,784,800		
インテリックス	2,000	753.00	1,506,000		
ランドビジネス	2,900	270.00	783,000	貸付株式数	800株
サンネクスタグループ	2,300	1,021.00	2,348,300	貸付株式数	800株
グランディハウス	5,200	485.00	2,522,000	貸付株式数	800株
東武鉄道	69,500	2,907.00	202,036,500		
相鉄ホールディングス	22,600	2,174.00	49,132,400	貸付株式数	8,700株
東急	168,300	1,494.00	251,440,200		
京浜急行	86,000	1,331.00	114,466,000		
小田急電鉄	107,300	2,569.00	275,653,700		
京王電鉄	37,400	6,000.00	224,400,000		
京成電鉄	50,500	3,520.00	177,760,000		
富士急行	9,200	4,565.00	41,998,000	貸付株式数	3,500株
新京成電鉄	1,900	2,160.00	4,104,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	118,200	7,131.00	842,884,200		
西日本旅客鉄道	60,000	5,302.00	318,120,000		
東海旅客鉄道	55,800	16,120.00	899,496,000		
西武ホールディングス	81,300	1,347.00	109,511,100		
鴻池運輸	10,400	1,371.00	14,258,400		
西日本鉄道	18,400	2,804.00	51,593,600	貸付株式数	7,100株
ハマキョウレックス	5,000	3,405.00	17,025,000		
サカイ引越センター	3,200	4,890.00	15,648,000	貸付株式数	1,200株
近鉄グループHLDGS	63,400	3,675.00	232,995,000	貸付株式数	100株
阪急阪神HLDGS	84,000	3,470.00	291,480,000		
南海電鉄	29,800	2,358.00	70,268,400	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	28,300	3,170.00	89,711,000		
神戸電鉄	1,500	3,610.00	5,415,000	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	52,300	2,000.00	104,600,000		
山陽電鉄	4,400	2,035.00	8,954,000	貸付株式数	1,700株
トランコム	2,000	8,770.00	17,540,000	貸付株式数	700株
日本通運	22,000	8,130.00	178,860,000		
ヤマトホールディングス	89,100	2,907.00	259,013,700		
山 九	16,200	5,310.00	86,022,000		
日 新	4,900	1,638.00	8,026,200		
丸 運	4,300	284.00	1,221,200	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	5,200	3,480.00	18,096,000		
センコーグループHLDGS	36,200	1,031.00	37,322,200	貸付株式数	13,900株

トナミホールディングス	1,500	5,190.00	7,785,000	
ニッコンホールディングス	21,300	2,408.00	51,290,400	
日石輸送	600	2,700.00	1,620,000	貸付株式数 100株
福山通運	8,100	4,835.00	39,163,500	貸付株式数 1,700株
セイノーホールディングス	47,600	1,426.00	67,877,600	貸付株式数 2,300株
エスライン	1,300	925.00	1,202,500	貸付株式数 400株
神奈川中央交通	1,500	3,650.00	5,475,000	貸付株式数 600株
日立物流	13,400	4,825.00	64,655,000	
丸和運輸機関	13,800	1,671.00	23,059,800	貸付株式数 5,200株
C & F ロジホールディングス	6,300	1,820.00	11,466,000	貸付株式数 300株
日本郵船	53,400	9,820.00	524,388,000	
商船三井	37,900	8,930.00	338,447,000	
川崎汽船	19,800	5,840.00	115,632,000	
N S ユナイテッド海運	3,200	3,795.00	12,144,000	
明治海運	7,000	766.00	5,362,000	貸付株式数 2,500株
飯野海運	29,300	544.00	15,939,200	
共栄タンカー	1,200	1,060.00	1,272,000	貸付株式数 300株
九州旅客鉄道	49,500	2,539.00	125,680,500	
S G ホールディングス	120,500	3,160.00	380,780,000	
日本航空	155,400	2,476.00	384,770,400	
A N A ホールディングス	172,000	2,716.00	467,152,000	
パスコ	1,300	1,491.00	1,938,300	
西本W I S M E T T A C H D	1,500	3,765.00	5,647,500	
シルバーライフ	1,500	1,905.00	2,857,500	貸付株式数 500株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	900	1,838.00	1,654,200	貸付株式数 200株
一家ダイニングプロジ	1,300	550.00	715,000	貸付株式数 500株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,900	5,190.00	15,051,000	
国際紙パルプ商事	13,600	372.00	5,059,200	貸付株式数 2,400株
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,011.00	1,617,600	
ブックオフG H D	3,700	980.00	3,626,000	貸付株式数 1,400株
三菱倉庫	22,000	3,310.00	72,820,000	
三井倉庫H O L D	6,900	2,784.00	19,209,600	貸付株式数 2,200株
住友倉庫	22,500	1,894.00	42,615,000	貸付株式数 1,000株
渋沢倉庫	3,400	2,336.00	7,942,400	
ヤマタネ	2,900	1,617.00	4,689,300	

東陽倉庫	9,600	344.00	3,302,400	貸付株式数	3,500株
乾汽船	4,500	2,541.00	11,434,500	貸付株式数	1,200株
日本トランスシティ	13,500	682.00	9,207,000	貸付株式数	1,100株
ケイヒン	1,100	1,423.00	1,565,300	貸付株式数	300株
中央倉庫	3,500	1,020.00	3,570,000		
川西倉庫	1,100	1,180.00	1,298,000	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,000	975.00	4,875,000	貸付株式数	600株
ファイズホールディングス	1,400	761.00	1,065,400	貸付株式数	300株
東洋埠頭	1,800	1,533.00	2,759,400		
宇徳	5,400	562.00	3,034,800	貸付株式数	400株
上組	34,900	2,453.00	85,609,700		
サンリツ	1,900	795.00	1,510,500	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,400	1,415.00	1,981,000	貸付株式数	500株
キューソー流通システム	1,500	1,795.00	2,692,500	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	12,000	2,826.00	33,912,000		
東海運	4,000	352.00	1,408,000	貸付株式数	500株
エーアイティー	4,100	1,100.00	4,510,000		
内外トランスライン	2,700	2,158.00	5,826,600	貸付株式数	100株
ショーエイコーポ	2,200	846.00	1,861,200	貸付株式数	600株
日本コンセプト	2,200	1,999.00	4,397,800		
TBSホールディングス	43,600	1,670.00	72,812,000	貸付株式数	2,500株
日本テレビHLD S	55,100	1,238.00	68,213,800	貸付株式数	5,100株
朝日放送グループHD	5,300	736.00	3,900,800	貸付株式数	2,100株
テレビ朝日HD	20,600	1,752.00	36,091,200	貸付株式数	5,400株
スカパーJ S A T H D	42,600	433.00	18,445,800		
テレビ東京HD	4,500	2,149.00	9,670,500	貸付株式数	600株
日本BS放送	2,000	1,124.00	2,248,000	貸付株式数	800株
ビジョン	11,900	1,270.00	15,113,000		
スマートバリュー	2,100	714.00	1,499,400	貸付株式数	600株
USEN-NEXT HLDGS	6,800	3,215.00	21,862,000	貸付株式数	100株
ワイヤレスゲート	3,100	429.00	1,329,900	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,200	1,608.00	6,753,600		
日本通信	60,900	242.00	14,737,800	貸付株式数	22,700株
クロップス	1,200	983.00	1,179,600	貸付株式数	400株
日本電信電話	770,500	3,244.00	2,499,502,000		
KDDI	528,400	3,735.00	1,973,574,000		
ソフトバンク	599,100	1,564.00	936,992,400		
光通信	7,800	20,850.00	162,630,000		
エムティーアイ	7,600	725.00	5,510,000	貸付株式数	2,500株

GMOインターネット	23,700	3,075.00	72,877,500	貸付株式数	9,000株
ファイバーゲート	2,900	1,671.00	4,845,900	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコ ミュ	1,700	385.00	654,500	貸付株式数	600株
KADOKAWA	17,300	5,570.00	96,361,000		
学研ホールディングス	9,600	1,251.00	12,009,600	貸付株式数	3,600株
ゼンリン	11,700	1,078.00	12,612,600	貸付株式数	4,000株
昭文社ホールディングス	3,400	512.00	1,740,800	貸付株式数	1,000株
インプレスホールディング ス	8,900	265.00	2,358,500	貸付株式数	300株
東京電力HD	573,400	288.00	165,139,200		
中部電力	204,900	1,322.00	270,877,800		
関西電力	253,500	1,053.00	266,935,500		
中国電力	97,700	1,026.00	100,240,200		
北陸電力	62,400	587.00	36,628,800		
東北電力	156,400	837.00	130,906,800		
四国電力	55,100	766.00	42,206,600		
九州電力	148,500	842.00	125,037,000		
北海道電力	64,300	513.00	32,985,900		
沖縄電力	13,000	1,433.00	18,629,000		
電源開発	53,300	1,646.00	87,731,800		
エフオン	4,500	881.00	3,964,500	貸付株式数	1,500株
イーレックス	10,200	2,494.00	25,438,800		
レノバ	11,700	5,090.00	59,553,000		
東京瓦斯	128,700	2,173.50	279,729,450		
大阪瓦斯	120,900	2,128.00	257,275,200		
東邦瓦斯	33,100	5,300.00	175,430,000	貸付株式数	8,300株
北海道瓦斯	3,500	1,576.00	5,516,000	貸付株式数	500株
広島ガス	11,700	382.00	4,469,400	貸付株式数	1,600株
西部ガスHLDGS	7,400	2,564.00	18,973,600		
静岡ガス	19,300	1,368.00	26,402,400		
メタウォーター	7,900	1,883.00	14,875,700		
アイネット	3,000	1,415.00	4,245,000	貸付株式数	1,300株
松竹	4,300	11,980.00	51,514,000	貸付株式数	1,700株
東宝	38,900	5,180.00	201,502,000		
エイチ・アイ・エス	14,500	2,488.00	36,076,000	貸付株式数	5,300株
東映	2,200	21,550.00	47,410,000	貸付株式数	800株
ラックランド	1,900	2,855.00	5,424,500	貸付株式数	600株
NTTデータ	175,800	2,121.00	372,871,800		
共立メンテナンス	10,700	3,710.00	39,697,000	貸付株式数	4,200株

イチネンホールディングス	6,200	1,278.00	7,923,600	貸付株式数	800株
建設技術研究所	4,100	2,557.00	10,483,700	貸付株式数	400株
スペース	3,900	933.00	3,638,700	貸付株式数	600株
長 大	2,600	1,931.00	5,020,600		
アインホールディングス	9,600	7,160.00	68,736,000		
燦ホールディングス	2,700	1,498.00	4,044,600	貸付株式数	1,000株
ピー・シー・エー	1,100	6,000.00	6,600,000		
スバル興業	400	8,480.00	3,392,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,273.00	2,927,900	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,000	1,506.00	1,506,000		
ビジネスB太田昭和	2,600	1,741.00	4,526,600	貸付株式数	300株
ナ ガ ワ	2,000	11,460.00	22,920,000	貸付株式数	800株
東京都競馬	5,000	4,130.00	20,650,000	貸付株式数	200株
常磐興産	2,600	1,460.00	3,796,000	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,000	2,632.00	28,952,000	貸付株式数	4,400株
D T S	14,000	2,703.00	37,842,000		
スクウェア・エニックス・HD	28,100	6,700.00	188,270,000		
シーイーシー	7,200	1,587.00	11,426,400		
カプコン	56,800	3,290.00	186,872,000		
西尾レントオール	5,800	3,050.00	17,690,000	貸付株式数	1,000株
アイ・エス・ビー	4,100	1,264.00	5,182,400	貸付株式数	800株
アゴーラ ホスピタリ ティーG	52,200	26.00	1,357,200		
日本空港ビルデング	23,100	5,180.00	119,658,000	貸付株式数	1,300株
トランス・コスモス	6,400	3,605.00	23,072,000	貸付株式数	500株
乃村工藝社	27,700	947.00	26,231,900	貸付株式数	6,400株
ジャステック	4,100	1,264.00	5,182,400		
S C S K	15,300	7,380.00	112,914,000		
藤田観光	2,700	2,304.00	6,220,800	貸付株式数	1,000株
K N T - C Tホールディングス	3,800	1,372.00	5,213,600	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,700	2,706.00	18,130,200	貸付株式数	2,500株
トーカイ	6,100	2,481.00	15,134,100		
白 洋 舎	700	2,074.00	1,451,800	貸付株式数	300株
セコム	63,100	8,655.00	546,130,500		
日本システムウエア	2,100	2,423.00	5,088,300		
セントラル警備保障	3,000	2,739.00	8,217,000	貸付株式数	1,100株
アイネス	6,800	1,600.00	10,880,000	貸付株式数	1,100株
丹青社	11,900	885.00	10,531,500		

メイテック	7,800	6,730.00	52,494,000	貸付株式数	1,300株
T K C	11,500	3,870.00	44,505,000		
富士ソフト	7,200	5,890.00	42,408,000		
応用地質	7,100	1,395.00	9,904,500	貸付株式数	2,700株
船井総研ホールディング	13,100	2,797.00	36,640,700		
N S D	21,600	2,119.00	45,770,400	貸付株式数	8,200株
進学会ホールディングス	2,600	422.00	1,097,200	貸付株式数	1,000株
丸紅建材リース	500	1,870.00	935,000	貸付株式数	200株
オ オ バ	4,200	845.00	3,549,000	貸付株式数	1,800株
コナミホールディングス	24,000	7,390.00	177,360,000		
いであ	1,500	1,890.00	2,835,000		
学 究 社	1,900	1,392.00	2,644,800	貸付株式数	700株
ベネッセホールディングス	23,600	2,454.00	57,914,400		
イオンディライト	7,800	3,675.00	28,665,000		
ナック	2,700	954.00	2,575,800	貸付株式数	300株
福井コンピュータH L D S	3,300	4,445.00	14,668,500	貸付株式数	100株
ダイセキ	12,960	4,825.00	62,532,000		
ステップ	2,300	1,816.00	4,176,800	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,600	5,350.00	24,610,000		
泉州電業	2,000	4,640.00	9,280,000		
元気寿司	1,800	2,623.00	4,721,400	貸付株式数	700株 (500株)
トラスコ中山	13,800	2,985.00	41,193,000	貸付株式数	1,900株
ヤマダホールディングス	221,000	488.00	107,848,000		
オートバックスセブン	23,400	1,569.00	36,714,600	貸付株式数	9,300株
モリト	4,500	677.00	3,046,500		
アークランドサカモト	10,300	1,635.00	16,840,500		
ニトリホールディングス	26,200	21,355.00	559,501,000		
グルメ杵屋	4,100	1,001.00	4,104,100	貸付株式数	1,600株
愛 眼	4,400	224.00	985,600	貸付株式数	1,700株
ケーユーホールディングス	3,400	1,028.00	3,495,200	貸付株式数	900株
吉野家ホールディングス	21,700	2,095.00	45,461,500	貸付株式数	8,400株
加藤産業	9,300	3,440.00	31,992,000		
北恵	1,800	1,016.00	1,828,800		
イノテック	3,700	1,467.00	5,427,900		
イエローハット	12,000	1,948.00	23,376,000		
松屋フーズH L D G S	2,900	3,650.00	10,585,000	貸付株式数	1,100株
J B C Cホールディングス	4,200	1,557.00	6,539,400		
J Kホールディングス	5,800	835.00	4,843,000	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	8,700	1,056.00	9,187,200	貸付株式数	3,400株

日 伝	5,300	2,467.00	13,075,100	貸付株式数	1,600株
関西スーパーマーケット	4,800	2,134.00	10,243,200	貸付株式数	400株
ミロク情報サービス	6,600	1,678.00	11,074,800	貸付株式数	1,700株
北沢産業	4,300	245.00	1,053,500	貸付株式数	1,000株
杉本商事	3,200	2,768.00	8,857,600		
因幡電機産業	17,500	2,820.00	49,350,000	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,100	6,010.00	24,641,000	貸付株式数	1,600株
ブレナス	7,500	2,055.00	15,412,500		
ミニストップ	5,400	1,497.00	8,083,800	貸付株式数	1,900株
アークス	12,700	2,370.00	30,099,000	貸付株式数	4,100株
パローホールディングス	13,300	2,552.00	33,941,600		
東 テ ク	2,300	2,721.00	6,258,300	貸付株式数	400株
ミスミグループ本社	82,900	4,620.00	382,998,000		
藤 久	1,700	738.00	1,254,600	貸付株式数	600株
アルテック	6,300	326.00	2,053,800		
ベ ル ク	3,200	6,170.00	19,744,000	貸付株式数	1,200株
大 庄	3,100	998.00	3,093,800	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,100	1,868.00	3,922,800	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	8,900	75,950.00	675,955,000		
ソフトバンクグループ	522,900	6,943.00	3,630,494,700		
蔵王産業	1,000	1,684.00	1,684,000	貸付株式数	200株
スズケン	28,000	3,375.00	94,500,000		
サンドラッグ	25,000	3,820.00	95,500,000		
サクスパーホールディング グ	5,000	565.00	2,825,000		
ジェコス	4,500	909.00	4,090,500	貸付株式数	1,100株
ヤマザワ	1,100	1,741.00	1,915,100	貸付株式数	500株
や ま や	1,200	2,522.00	3,026,400	貸付株式数	400株 (400株)
グローセル	6,400	424.00	2,713,600	貸付株式数	2,500株
ベルーナ	14,900	873.00	13,007,700		
合計			189,788,890,350		

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

ソニーグループ	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
本田技研	30,000株	三菱UFJフィナンシャルG	200,000株
三井住友フィナンシャルG	30,000株		

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

貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	132,331,462	326,662,382
金銭信託	611,292,668	-
コール・ローン	3,574,103,988	6,604,971,518
株式	140,999,174,005	221,009,477,811
投資証券	3,625,827,420	5,533,293,844
派生商品評価勘定	227,988,720	463,357,070
未収入金	1,065,022	11,156,628
未収配当金	240,871,993	391,065,230
差入委託証拠金	1,735,126,167	4,176,478,425
流動資産合計	151,147,781,445	238,516,462,908
資産合計	151,147,781,445	238,516,462,908
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	66,923,811	16,295,870
未払金	-	6,801,376
未払株式払込金	1,527,118	-
未払解約金	127,076,000	384,818,700
その他未払費用	3,885	-

流動負債合計		195,530,814	407,915,946
負債合計		195,530,814	407,915,946
純資産の部			
元本等			
元本	1	53,173,758,315	60,251,266,888
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		97,778,492,316	177,857,280,074
元本等合計		150,952,250,631	238,108,546,962
純資産合計		150,952,250,631	238,108,546,962
負債純資産合計		151,147,781,445	238,516,462,908

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(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>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	47,561,732,616円	53,173,758,315円
期中追加設定元本額	17,696,118,320円	12,755,960,042円
期中一部解約元本額	12,084,092,621円	5,678,451,469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	439,361,815円	370,726,578円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	8,557,277円	4,507,601円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	110,319,405円	67,214,370円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	14,001,565円	7,853,764円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	366,430,030円	244,897,359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)	18,593,234円	32,564,808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)	541,015,910円	514,519,583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)	2,242,049,126円	2,486,471,273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)	606,153,675円	508,487,417円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	10,398,463円	13,686,514円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	5,902,239円	24,909,382円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,799,731,151円	3,609,051,197円
i F r e e 8資産バランス	981,559,457円	1,073,964,819円
i F r e e 年金バランス	39,793,459円	149,879,817円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	32,722,733,370円	37,152,580,241円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	574,709,061円	502,369,024円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	958,205,575円	911,512,276円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	702,812,800円	708,790,899円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,560,012,347円	1,689,461,459円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,376,142円	- 円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	11,395,420円	12,030,768円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,524,388円	9,987,135円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	398,276,470円	725,213,325円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	2,180,139円	1,666,762円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	1,816,146円	1,940,773円

ダイワつみたてインデックス バランス70	2,181,059円	3,245,810円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	163,437,118円	114,170,055円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	290,286,800円	219,165,573円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,354,743,632円	1,583,968,789円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	116,241,855円	82,192,459円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	271,255,135円	211,630,253円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	-円	212,845,169円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	797,886,890円	888,805,556円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	179,112,353円	278,408,148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)	1,985,303,957円	2,930,323,613円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,754,569,782円	2,795,347,096円
ダイワライフスタイル25	18,766,733円	13,261,214円
ダイワライフスタイル50	64,142,004円	52,019,759円
ダイワライフスタイル75	49,922,333円	41,596,250円
計	53,173,758,315円	60,251,266,888円
2. 期末日における受益権の総数	53,173,758,315口	60,251,266,888口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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	2021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	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
--	-------------	-------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	7,024,537,187	37,922,850,948
投資証券	400,968,013	1,112,154,119
合計	6,623,569,174	39,035,005,067

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年12月3日から2020年9月7日まで、及び2020年12月1日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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								
株価指数 先物取引								
買 建	6,218,212,122	-	6,369,614,446	151,402,324	11,148,930,910	-	11,603,162,105	454,231,195
合計	6,218,212,122	-	6,369,614,446	151,402,324	11,148,930,910	-	11,603,162,105	454,231,195

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

種 類	2020年9月7日 現在				2021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								
買建	4,125,860,415	-	4,135,523,000	9,662,585	6,376,718,495	-	6,369,548,500	7,169,995
アメリカ・ドル	3,064,021,680	-	3,077,964,000	13,942,320	4,318,032,880	-	4,302,200,000	15,832,880
イギリス・ポンド	120,223,490	-	119,773,500	449,990	234,506,010	-	235,584,500	1,078,490
オーストラリア・ドル	128,690,925	-	127,858,500	832,425	229,508,505	-	233,130,000	3,621,495
カナダ・ドル	150,206,495	-	150,423,500	217,005	331,231,180	-	332,880,000	1,648,820
スイス・フラン	175,791,000	-	174,750,000	1,041,000	300,768,000	-	300,350,000	418,000
ユーロ	486,926,825	-	484,753,500	2,173,325	962,671,920	-	965,404,000	2,732,080
合計	4,125,860,415	-	4,135,523,000	9,662,585	6,376,718,495	-	6,369,548,500	7,169,995

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.8388円	3.9519円
(1万口当たり純資産額)	(28,388円)	(39,519円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	4,250	170.750	725,687.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,510	468.220	1,643,452.200	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,750	181.280	1,223,640.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,750	83.120	394,820.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,150	136.930	294,399.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	47.380	999,718.000	
	ABBOTT LABORATORIES	64,366	128.940	8,299,352.040	
	HOWMET AEROSPACE INC	14,133	31.370	443,352.210	
	VERISK ANALYTICS INC	5,650	205.080	1,158,702.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	12,650	43.130	545,594.500	
	AMPHENOL CORP-CL A	21,600	77.040	1,664,064.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,610	502.130	808,429.300	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	22,562	125.390	2,829,049.180	
	QORVO INC	4,070	185.360	754,415.200	
	AFLAC INC	23,600	55.710	1,314,756.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,800	148.050	710,640.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,050	86.080	520,784.000	
	ADOBE INC	17,320	666.590	11,545,338.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,650	45.430	347,539.500	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,530	388.330	1,759,134.900	
	GARMIN LTD	5,650	176.110	995,021.500	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,950	268.280	2,132,826.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,150	228.360	5,743,254.000		
WR BERKLEY CORP	5,275	74.450	392,723.750		
AUTOZONE INC	820	1,537.250	1,260,545.000		
DOLLAR TREE INC	8,321	92.810	772,272.010		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	41,900	9.480	397,212.000		
PINNACLE WEST CAPITAL	4,100	77.180	316,438.000		

CELANESE CORP	4,150	155.140	643,831.000	
DR HORTON INC	12,566	94.960	1,193,267.360	
DENTSPLY SIRONA INC	7,950	62.430	496,318.500	
AUTODESK INC	8,020	288.750	2,315,775.000	
MOODY'S CORP	6,160	385.390	2,374,002.400	
DEVON ENERGY CORP	23,300	29.170	679,661.000	
ALBEMARLE CORP	4,310	241.860	1,042,416.600	
ATMOS ENERGY CORP	4,850	97.500	472,875.000	
ALLIANT ENERGY CORP	9,050	61.470	556,303.500	
CITIGROUP INC	74,873	71.170	5,328,711.410	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,500	207.380	3,214,390.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,300	90.410	1,654,503.000	
ALLEGHANY CORP	480	662.770	318,129.600	
DOMINO'S PIZZA INC	1,430	514.500	735,735.000	
HESS CORP	10,200	69.910	713,082.000	
DAVITA INC	2,750	132.170	363,467.500	
DANAHER CORP	23,250	332.430	7,728,997.500	
FORTIVE CORP	11,700	75.500	883,350.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	20,550	121.130	2,489,221.500	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,150	60.200	1,213,030.000	
BUNGE LTD	5,100	77.390	394,689.000	
TE CONNECTIVITY LTD	11,925	149.670	1,784,814.750	
APPLE INC	605,600	154.300	93,444,080.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,050	122.990	1,359,039.500	
BOEING CO/THE	20,130	218.170	4,391,762.100	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,565	121.080	673,810.200	
BECTON DICKINSON AND CO	10,619	257.830	2,737,896.770	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	7,600	13.810	104,956.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,900	99.020	485,198.000	
NISOURCE INC	13,900	25.060	348,334.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,900	90.090	441,441.000	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	320	562.510	180,003.200	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,071	53.930	1,621,729.030	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	150,204	55.430	8,325,807.720	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,850	281.890	13,770,326.500	
ANSYS INC	3,200	368.380	1,178,816.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	49,067	56.450	2,769,832.150	

BLACKSTONE GROUP INC/THE	24,950	129.000	3,218,550.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	81,000	65.610	5,314,410.000	
JPMORGAN CHASE & CO	109,770	159.490	17,507,217.300	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,300	218.570	1,814,131.000	
LKQ CORP	10,250	50.840	521,110.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,830	152.470	279,020.100	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,412	70.930	809,453.160	
CADENCE DESIGN SYS INC	10,050	165.710	1,665,385.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,220	272.350	1,149,317.000	
DOLLAR GENERAL CORP	8,850	222.450	1,968,682.500	
SERVICENOW INC	7,150	678.630	4,852,204.500	
CATERPILLAR INC	19,850	210.370	4,175,844.500	
BROWN & BROWN INC	8,550	58.940	503,937.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,300	49.430	410,269.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,800	449.550	809,190.000	
CMS ENERGY CORP	10,650	64.960	691,824.000	
MOSAIC CO/THE	12,800	32.150	411,520.000	
DELTA AIR LINES INC	5,750	40.250	231,437.500	
CORNING INC	29,400	39.490	1,161,006.000	
CISCO SYSTEMS INC	152,950	59.420	9,088,289.000	
MORGAN STANLEY	50,652	104.250	5,280,471.000	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	97.080	203,868.000	
MSCI INC	3,000	650.750	1,952,250.000	
FAIR ISAAC CORP	1,000	467.230	467,230.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,200	332.790	399,348.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,500	74.000	629,000.000	
BROADCOM INC	14,812	497.680	7,371,636.160	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,350	197.460	858,951.000	
ARAMARK	8,500	34.130	290,105.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,170	120.750	865,777.500	
CENTENE CORP	21,387	64.370	1,376,681.190	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,950	126.250	498,687.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,700	43.070	676,199.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,500	145.490	1,091,175.000	
GARTNER INC	3,150	313.350	987,052.500	
SPLUNK INC	6,010	158.440	952,224.400	
DOMINION ENERGY INC	29,441	78.380	2,307,585.580	
MONSTER BEVERAGE CORP	14,300	97.580	1,395,394.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,000	73.240	366,200.000	

DEERE & CO	10,800	389.340	4,204,872.000	
POOL CORP	1,480	496.890	735,397.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,684	158.010	1,688,178.840	
VMWARE INC-CLASS A	3,030	145.110	439,683.300	
CABLE ONE INC	200	2,085.430	417,086.000	
BURLINGTON STORES INC	2,400	297.500	714,000.000	
NASDAQ INC	4,200	198.530	833,826.000	
VAIL RESORTS INC	1,490	291.580	434,454.200	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	18,400	44.020	809,968.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,630	137.800	362,414.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	12,600	76.300	961,380.000	
COGNEX CORP	6,500	88.460	574,990.000	
TELEFLEX INC	1,720	398.430	685,299.600	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,050	181.080	552,294.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,710	464.380	1,258,469.800	
BIO-RAD LABORATORIES-A	790	819.700	647,563.000	
CATALENT INC	6,200	140.350	870,170.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,050	317.640	1,604,082.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,120	274.750	582,470.000	
IDEX CORP	2,760	222.570	614,293.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,350	77.910	2,286,658.500	
ROLLINS INC	8,087	39.710	321,134.770	
AMETEK INC	8,445	135.400	1,143,453.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,900	84.390	751,071.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,550	53.190	295,204.500	
HEICO CORP	1,600	124.440	199,104.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,320	453.750	1,052,700.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	385.910	540,274.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,700	95.730	928,581.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,500	488.100	732,150.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,060	462.550	7,428,553.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,800	123.010	344,428.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,000	643.390	1,286,780.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,600	81.800	376,280.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,000	1,920.010	1,920,010.000	
UGI CORP	7,650	46.880	358,632.000	

CUMMINS INC	5,350	238.570	1,276,349.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,350	81.180	2,301,453.000	
CDW CORP/DE	5,100	202.700	1,033,770.000	
COSTAR GROUP INC	14,500	87.860	1,273,970.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,020	571.510	1,154,450.200	
AMERCO	370	655.020	242,357.400	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,640	301.150	1,096,186.000	
MERCADOLIBRE INC	1,610	1,946.010	3,133,076.100	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,760	175.740	485,042.400	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,016	123.080	1,232,769.280	
IPG PHOTONICS CORP	1,420	174.220	247,392.400	
DEXCOM INC	3,540	542.430	1,920,202.200	
NORDSON CORP	1,910	241.450	461,169.500	
COPART INC	7,830	145.630	1,140,282.900	
SEAGEN INC	4,950	152.220	753,489.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,710	721.500	1,955,265.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,890	602.270	1,138,290.300	
BIO-TECHNE CORP	1,400	513.090	718,326.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,350	95.870	321,164.500	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,750	110.010	852,577.500	
KINDER MORGAN INC	73,381	16.340	1,199,045.540	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	252.950	2,478,910.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,400	475.220	665,308.000	
T-MOBILE US INC	22,677	136.000	3,084,072.000	
ZILLOW GROUP INC - C	5,950	97.560	580,482.000	
COCA-COLA CO/THE	148,650	56.730	8,432,914.500	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,350	61.060	448,791.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,150	123.570	759,955.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,150	32.000	356,800.000	
CSX CORP	82,100	32.000	2,627,200.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,460	306.650	1,061,009.000	
EXPEDIA GROUP INC	5,175	142.640	738,162.000	
AUTOLIV INC	2,950	87.720	258,774.000	
AMAZON.COM INC	16,470	3,478.050	57,283,483.500	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22,690	121.070	2,747,078.300	
EXXON MOBIL CORP	153,605	54.870	8,428,306.350	

AES CORP	24,600	24.640	606,144.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,500	256.640	384,960.000	
EOG RESOURCES INC	21,000	67.990	1,427,790.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,000	113.800	682,800.000	
ABIOMED INC	1,610	372.690	600,030.900	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,680	125.140	710,795.200	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,170	179.280	2,002,557.600	
FORD MOTOR CO	143,323	12.890	1,847,433.470	
NOVAVAX INC	2,600	251.490	653,874.000	
DISCOVERY INC - A	6,290	28.310	178,069.900	
EXACT SCIENCES CORP	6,250	107.980	674,875.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,637	28.660	161,556.420	
LIBERTY BROADBAND-A	850	185.310	157,513.500	
DISCOVERY INC-C	11,389	27.160	309,325.240	
FORTINET INC	5,050	320.190	1,616,959.500	
MARKEL CORP	510	1,255.660	640,386.600	
NEXTERA ENERGY INC	71,180	85.690	6,099,414.200	
MASIMO CORP	1,920	276.980	531,801.600	
FREEMPORT-MCMORAN INC	53,608	36.140	1,937,393.120	
INSULET CORP	2,440	302.590	738,319.600	
US BANCORP	51,200	56.150	2,874,880.000	
UNITED RENTALS INC	2,570	351.370	903,020.900	
F5 NETWORKS INC	2,250	203.610	458,122.500	
FASTENAL CO	21,050	55.890	1,176,484.500	
FISERV INC	21,933	115.660	2,536,770.780	
GENERAL ELECTRIC CO	39,856	104.750	4,174,916.000	
GENERAL MOTORS CO	47,650	48.820	2,326,273.000	
ZENDESK INC	4,370	125.080	546,599.600	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,750	202.460	1,771,525.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,350	411.310	5,079,678.500	
ALPHABET INC-CL A	10,900	2,874.790	31,335,211.000	
ALPHABET INC-CL C	10,557	2,895.500	30,567,793.500	
OWENS CORNING	3,900	95.400	372,060.000	
GENERAL MILLS INC	22,050	57.770	1,273,828.500	
FIRSTENERGY CORP	19,768	39.590	782,615.120	
GENUINE PARTS CO	5,100	122.180	623,118.000	
IHS MARKIT LTD	13,884	122.240	1,697,180.160	
FIFTH THIRD BANCORP	25,900	38.510	997,409.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,550	231.740	1,749,637.000	

HALLIBURTON CO	32,600	20.170	657,542.000	
HOME DEPOT INC	38,550	330.340	12,734,607.000	
ASSURANT INC	2,250	170.370	383,332.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	52,900	15.250	806,725.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,510	203.170	306,786.700	
HERSHEY CO/THE	5,390	177.990	959,366.100	
HUMANA INC	4,720	415.560	1,961,443.200	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,100	212.990	2,151,199.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,820	250.810	707,284.200	
HENRY SCHEIN INC	5,100	78.380	399,738.000	
HP INC	47,300	29.860	1,412,378.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	47,600	15.480	736,848.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	50.100	299,497.800	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,000	51.400	359,800.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	50.160	147,972.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,400	39.430	567,792.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	24,303	35.830	870,776.490	
ENPHASE ENERGY INC	4,690	173.940	815,778.600	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	32,400	139.580	4,522,392.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,750	59.920	823,900.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,900	98.140	480,886.000	
ZOETIS INC	17,300	209.690	3,627,637.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,779	199.940	1,755,273.260	
CHENIERE ENERGY INC	8,850	89.920	795,792.000	
ALLEGION PLC	3,300	148.130	488,829.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	28.850	374,271.050	
WASTE CONNECTIONS INC	9,487	131.280	1,245,453.360	
JUNIPER NETWORKS INC	12,200	28.980	353,556.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,050	120.610	488,470.500	
JOHNSON & JOHNSON	95,500	175.040	16,716,320.000	
PLUG POWER INC	18,600	26.400	491,040.000	
ABBVIE INC	64,072	111.620	7,151,716.640	
HOLOGIC INC	9,150	80.250	734,287.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	12,200	140.750	1,717,150.000	

KROGER CO	26,400	46.650	1,231,560.000	
KLA CORP	5,560	341.750	1,900,130.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,030	356.000	3,214,680.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,930	261.920	767,425.600	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	9,700	65.600	636,320.000	
LOWE'S COS INC	26,000	205.980	5,355,480.000	
ELI LILLY & CO	29,535	259.530	7,665,218.550	
LAM RESEARCH CORP	5,200	610.710	3,175,692.000	
LOEWS CORP	8,300	54.760	454,508.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	67.560	449,206.440	
MCDONALD'S CORP	27,050	238.820	6,460,081.000	
3M CO	21,040	194.390	4,089,965.600	
FACEBOOK INC-CLASS A	86,900	376.260	32,696,994.000	
S&P GLOBAL INC	8,770	452.080	3,964,741.600	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,310	374.480	865,048.800	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,920	285.800	548,736.000	
PHILLIPS 66	15,750	69.620	1,096,515.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	42.540	682,767.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,200	88.080	810,336.000	
METLIFE INC	27,000	61.220	1,652,940.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	29,950	61.510	1,842,224.500	
ARISTA NETWORKS INC	2,120	363.120	769,814.400	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	69.110	331,728.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,228	244.850	1,524,925.800	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	850	1,575.310	1,339,013.500	
BAKER HUGHES CO	26,523	23.160	614,272.680	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,190	324.000	1,357,560.000	
MERCK & CO. INC.	91,821	77.260	7,094,090.460	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	72.080	1,495,732.080	
MASCO CORP	9,100	61.190	556,829.000	
M & T BANK CORP	4,689	138.960	651,583.440	
MARSH & MCLENNAN COS	18,520	159.500	2,953,940.000	
BLACK KNIGHT INC	5,600	75.890	424,984.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,720	113.340	308,284.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	10,172	133.000	1,352,876.000	
WORKDAY INC-CLASS A	6,900	277.740	1,916,406.000	

WAYFAIR INC- CLASS A	2,710	273.540	741,293.400	
SQUARE INC - A	14,200	269.740	3,830,308.000	
TRANSUNION	6,900	124.470	858,843.000	
VISTRA CORP	15,650	19.110	299,071.500	
NOVOCURE LTD	3,450	138.550	477,997.500	
NETAPP INC	8,200	91.350	749,070.000	
NIKE INC -CL B	46,200	163.290	7,543,998.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,050	250.400	2,266,120.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,050	156.830	1,576,141.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,570	139.040	635,412.800	
ALLY FINANCIAL INC	13,650	51.060	696,969.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,710	365.930	2,089,460.300	
APTIV PLC	9,750	149.930	1,461,817.500	
NEWMONT CORP	29,311	59.670	1,748,987.370	
MCKESSON CORP	5,750	206.280	1,186,110.000	
XYLEM INC	6,670	137.250	915,457.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	56,500	106.100	5,994,650.000	
NUCOR CORP	10,950	114.050	1,248,847.500	
SUNRUN INC	6,100	45.540	277,794.000	
WESTERN UNION CO	15,246	21.720	331,143.120	
GODADDY INC - CLASS A	6,000	74.960	449,760.000	
NEWELL BRANDS INC	13,442	25.660	344,921.720	
EVERGY INC	8,250	68.500	565,125.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	34,324	25.920	889,678.080	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	900	180.870	162,783.000	
OKTA INC	4,510	270.400	1,219,504.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,550	261.910	667,870.500	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	190.800	1,068,480.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,755	34.150	538,033.250	
LINDE PLC	18,846	313.430	5,906,901.780	
WIX.COM LTD	2,130	233.720	497,823.600	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,300	31.210	446,303.000	
KKR & CO INC	18,800	64.440	1,211,472.000	
PAYCHEX INC	11,700	113.600	1,329,120.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,480	584.800	1,450,304.000	
ALTRIA GROUP INC	66,700	50.970	3,399,699.000	
P G & E CORP	55,100	9.150	504,165.000	
PFIZER INC	203,113	46.840	9,513,812.920	
CIGNA CORP	12,620	216.920	2,737,530.400	

DELL TECHNOLOGIES -C	10,101	97.140	981,211.140	
ALTICE USA INC- A	10,900	28.270	308,143.000	
XCEL ENERGY INC	19,700	69.800	1,375,060.000	
STERIS PLC	3,600	217.820	784,152.000	
SEA LTD-ADR	2,700	353.360	954,072.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	34.130	185,428.290	
FOX CORP - CLASS A	12,199	36.890	450,021.110	
STRYKER CORP	12,330	276.650	3,411,094.500	
LYFT INC-A	9,200	48.210	443,532.000	
DOW INC	27,368	62.120	1,700,100.160	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,850	88.410	340,378.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,740	298.290	2,308,764.600	
PARKER HANNIFIN CORP	4,660	289.910	1,350,980.600	
UBER TECHNOLOGIES INC	44,500	40.320	1,794,240.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,450	149.880	1,266,486.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	88,667	144.050	12,772,481.350	
EXELON CORP	35,772	49.820	1,782,161.040	
TELADOC HEALTH INC	5,100	144.560	737,256.000	
INGERSOLL-RAND INC	14,708	52.940	778,641.520	
NVR INC	120	5,100.640	612,076.800	
CONOCOPHILLIPS	49,202	56.240	2,767,120.480	
TWILIO INC - A	5,950	367.230	2,185,018.500	
DOCUSIGN INC	7,100	310.050	2,201,355.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,890	496.260	937,931.400	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,000	115.960	579,800.000	
PEPSICO INC	50,100	157.090	7,870,209.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,500	170.000	255,000.000	
DROPBOX INC-CLASS A	11,400	32.390	369,246.000	
MONGODB INC	2,020	507.410	1,024,968.200	
SNAP INC - A	34,750	75.080	2,609,030.000	
CORTEVA INC	26,918	44.920	1,209,156.560	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,300	104.890	1,499,927.000	
AMCOR PLC	56,400	12.680	715,152.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,900	278.230	1,919,787.000	
ROKU INC	4,220	342.270	1,444,379.400	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,550	185.150	1,212,732.500	
ACCENTURE PLC-CL A	23,050	343.330	7,913,756.500	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,750	185.210	509,327.500	
PENTAIR PLC	5,925	77.870	461,379.750	
QUALCOMM INC	40,850	144.630	5,908,135.500	
INVESCO LTD	14,100	24.880	350,808.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	199.440	468,684.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,000	66.000	660,000.000	
DATADOG INC - CLASS A	6,800	138.060	938,808.000	
PINTEREST INC- CLASS A	19,900	56.590	1,126,141.000	
AVALARA INC	3,050	189.780	578,829.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,800	679.570	2,582,366.000	
REPUBLIC SERVICES INC	8,250	125.470	1,035,127.500	
BOOKING HOLDINGS INC	1,500	2,304.450	3,456,675.000	
ROSS STORES INC	13,100	115.380	1,511,478.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,450	152.450	525,952.500	
RESMED INC	5,330	295.800	1,576,614.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	155.840	737,123.200	
ROBERT HALF INTL INC	4,150	103.650	430,147.500	
MODERNA INC	12,370	416.700	5,154,579.000	
HUBSPOT INC	1,590	704.090	1,119,503.100	
PERKINELMER INC	4,130	190.500	786,765.000	
CARRIER GLOBAL CORP	30,237	57.410	1,735,906.170	
OTIS WORLDWIDE CORP	14,938	91.820	1,371,607.160	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	6,300	61.810	389,403.000	
AVANTOR INC	19,350	40.720	787,932.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	5,700	50.090	285,513.000	
DYNATRACE INC	6,700	70.930	475,231.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	15,820	78.200	1,237,124.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	35,185	19.710	693,496.350	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,550	39.310	257,480.500	
IAC/INTERACTIVECORP	2,880	132.060	380,332.800	
MATCH GROUP INC	9,370	148.190	1,388,540.300	
CHEVRON CORP	70,118	97.490	6,835,803.820	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	9,400	98.560	926,464.000	
ZSCALER INC	3,000	287.400	862,200.000	
EDISON INTERNATIONAL	14,000	58.650	821,100.000	
ETSY INC	4,650	220.380	1,024,767.000	

TESLA INC	29,620	733.570	21,728,343.400
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,000	310.000	2,170,000.000
NORTONLIFELOCK INC	21,400	27.280	583,792.000
DRAFTKINGS INC - CL A	11,700	61.020	713,934.000
UNITY SOFTWARE INC	2,100	133.610	280,581.000
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,852	191.100	1,118,317.200
SYNOPSYS INC	5,580	336.640	1,878,451.200
CARVANA CO	2,620	328.660	861,089.200
CHEWY INC - CLASS A	3,250	76.750	249,437.500
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,500	130.440	1,108,740.000
PPD INC	4,400	46.720	205,568.000
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,785	811.330	3,882,214.050
VIATRIS INC	43,321	14.890	645,049.690
DOORDASH INC - A	2,700	193.460	522,342.000
AIRBNB INC-CLASS A	4,600	158.000	726,800.000
CBRE GROUP INC - A	12,150	98.560	1,197,504.000
TWITTER INC	29,200	64.660	1,888,072.000
SOUTHERN CO/THE	38,650	66.270	2,561,335.500
SYSCO CORP	18,750	77.350	1,450,312.500
TRAVELERS COS INC/THE	9,103	159.170	1,448,924.510
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	106.350	212,700.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	62.040	266,772.000
STEEL DYNAMICS INC	7,650	66.770	510,790.500
SCHLUMBERGER LTD	50,352	28.090	1,414,387.680
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,850	58.210	340,528.500
AT&T INC	258,991	27.560	7,137,791.960
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,550	48.860	271,173.000
ON SEMICONDUCTOR CORP	15,500	45.710	708,505.000
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,500	103.560	776,700.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,170	307.430	2,819,133.100
SEMPRA ENERGY	11,400	133.410	1,520,874.000
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,500	67.180	436,670.000
CLARIVATE PLC	12,500	26.260	328,250.000
OAK STREET HEALTH INC	3,600	49.890	179,604.000
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	56,000	26.640	1,491,840.000
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,950	90.320	718,044.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	33,500	189.880	6,360,980.000

SALESFORCE.COM INC	35,216	267.080	9,405,489.280	
WESTROCK CO	9,880	52.600	519,688.000	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25,934	75.020	1,945,568.680	
TERADYNE INC	6,050	121.880	737,374.000	
JACKSON FINANCIAL INC CLASS A WHEN	2,377	28.770	68,386.290	
UNION PACIFIC CORP	24,080	214.910	5,175,032.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,488	58.240	1,367,941.120	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	54,929	83.650	4,594,810.850	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	26,200	197.340	5,170,308.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,044	263.220	1,854,121.680	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	64.430	280,270.500	
AMEREN CORPORATION	9,200	88.110	810,612.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	34,216	422.860	14,468,577.760	
VERISIGN INC	3,700	220.230	814,851.000	
VALERO ENERGY CORP	14,792	64.700	957,042.400	
ULTA BEAUTY INC	1,890	382.110	722,187.900	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,888	48.080	475,415.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	156.220	442,102.600	
ANTHEM INC	8,920	378.730	3,378,271.600	
WALT DISNEY CO/THE	65,862	181.000	11,921,022.000	
WELLS FARGO & CO	149,922	44.170	6,622,054.740	
WASTE MANAGEMENT INC	15,200	155.400	2,362,080.000	
WILLIAMS COS INC	43,800	24.970	1,093,686.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,250	198.800	844,900.000	
WHIRLPOOL CORP	2,320	225.870	524,018.400	
WALMART INC	56,100	149.250	8,372,925.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,650	146.740	1,122,561.000	
WYNN RESORTS LTD	3,700	100.300	371,110.000	
WABTEC CORP	6,511	90.230	587,487.530	
TJX COMPANIES INC	43,800	71.070	3,112,866.000	
WATERS CORP	2,230	423.400	944,182.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,890	590.600	1,116,234.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26,500	51.290	1,359,185.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,743	228.520	1,083,870.360	
WESTERN DIGITAL CORP	11,250	61.410	690,862.500	

WEC ENERGY GROUP INC	11,430	96.080	1,098,194.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,250	64.140	1,170,555.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	61,250	225.110	13,787,987.500	
PPL CORP	27,900	30.090	839,511.000	
PULTEGROUP INC	9,450	53.390	504,535.500	
PPG INDUSTRIES INC	8,530	155.660	1,327,779.800	
NORTHERN TRUST CORP	7,300	117.350	856,655.000	
NVIDIA CORP	90,380	228.430	20,645,503.400	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,463	191.520	2,961,473.760	
TYSON FOODS INC-CL A	10,850	78.230	848,795.500	
NETFLIX INC	16,070	590.530	9,489,817.100	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,240	568.110	8,089,886.400	
NRG ENERGY INC	8,650	45.430	392,969.500	
GLOBE LIFE INC	3,655	94.290	344,629.950	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,450	202.130	1,303,738.500	
TEXTRON INC	8,300	72.550	602,165.000	
NEWS CORP - CLASS A	14,137	22.560	318,930.720	
OMNICOM GROUP	7,950	73.740	586,233.000	
ORACLE CORP	68,133	90.000	6,131,970.000	
MASTERCARD INC - A	32,050	340.230	10,904,371.500	
ONEOK INC	16,400	53.170	871,988.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,752	12.130	421,541.760	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,800	486.220	1,847,636.000	
YUM! BRANDS INC	10,850	130.920	1,420,482.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,250	160.560	682,380.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,950	46.980	326,511.000	
BANK OF AMERICA CORP	279,401	41.050	11,469,411.050	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,720	448.810	771,953.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,750	84.950	573,412.500	
AMERICAN EXPRESS CO	24,750	159.300	3,942,675.000	
ANALOG DEVICES INC	19,391	162.440	3,149,874.040	
ADVANCED MICRO DEVICES	44,150	109.920	4,852,968.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	31,172	55.100	1,717,577.200	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,950	183.010	1,088,909.500	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,450	79.430	671,183.500	
AVERY DENNISON CORP	3,030	225.730	683,961.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,150	76.550	1,465,932.500	
EMERSON ELECTRIC CO	21,550	105.380	2,270,939.000	
AON PLC-CLASS A	8,240	291.430	2,401,383.200	
AMGEN INC	20,850	226.370	4,719,814.500	
EATON CORP PLC	14,586	166.380	2,426,818.680	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,250	211.830	1,323,937.500	
APPLIED MATERIALS INC	33,250	135.830	4,516,347.500	
CME GROUP INC	13,120	195.300	2,562,336.000	
ECOLAB INC	9,400	225.140	2,116,316.000	
EQUIFAX INC	4,430	278.280	1,232,780.400	
GILEAD SCIENCES INC	45,650	71.960	3,284,974.000	
KEURIG DR PEPPER INC	25,500	35.240	898,620.000	
HORMEL FOODS CORP	10,550	42.810	451,645.500	
STATE STREET CORP	12,463	92.890	1,157,688.070	
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,540	72.090	3,787,608.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,200	82.710	1,505,322.000	
CAMPBELL SOUP CO	7,000	43.050	301,350.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	111.800	556,764.000	
CARDINAL HEALTH INC	10,400	53.640	557,856.000	
FEDEX CORP	9,200	266.040	2,447,568.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,504	157.260	2,595,419.040	
FMC CORP	4,650	95.280	443,052.000	
CERNER CORP	10,850	75.690	821,236.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,013	150.910	1,360,151.830	
CITRIX SYSTEMS INC	4,600	102.750	472,650.000	
INTEL CORP	146,500	53.510	7,839,215.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14,200	37.300	529,660.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,150	68.090	895,383.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,550	228.530	2,639,521.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.330	244,338.000	
ILLUMINA INC	5,330	466.980	2,489,003.400	
SEALED AIR CORP	5,400	61.220	330,588.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,290	1,071.770	4,597,893.300	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	124.360	540,966.000	
SNAP-ON INC	2,020	226.900	458,338.000	
CARMAX INC	5,800	127.150	737,470.000	

DUKE ENERGY CORP	28,028	105.680	2,961,999.040	
TARGET CORP	17,950	244.310	4,385,364.500	
DOVER CORP	5,200	174.930	909,636.000	
WW GRAINGER INC	1,580	429.650	678,847.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,720	137.100	647,112.000	
CINTAS CORP	3,420	396.530	1,356,132.600	
CONAGRA BRANDS INC	17,300	33.490	579,377.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,450	63.580	346,511.000	
CLOROX COMPANY	4,430	169.510	750,929.300	
ENTERGY CORP	7,420	112.560	835,195.200	
MICROSOFT CORP	259,600	301.140	78,175,944.000	
INCYTE CORP	6,930	76.090	527,303.700	
CVS HEALTH CORP	47,769	87.470	4,178,354.430	
MEDTRONIC PLC	48,898	134.630	6,583,137.740	
MICRON TECHNOLOGY INC	40,850	73.810	3,015,138.500	
BLACKROCK INC	5,510	937.280	5,164,412.800	
CENTERPOINT ENERGY INC	21,100	25.940	547,334.000	
HASBRO INC	4,700	99.360	466,992.000	
KELLOGG CO	9,300	63.440	589,992.000	
KEYCORP	35,400	20.050	709,770.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,350	291.630	976,960.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	51,061	61.720	3,151,484.920	
COOPER COS INC/THE	1,770	455.920	806,978.400	
CHUBB LTD	16,219	183.460	2,975,537.740	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	117.430	317,061.000	
ALLSTATE CORP	10,950	133.970	1,466,971.500	
EBAY INC	24,900	76.530	1,905,597.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	40,500	289.130	11,709,765.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,050	112.560	568,428.000	
XILINX INC	8,850	155.960	1,380,246.000	
DISH NETWORK CORP-A	8,900	45.430	404,327.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,470	341.830	2,895,300.100	
TRIMBLE INC	9,050	94.860	858,483.000	
LENNAR CORP-A	10,050	105.610	1,061,380.500	
LEAR CORP	2,150	159.370	342,645.500	
PROGRESSIVE CORP	21,390	96.230	2,058,359.700	
PACCAR INC	12,537	84.430	1,058,498.910	

	BIOGEN INC	5,520	333.600	1,841,472.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,090	688.330	2,126,939.700	
	STARBUCKS CORP	42,750	117.190	5,009,872.500	
	PTC INC	4,020	132.990	534,619.800	
	EVERSOURCE ENERGY	12,410	91.990	1,141,595.900	
	INTUIT INC	9,880	563.250	5,564,910.000	
	BORGWARNER INC	8,750	43.140	377,475.000	
	BEST BUY CO INC	8,250	114.020	940,665.000	
	BALL CORP	11,984	97.380	1,167,001.920	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	51,797	44.920	2,326,721.240	
	ELECTRONIC ARTS INC	10,570	146.600	1,549,562.000	
	VULCAN MATERIALS CO	4,900	180.310	883,519.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,350	198.050	1,851,767.500	
	VF CORP	12,250	76.230	933,817.500	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	22,025	41.280	909,192.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	194.070	426,954.000	
	CARNIVAL CORP	30,000	22.960	688,800.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	166,090	61.720	10,251,074.800	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,300	55.310	459,073.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,800	4.200	188,160.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,463,834,129.310 (160,699,710,717)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	733,000	2.984	2,187,638.500	
	UNILEVER PLC	94,860	40.020	3,796,297.200	
	BARCLAYS PLC	622,300	1.856	1,154,988.800	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	300,500	1.120	336,680.200	
	PRUDENTIAL PLC	95,100	15.535	1,477,378.500	
	NATWEST GROUP PLC	210,291	2.152	452,546.230	
	EVRAZ PLC	17,400	6.034	104,991.600	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	29.370	207,469.680	
	BAE SYSTEMS PLC	117,000	5.644	660,348.000	
	AVIVA PLC	142,366	4.157	591,815.460	
	AVEVA GROUP PLC	4,400	42.200	185,680.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	182,300	14.882	2,712,988.600	
	INFORMA PLC	52,700	5.546	292,274.200	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	159,540	1.908	304,402.320	

AUTO TRADER GROUP PLC	35,000	6.428	224,980.000	
DCC PLC	3,400	63.980	217,532.000	
OCADO GROUP PLC	17,500	20.170	352,975.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,750	166.000	456,500.000	
HALMA PLC	13,700	30.570	418,809.000	
ENTAIN PLC	21,200	19.485	413,082.000	
JD SPORTS FASHION PLC	17,200	10.490	180,428.000	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	23,500	6.300	148,050.000	
M&G PLC	91,700	2.036	186,701.200	
RELX PLC	70,396	22.130	1,557,863.480	
DIAGEO PLC	84,700	35.615	3,016,590.500	
RIO TINTO PLC	40,700	53.370	2,172,159.000	
STANDARD CHARTERED PLC	97,000	4.593	445,521.000	
TESCO PLC	280,684	2.574	722,480.610	
SMITH & NEPHEW PLC	31,950	13.955	445,862.250	
GLENCORE PLC	364,525	3.382	1,232,823.550	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,450	14.995	186,687.750	
SMITHS GROUP PLC	14,383	14.550	209,272.650	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	46,583	3.131	145,851.370	
PEARSON PLC	25,763	7.608	196,004.900	
SAINSBURY (J) PLC	59,525	3.035	180,658.370	
NEXT PLC	4,850	79.240	384,314.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	127,700	1.779	227,178.300	
WHITBREAD PLC	7,361	31.840	234,374.240	
BUNZL PLC	11,905	26.000	309,530.000	
VODAFONE GROUP PLC	1,014,183	1.216	1,233,246.520	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,011	93.040	466,223.440	
KINGFISHER PLC	73,711	3.527	259,978.690	
WPP PLC	42,900	10.055	431,359.500	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	24,827	10.610	263,414.470	
SEVERN TRENT PLC	9,083	28.130	255,504.790	
RENTOKIL INITIAL PLC	67,300	5.928	398,954.400	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,000	57.200	1,487,200.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	19,450	16.920	329,094.000	
SCHRODERS PLC	4,150	38.340	159,111.000	
SSE PLC	37,600	16.505	620,588.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	36,700	7.146	262,258.200	
ASTRAZENECA PLC	56,100	86.450	4,849,845.000	

FERGUSON PLC	8,087	107.650	870,565.550	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	215,200	2.834	609,876.800	
3I GROUP PLC	35,091	13.390	469,868.490	
ASHTED GROUP PLC	16,150	57.880	934,762.000	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	7.566	303,502.520	
NATIONAL GRID PLC	129,634	9.364	1,213,892.770	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,575,465	0.437	1,127,409.800	
IMPERIAL BRANDS PLC	34,100	15.695	535,199.500	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	3,832	48.000	183,936.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	79,060	27.380	2,164,662.800	
BHP GROUP PLC	76,827	21.180	1,627,195.860	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,850	19.615	252,052.750	
HSBC HOLDINGS PLC	741,650	3.872	2,872,039.620	
ANGLO AMERICAN PLC	46,583	30.785	1,434,057.650	
MONDI PLC	17,600	20.500	360,800.000	
WM MORRISON SUPERMARKETS	88,100	2.900	255,490.000	
COMPASS GROUP PLC	64,739	14.825	959,755.670	
PERSIMMON PLC	11,200	28.780	322,336.000	
BT GROUP PLC	320,600	1.648	528,348.800	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,150	26.350	188,402.500	
BURBERRY GROUP PLC	14,289	19.350	276,492.150	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	6,436	46.070	296,506.520	
INTERTEK GROUP PLC	5,850	54.260	317,421.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,049	82.020	988,258.980	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	148,900	14.432	2,148,924.800	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	134,618	14.414	1,940,383.850	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	26.030	148,371.000	
ADMIRAL GROUP PLC	7,050	35.100	247,455.000	
ANTOFAGASTA PLC	14,100	14.345	202,264.500	
ABRDN PLC	77,862	2.658	206,957.190	
EXPERIAN PLC	33,654	33.130	1,114,957.020	
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 64,850,653.560 (9,857,947,847)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	44,300	16.900	748,670.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,650	305.900	504,735.000	
	ICL GROUP LTD	28,100	22.700	637,870.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	461.100	438,045.000	
	BANK HAPOALIM BM	44,100	27.800	1,225,980.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,200	26.650	1,497,730.000	
	NICE LTD	2,400	941.600	2,259,840.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,400	105.800	571,320.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 7,884,190.000 (270,138,368)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	97,000	3.600	349,200.000	
	BHP GROUP LTD	103,400	42.190	4,362,446.000	
	SOUTH32 LTD	160,100	3.350	536,335.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	33,550	19.570	656,573.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	59,100	18.570	1,097,487.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	115,950	28.860	3,346,317.000	
	WESTPAC BANKING CORP	128,948	25.990	3,351,358.520	
	SANTOS LTD	62,900	6.140	386,206.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	1.965	127,725.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	100,850	28.110	2,834,893.500	
	RIO TINTO LTD	13,000	110.690	1,438,970.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	59,000	4.440	261,960.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	3.780	226,800.000	
	XERO LTD	4,750	152.750	725,562.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	35.360	120,224.000	
	COLES GROUP LTD	46,845	17.750	831,498.750	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,400	49.260	266,004.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	37,000	9.940	367,780.000	
	EVOLUTION MINING LTD	59,500	4.050	240,975.000	
	AFTERPAY LTD	7,600	132.880	1,009,888.000	
	REECE LTD	10,500	20.240	212,520.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	47,300	6.770	320,221.000	
	OIL SEARCH LTD	64,200	3.740	240,108.000	
	SEEK LTD	11,700	32.890	384,813.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	25,600	12.350	316,160.000	

	NEWCREST MINING LTD	28,500	25.200	718,200.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	62,350	102.160	6,369,676.000	
	AMPOL LTD	7,950	27.610	219,499.500	
	ORICA LTD	13,100	13.420	175,802.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	51,950	11.840	615,088.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	44,100	40.730	1,796,193.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	78,263	4.960	388,184.480	
	CROWN RESORTS LTD	13,400	9.650	129,310.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	5.390	164,395.000	
	TELSTRA CORP LTD	143,500	3.900	559,650.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	15,650	54.040	845,726.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	11,984	170.100	2,038,478.400	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	20,150	46.660	940,199.000	
	CSL LTD	16,000	305.800	4,892,800.000	
	WESFARMERS LTD	40,300	57.840	2,330,952.000	
	COCHLEAR LTD	2,320	238.890	554,224.800	
	BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	23.820	423,996.000	
	SUNCORP GROUP LTD	43,657	12.830	560,119.310	
	ASX LTD	6,700	85.380	572,046.000	
	COMPUTERSHARE LTD	18,200	16.730	304,486.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	86,136	5.450	469,441.200	
	SONIC HEALTHCARE LTD	15,950	43.550	694,622.500	
	AGL ENERGY LTD	21,500	6.440	138,460.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	12.280	618,912.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,150	70.310	432,406.500	
	REA GROUP LTD	1,800	156.330	281,394.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,400	43.590	191,796.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	157.950	347,490.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 51,785,573.460 (4,236,059,909)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	9,100	34.320	312,312.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	2,192.520	1,534,764.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,687	80.540	780,190.980	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,100	58.360	939,596.000	

INTACT FINANCIAL CORP	6,450	173.040	1,116,108.000	
BCE INC	4,930	65.730	324,048.900	
FRANCO-NEVADA CORP	6,900	185.270	1,278,363.000	
SUNCOR ENERGY INC	54,230	23.470	1,272,778.100	
METRO INC/CN	8,600	64.430	554,098.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	12,000	98.180	1,178,160.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	43,500	78.120	3,398,220.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,950	145.570	2,321,841.500	
TORONTO-DOMINION BANK	65,200	82.450	5,375,740.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,800	38.700	379,260.000	
ROYAL BANK OF CANADA	51,050	129.480	6,609,954.000	
TC ENERGY CORP	35,250	60.570	2,135,092.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	19,729	38.960	768,641.840	
BARRICK GOLD CORP	63,300	25.430	1,609,719.000	
CAE INC	10,900	38.060	414,854.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,212	148.810	924,407.720	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,900	40.190	237,121.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	100.600	352,100.000	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	7,800	20.540	160,212.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,450	72.270	393,871.500	
HYDRO ONE LTD	11,300	31.820	359,566.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	89.810	535,267.600	
NORTHLAND POWER INC	7,900	42.550	336,145.000	
WSP GLOBAL INC	4,300	163.910	704,813.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	107.060	299,768.000	
PARKLAND CORP	5,100	37.300	190,230.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	31.790	190,740.000	
EMERA INC	9,000	59.180	532,620.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	35.620	170,976.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,700	63.490	806,323.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	10.030	225,675.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,700	73.720	641,364.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	21,500	19.610	421,615.000	
B2GOLD CORP	34,700	5.000	173,500.000	
AIR CANADA	6,500	24.020	156,130.000	
KINROSS GOLD CORP	43,200	7.750	334,800.000	
BANK OF MONTREAL	23,100	127.730	2,950,563.000	
POWER CORP OF CANADA	20,100	43.030	864,903.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,100	1,946.480	7,980,568.000	

NUTRIEN LTD	20,319	76.600	1,556,435.400	
CANOPY GROWTH CORP	8,400	21.250	178,500.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,600	52.770	506,592.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,700	55.480	260,756.000	
CAMECO CORP	14,000	27.040	378,560.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,400	236.210	330,694.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	45.270	294,255.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	3,900	150.190	585,741.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,900	153.560	291,764.000	
TELUS CORP	10,800	29.180	315,144.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,000	30.780	523,260.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	191.760	421,872.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,000	43.820	1,840,440.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	567.020	567,020.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,200	100.680	1,026,936.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,737	136.270	372,970.990	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	33.320	233,240.000	
BLACKBERRY LTD	19,400	13.880	269,272.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	20,850	64.690	1,348,786.500	
ENBRIDGE INC	72,700	50.120	3,643,724.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	46,125	71.210	3,284,561.250	
MANULIFE FINANCIAL CORP	69,100	24.420	1,687,422.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	36.730	385,665.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,000	90.590	2,174,160.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,700	70.450	260,665.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,000	50.050	350,350.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,550	159.010	4,062,705.500	
CGI INC - CLASS A	7,900	115.440	911,976.000	
ONEX CORPORATION	2,600	88.410	229,866.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,000	37.250	596,000.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	47.040	145,824.000	
TMX GROUP LTD	1,900	139.780	265,582.000	
OPEN TEXT CORP	9,900	68.660	679,734.000	
SAPUTO INC	8,700	35.210	306,327.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,400	25.670	523,668.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	30,200	50.420	1,522,684.000	

	YAMANA GOLD INC	32,300	5.530	178,619.000	
	FORTIS INC	16,600	57.790	959,314.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	78.820	299,516.000	
	LUNDIN MINING CORP	22,100	10.210	225,641.000	
	CENOVUS ENERGY INC	46,700	10.980	512,766.000	
	DOLLARAMA INC	10,700	56.860	608,402.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,900	42.260	122,554.000	
	ALTAGAS LTD	10,300	25.510	262,753.000	
	KEYERA CORP	7,400	30.410	225,034.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 87,974,772.280 (7,710,109,042)	
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	45,200	25.820	1,167,064.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	69,900	30.390	2,124,261.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	48,475	5.080	246,253.000	
	KEPPEL CORP LTD	56,300	5.240	295,012.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	7.120	121,752.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	6.860	110,446.000	
	CAPITALAND LTD	102,400	4.090	418,816.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	129,300	11.700	1,512,810.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.785	164,065.000	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.960	187,704.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	320,150	2.380	761,957.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	56,500	3.820	215,830.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	31,500	10.270	323,505.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,400	4.200	312,480.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 7,961,955.000 (651,686,017)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	130,600	15.420	2,013,852.000	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,100	408.600	449,460.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	991.000	277,480.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,150	51.380	264,607.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	25,000	367.600	9,190,000.000	

SIKA AG-REG	5,100	332.900	1,697,790.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	110,000.000	440,000.000	
ABB LTD-REG	62,700	34.520	2,164,404.000	
SWISS RE AG	10,700	82.880	886,816.000	
NESTLE SA-REG	102,700	115.760	11,888,552.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	800	1,637.000	1,309,600.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,500	296.300	444,450.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	90,920	9.770	888,288.400	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,000	63.220	505,760.000	
SGS SA-REG	210	2,891.000	607,110.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	283.200	195,408.000	
VIFOR PHARMA AG	1,750	134.300	235,025.000	
TEMENOS AG - REG	2,300	140.950	324,185.000	
ALCON INC	17,800	78.400	1,395,520.000	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	260.900	253,073.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,342	404.200	2,159,236.400	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,700	147.400	250,580.000	
CLARIANT AG-REG	7,700	19.580	150,766.000	
NOVARTIS AG-REG	79,100	83.630	6,615,133.000	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	120	2,324.000	278,880.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	18,600	103.000	1,915,800.000	
SWISSCOM AG-REG	900	537.400	483,660.000	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	1,010	77.200	77,972.000	
GEBERIT AG-REG	1,300	767.800	998,140.000	
GIVAUDAN-REG	330	4,613.000	1,522,290.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	360	1,802.500	648,900.000	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,992	364.600	726,283.200	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,200	94.680	587,016.000	
LONZA GROUP AG-REG	2,690	784.600	2,110,574.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	50.800	96,520.000	
HOLCIM LTD	18,540	49.980	926,629.200	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,110	482.600	535,686.000	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,920	342.500	657,600.000	
SWISS PRIME SITE-REG	2,700	97.350	262,845.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	10,800.000	367,200.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 56,803,091.200	

				(6,822,051,253)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	3,870	427.100	1,652,877.000	
	ERICSSON LM-B SHS	112,830	102.820	11,601,180.600	
	VOLVO AB-B SHS	55,650	193.300	10,757,145.000	
	SKF AB-B SHARES	14,400	219.400	3,159,360.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	220.500	1,896,300.000	
	SWEDISH MATCH AB	61,300	81.400	4,989,820.000	
	TELE2 AB-B SHS	18,800	132.600	2,492,880.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	62,000	120.700	7,483,400.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	54,850	100.300	5,501,455.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,100	171.400	5,844,740.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	176.760	4,984,632.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	22,900	154.950	3,548,355.000	
	SKANSKA AB-B SHS	12,850	249.700	3,208,645.000	
	SANDVIK AB	43,100	224.800	9,688,880.000	
	INVESTOR AB-B SHS	70,000	208.300	14,581,000.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,450	600.600	15,285,270.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	197.500	1,580,000.000	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	144.100	1,721,995.000	
	TELIA CO AB	100,200	37.255	3,732,951.000	
	ALFA LAVAL AB	11,900	349.300	4,156,670.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,900	504.000	7,509,600.000	
	ASSA ABLOY AB-B	38,750	277.400	10,749,250.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,900	316.800	1,235,520.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,000	603.600	2,414,400.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	553.600	1,660,800.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	305.900	1,743,630.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	54,300	125.400	6,809,220.000	
	LUNDIN ENERGY AB	7,550	267.500	2,019,625.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,000	277.900	6,391,700.000	
	EMBRACER GROUP AB	10,000	204.200	2,042,000.000	
	BOLIDEN AB	10,400	304.200	3,163,680.000	
	EPIROC AB-A	24,950	194.750	4,859,012.500	
	EPIROC AB-B	14,800	168.000	2,486,400.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,850	117.150	1,856,827.500	
	NORDEA BANK ABP	125,000	107.120	13,390,000.000	

	EQT AB	9,100	402.500	3,662,750.000	
	EVOLUTION AB	6,550	1,478.000	9,680,900.000	
	SINCH AB	19,400	201.700	3,912,980.000	
	KINNEVIK AB - B	9,300	353.000	3,282,900.000	
	HEXAGON AB-B SHS	76,400	151.450	11,570,780.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	300.900	1,865,580.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 220,175,110.600 (2,827,048,421)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,800	637.000	41,277,600.000	
	DANSKE BANK A/S	26,000	107.550	2,796,300.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	120	18,100.000	2,172,000.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,650	263.900	10,199,735.000	
	GN STORE NORD A/S	4,850	493.700	2,394,445.000	
	CARLSBERG AS-B	3,900	1,096.000	4,274,400.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,850	498.100	3,910,085.000	
	COLOPLAST-B	4,500	1,117.000	5,026,500.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,910	1,660.000	13,130,600.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	3,303.000	990,900.000	
	DEMANT A/S	3,875	364.100	1,410,887.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	19,220.000	4,420,600.000	
	TRYG A/S	13,200	154.600	2,040,720.000	
	PANDORA A/S	3,800	785.200	2,983,760.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,050	561.000	2,272,050.000	
	GENMAB A/S	2,520	3,100.000	7,812,000.000	
	ORSTED A/S	7,050	981.400	6,918,870.000	
	AMBU A/S-B	6,300	204.000	1,285,200.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 115,316,652.500 (2,022,654,085)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	47,500	5.120	243,200.000	
	MERCURY NZ LTD	26,000	6.660	173,160.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	5.930	155,366.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	72,789	4.890	355,938.210	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	48,300	7.320	353,556.000	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,200	33.750	783,000.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	16,500	15.800	260,700.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,324,920.210 (182,482,987)	
ノルウェー・ク ローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB BANK	36,750	192.100	7,059,675.000	
	NORSK HYDRO ASA	50,700	64.300	3,260,010.000	
	ORKLA ASA	29,050	78.560	2,282,168.000	
	TELENOR ASA	27,800	153.950	4,279,810.000	
	EQUINOR ASA	38,223	199.720	7,633,897.560	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	465.900	1,304,520.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	442.000	2,943,720.000	
	MOWI ASA	16,600	234.400	3,891,040.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	205.900	1,513,365.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,650	410.800	1,499,420.000	
	ADEVINTA ASA	10,600	171.850	1,821,610.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 37,489,235.560 (475,738,399)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	35,220	47.745	1,681,578.900	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,000	28.370	198,590.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	73,900	10.762	795,311.800	
	COMMERZBANK AG	32,935	5.552	182,855.120	
	VOLKSWAGEN AG	1,110	288.400	320,124.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,550	202.150	1,324,082.500	
	SIEMENS AG-REG	27,350	146.800	4,014,980.000	
	E.ON SE	79,300	11.098	880,071.400	
	UNIPER SE	6,650	34.680	230,622.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,750	79.850	938,237.500	
	GEA GROUP AG	5,050	40.700	205,535.000	
	CONTINENTAL AG	3,960	109.600	434,016.000	
	BASF SE	32,870	65.300	2,146,411.000	
	ALLIANZ SE-REG	14,740	198.440	2,925,005.600	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,400	81.740	523,136.000	
	RWE AG	22,700	33.170	752,959.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	8.210	79,226.500	

BRENNTAG SE	5,350	86.180	461,063.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,800	43.765	647,722.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	36.810	122,209.200	
SAP SE	37,392	127.660	4,773,462.720	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,040	241.900	1,219,176.000	
ZALANDO SE	7,650	95.740	732,411.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,350	71.840	384,344.000	
KION GROUP AG	2,400	90.460	217,104.000	
COVESTRO AG	6,700	57.960	388,332.000	
RATIONAL AG	190	937.400	178,106.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	583.800	706,398.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,300	87.040	461,312.000	
DELIVERY HERO SE	5,800	131.850	764,730.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,400	194.950	272,930.000	
BECHTLE AG	2,850	63.820	181,887.000	
NEMETSCHKE SE	2,000	85.800	171,600.000	
SCOUT24 AG	3,600	72.000	259,200.000	
AROUNDTOWN SA	32,500	6.304	204,880.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,100	58.780	593,678.000	
KNORR-BREMSE AG	2,500	101.500	253,750.000	
HELLOFRESH SE	5,700	92.560	527,592.000	
TEAMVIEWER AG	5,350	29.170	156,059.500	
SIEMENS ENERGY AG	14,325	25.010	358,268.250	
BEIERSDORF AG	3,610	103.100	372,191.000	
FUCHS PETROLUB PREF	2,350	43.960	103,306.000	
MERCK KGAA	4,600	206.000	947,600.000	
ADIDAS AG	6,810	300.000	2,043,000.000	
PUMA SE	3,860	103.700	400,282.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,750	75.700	283,875.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	119,200	17.904	2,134,156.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,220	65.580	473,487.600	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	30,650	70.090	2,148,258.500	
QIAGEN N.V.	7,698	47.250	363,730.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	46,700	37.245	1,739,341.500	
HANNOVER RUECK SE	2,200	155.800	342,760.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	35,450	59.600	2,112,820.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,710	145.700	977,647.000	

LANXESS AG	2,800	64.660	181,048.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,790	194.500	348,155.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	12,050	52.380	631,179.000	
SYMRISE AG	4,400	118.850	522,940.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.423	81,897.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,950	68.150	132,892.500	
VONOVIA SE	19,500	54.240	1,057,680.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,550	128.550	327,802.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32,260	40.785	1,315,724.100	
NN GROUP NV	9,900	44.220	437,778.000	
ARCELORMITTAL	25,700	28.495	732,321.500	
HEINEKEN NV	9,200	92.040	846,768.000	
AEGON NV	64,244	4.176	268,282.940	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37,383	28.360	1,060,181.880	
AKZO NOBEL N.V.	6,768	102.400	693,043.200	
KONINKLIJKE DSM NV	6,200	179.200	1,111,040.000	
WOLTERS KLUWER	9,600	97.700	937,920.000	
ING GROEP NV	139,600	11.786	1,645,325.600	
KONINKLIJKE KPN NV	121,150	2.612	316,443.800	
ASML HOLDING NV	15,010	740.900	11,120,909.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,150	11.834	179,285.100	
ADYEN NV	700	2,705.000	1,893,500.000	
JUST EAT TAKEAWAY	6,450	82.120	529,674.000	
PROSUS NV	33,380	78.910	2,634,015.800	
JDE PEET'S NV	2,600	29.190	75,894.000	
INPOST SA	7,000	15.392	107,744.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,700	342.200	581,740.000	
VOPAK	2,300	35.890	82,547.000	
RANDSTAD NV	4,300	62.260	267,718.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,950	77.500	306,125.000	
TOTALENERGIES SE	89,350	37.665	3,365,367.750	
MICHELIN (CGDE)	6,050	137.550	832,177.500	
AIR LIQUIDE SA	16,977	151.820	2,577,448.140	
KERING	2,700	694.300	1,874,610.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19,350	154.620	2,991,897.000	
BOUYGUES SA	8,200	35.860	294,052.000	

BNP PARIBAS	40,300	54.120	2,181,036.000	
THALES SA	3,850	86.000	331,100.000	
DANONE	23,400	61.760	1,445,184.000	
CARREFOUR SA	21,200	15.820	335,384.000	
SUEZ	12,625	19.615	247,639.370	
VIVENDI	27,891	33.410	931,838.310	
L'OREAL	9,040	396.350	3,583,004.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	17,900	61.200	1,095,480.000	
LEGRAND SA	9,467	97.400	922,085.800	
PERNOD RICARD SA	7,487	185.850	1,391,458.950	
EURAZEO SE	1,254	87.100	109,223.400	
SOCIETE GENERALE SA	29,000	26.670	773,430.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,910	648.700	6,428,617.000	
ACCOR SA	6,150	28.300	174,045.000	
CAPGEMINI SE	5,720	192.300	1,099,956.000	
VALEO SA	7,700	22.900	176,330.000	
PUBLICIS GROUPE	8,000	56.660	453,280.000	
BUREAU VERITAS SA	10,600	28.430	301,358.000	
EIFFAGE	3,040	89.640	272,505.600	
SODEXO SA	2,950	69.600	205,320.000	
IPSEN	1,150	82.980	95,427.000	
ORPEA	1,800	106.200	191,160.000	
AMUNDI SA	2,250	79.900	179,775.000	
TELEPERFORMANCE	2,100	380.900	799,890.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	55.680	167,040.000	
FAURECIA	3,857	39.350	151,772.950	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,750	124.080	589,380.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	542.400	542,400.000	
SEB SA	997	139.100	138,682.700	
ESSILORLUXOTTICA	10,150	169.100	1,716,365.000	
DASSAULT AVIATION SA	100	950.000	95,000.000	
WORLDLINE SA	8,514	72.980	621,351.720	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,500	44.370	155,295.000	
AXA SA	69,400	23.765	1,649,291.000	
EDENRED	8,850	47.070	416,569.500	
RENAULT SA	6,400	30.155	192,992.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,130	1,277.500	1,443,575.000	
STMICROELECTRONICS NV	24,400	38.195	931,958.000	

REMY COINTREAU	750	169.500	127,125.000	
ATOS SE	3,200	44.800	143,360.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	23,450	49.115	1,151,746.750	
WENDEL	930	123.200	114,576.000	
ORANGE	71,400	9.535	680,799.000	
ALSTOM	11,400	34.110	388,854.000	
CNP ASSURANCES	5,850	14.540	85,059.000	
SANOFI	40,725	87.800	3,575,655.000	
VINCI SA	18,850	90.980	1,714,973.000	
AIRBUS SE	21,100	115.880	2,445,068.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,700	29.310	577,407.000	
CREDIT AGRICOLE SA	41,600	12.218	508,268.800	
BIOMERIEUX	1,340	111.200	149,008.000	
ENGIE	64,623	12.056	779,094.880	
EDF	20,250	10.920	221,130.000	
SAFRAN SA	12,200	104.220	1,271,484.000	
ILIAD SA	490	182.000	89,180.000	
ARKEMA	2,220	114.300	253,746.000	
ADP	910	98.160	89,325.600	
SCOR SE	5,550	26.090	144,799.500	
GETLINK SE	14,200	13.750	195,250.000	
BOLLORE	28,600	5.145	147,147.000	
UCB SA	4,530	98.320	445,389.600	
KBC GROUP NV	8,900	72.100	641,690.000	
COLRUYT SA	1,600	47.830	76,528.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	97.460	389,840.000	
SOLVAY SA	2,600	111.550	290,030.000	
UMICORE	7,000	55.020	385,140.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	27,200	50.250	1,366,800.000	
AGEAS	6,290	42.750	268,897.500	
PROXIMUS	4,950	16.730	82,813.500	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	105.800	111,090.000	
SOFINA	600	373.000	223,800.000	
ARGENX SE	1,640	296.900	486,916.000	
PRYSMIAN SPA	8,850	32.970	291,784.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	39,443	17.535	691,633.000	
MEDIOBANCA SPA	22,365	10.030	224,320.950	
TENARIS SA	15,700	8.476	133,073.200	
UNICREDIT SPA	76,356	10.988	838,999.720	

TELECOM ITALIA SPA	343,982	0.373	128,305.280	
TELECOM ITALIA-RSP	203,950	0.396	80,804.990	
INTESA SANPAOLO	594,537	2.403	1,428,672.410	
ATLANTIA SPA	17,257	15.935	274,990.290	
POSTE ITALIANE SPA	17,700	11.635	205,939.500	
MONCLER SPA	7,400	54.940	406,556.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,850	55.920	215,292.000	
ENI SPA	90,400	10.586	956,974.400	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	11.915	232,342.500	
DIASORIN SPA	850	204.300	173,655.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,200	10.010	112,112.000	
NEXI SPA	15,850	18.065	286,330.250	
AMPLIFON SPA	4,300	44.650	191,995.000	
ENEL SPA	291,134	7.715	2,246,098.810	
SNAM SPA	70,100	4.937	346,083.700	
TERNA SPA	49,000	6.682	327,418.000	
EXOR NV	3,780	70.420	266,187.600	
CNH INDUSTRIAL NV	36,600	14.295	523,197.000	
FINECOBANK SPA	21,900	15.425	337,807.500	
STELLANTIS NV	73,200	17.242	1,262,114.400	
FERRARI NV	4,495	186.450	838,092.750	
TELEFONICA SA	186,727	4.150	774,917.050	
ENDESA SA	10,350	20.740	214,659.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	236,700	5.564	1,316,998.800	
IBERDROLA SA	211,934	10.415	2,207,292.610	
REPSOL SA	53,400	9.601	512,693.400	
GRIFOLS SA	9,800	21.070	206,486.000	
BANCO SANTANDER SA	619,950	3.110	1,928,044.500	
AMADEUS IT GROUP SA	16,050	51.940	833,637.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	21.640	222,892.000	
CAIXABANK SA	160,500	2.645	424,522.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	23.280	206,633.280	
AENA SME SA	2,600	133.700	347,620.000	
CELLNEX TELECOM SA	18,005	58.500	1,053,292.500	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	39,000	29.750	1,160,250.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,500	25.390	215,815.000	

	ENAGAS SA	7,950	19.075	151,646.250	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	17.165	269,490.500	
	FERROVIAL SA	17,670	24.790	438,039.300	
	UPM-KYMMENE OYJ	19,150	35.050	671,207.500	
	NOKIA OYJ	191,300	5.109	977,351.700	
	WARTSILA OYJ ABP	17,000	12.055	204,935.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,700	17.135	337,559.500	
	ELISA OYJ	5,100	54.600	278,460.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	17,800	43.950	782,310.000	
	FORTUM OYJ	15,900	26.510	421,509.000	
	KESKO OYJ-B SHS	9,800	34.400	337,120.000	
	KONE OYJ-B	12,100	69.920	846,032.000	
	NESTE OYJ	15,100	53.720	811,172.000	
	ORION OYJ-CLASS B	3,600	35.310	127,116.000	
	VERBUND AG	2,430	94.600	229,878.000	
	OMV AG	5,300	47.550	252,015.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	10,000	34.830	348,300.000	
	VOESTALPINE AG	4,250	37.760	160,480.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	5,250	20.940	109,935.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,600	49.610	426,646.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,400	94.500	510,300.000	
	JERONIMO MARTINS	8,500	18.215	154,827.500	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	99,200	4.788	474,969.600	
	GALP ENERGIA SGPS SA	16,750	8.518	142,676.500	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,000	22.940	252,340.000	
	KERRY GROUP PLC-A	5,600	125.300	701,680.000	
	CRH PLC	28,100	44.450	1,249,045.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,030	169.850	1,024,195.500	
	ユーロ 小計			ユーロ 177,970,503.270 (23,210,913,036)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,500	47.500	2,493,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	50.850	4,220,550.000	
	MTR CORP	58,500	43.750	2,559,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,000	108.800	5,548,800.000	
	SINO LAND CO	126,000	11.380	1,433,880.000	

CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	104,669	56.050	5,866,697.450	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	52.400	969,400.000	
CLP HOLDINGS LTD	62,000	76.900	4,767,800.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	55,507	34.600	1,920,542.200	
HONG KONG & CHINA GAS	422,475	12.480	5,272,488.000	
HANG SENG BANK LTD	28,800	140.100	4,034,880.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	58,500	36.300	2,123,550.000	
WH GROUP LTD	361,000	6.140	2,216,540.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,100	498.000	22,957,800.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	18.540	1,446,120.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	69,000	31.000	2,139,000.000	
SJM HOLDINGS LTD	71,000	6.980	495,580.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	20.700	931,500.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	48.400	4,412,579.600	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	23,500	45.350	1,065,725.000	
AIA GROUP LTD	461,400	94.800	43,740,720.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	31.100	1,679,400.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,000	39.450	2,485,350.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	19.920	1,352,568.000	
ESR CAYMAN LTD	75,000	23.850	1,788,750.000	
SANDS CHINA LTD	92,800	25.700	2,384,960.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	16.040	1,315,280.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	53,000	174.400	9,243,200.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	141,500	23.500	3,325,250.000	
WYNN MACAU LTD	54,000	9.110	491,940.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 144,683,975.250 (2,042,937,730)	
合計			221,009,477,811 [221,009,477,811]	

## (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	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,087	アメリカ・ドル 1,184,507.950	

SIMON PROPERTY GROUP INC	11,857	1,609,587.750	
BOSTON PROPERTIES INC	5,470	622,923.600	
VORNADO REALTY TRUST	5,897	246,848.420	
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,040	1,480,579.200	
EQUITY RESIDENTIAL	13,050	1,116,949.500	
EQUINIX INC	3,288	2,902,745.040	
AMERICAN TOWER CORP	16,450	4,968,064.500	
HOST HOTELS & RESORTS INC	24,943	403,328.310	
INVITATION HOMES INC	20,850	874,657.500	
VICI PROPERTIES INC	19,800	634,194.000	
VENTAS INC	13,800	777,078.000	
WEYERHAEUSER CO	27,564	1,009,944.960	
AGNC INVESTMENT CORP	19,600	317,128.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	15,750	3,126,375.000	
IRON MOUNTAIN INC	10,260	506,638.800	
VEREIT INC	8,150	412,634.500	
SUN COMMUNITIES INC	4,100	857,433.000	
PROLOGIS INC	26,952	3,746,058.480	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,100	1,062,942.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,450	529,368.000	
DUKE REALTY CORP	13,800	739,956.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,400	805,392.000	
WELLTOWER INC	15,300	1,327,275.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19,800	719,730.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	833,595.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,150	541,999.500	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	50,800	438,912.000	
REALTY INCOME CORP	13,700	990,510.000	
PUBLIC STORAGE	5,670	1,875,409.200	
REGENCY CENTERS CORP	5,700	395,238.000	
UDR INC	10,550	584,153.500	
WP CAREY INC	6,400	507,584.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,300	280,706.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,300	1,726,280.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,900	949,179.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21,650	468,722.500	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 41,574,628.210 (4,564,062,685)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	23,562	172,473.840	
	SEGRO PLC	43,100	554,481.500	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	158,683.500	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 885,638.840 (134,625,960)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	36,150	384,997.500	
	LENDLEASE GROUP	23,500	267,665.000	
	TRANSURBAN GROUP	95,400	1,369,944.000	
	SYDNEY AIRPORT	45,800	362,736.000	
	APA GROUP	41,400	382,950.000	
	SCENTRE GROUP	181,922	531,212.240	
	GPT GROUP	68,160	340,118.400	
	MIRVAC GROUP	136,100	420,549.000	
	STOCKLAND	83,800	387,156.000	
	GOODMAN GROUP	58,200	1,357,224.000	
	VICINITY CENTRES	137,273	245,032.300	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 6,049,584.440 (494,856,007)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,900	180,235.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	130,848.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 311,083.000 (27,263,314)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	124,500	387,195.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	175,032	365,816.880	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	114,300	241,173.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77,500	161,200.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,155,384.880 (94,568,252)	
ユーロ			ユーロ	

	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	322,598.000	
	GECINA SA	1,600	204,720.000	
	KLEPIERRE	7,150	147,218.500	
	COVIVIO	1,750	134,155.000	
ユーロ 小計			ユーロ 808,691.500 (105,469,546)	
香港・ドル	LINK REIT	81,500	5,782,425.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	710,240.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138,000	1,471,080.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 7,963,745.000 (112,448,080)	
投資証券 合計			5,533,293,844 [5,533,293,844]	
合計			5,533,293,844 [5,533,293,844]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 598銘柄	97.2%	2.8%	73.0%
	投資証券 37銘柄			
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	98.7%	1.3%	4.4%
	投資証券 3銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄	89.5%	10.5%	2.1%
	投資証券 11銘柄			
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.6%	0.4%	3.4%
	投資証券 2銘柄			
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	87.3%	12.7%	0.3%
	投資証券 4銘柄			
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	3.0%
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	100%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100%	-%	0.9%

ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	231銘柄	99.5%	0.5%	10.3%
	投資証券	4銘柄			
香港・ドル	株式	30銘柄	94.8%	5.2%	1.0%
	投資証券	3銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ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

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	92,213,639	405,543,839
金銭信託	32,279,180	-
コール・ローン	188,729,807	106,816,729
株式	9,155,472,087	14,034,335,290
投資証券	375,678,602	923,364,411
派生商品評価勘定	359,289	452,366
未収入金	365,610	339,197
未収配当金	18,693,171	22,968,247
差入委託証拠金	61,686,016	229,479,606
流動資産合計	9,925,477,401	15,723,299,685
資産合計	9,925,477,401	15,723,299,685
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,893,840	21,179,107
未払金	51,805	-
未払解約金	2,431,968	22,665,493
その他未払費用	144,685	117,723

流動負債合計		6,522,298	43,962,323
負債合計		6,522,298	43,962,323
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,158,803,351	8,253,886,066
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,760,151,752	7,425,451,296
元本等合計		9,918,955,103	15,679,337,362
純資産合計		9,918,955,103	15,679,337,362
負債純資産合計		9,925,477,401	15,723,299,685

## 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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	5,076,199,923円	7,158,803,351円
期中追加設定元本額	2,509,494,287円	2,620,236,717円
期中一部解約元本額	426,890,859円	1,525,154,002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）	21,826,760円	34,644,316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）	274,516,559円	271,787,874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）	308,729,983円	265,300,187円
D - I ' s 新興国株式インデックス	125,778,044円	126,209,823円
i F r e e 新興国株式インデックス	2,590,686,978円	3,578,372,062円
i F r e e 8 資産バランス	1,979,363,769円	2,270,739,389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）	288,114,239円	54,696,935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	1,082,447,903円	1,177,816,189円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	395,548,435円	378,607,518円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	91,790,681円	95,711,773円
計	7,158,803,351円	8,253,886,066円
2. 期末日における受益権の総数	7,158,803,351口	8,253,886,066口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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	2021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	2020年9月7日現在	2021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	35,338,865	4,682,407
投資証券	5,006,821	26,914,179
合計	30,332,044	31,596,586

## (注)

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年7月7日から2020年9月7日まで、及び2021年7月6日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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								
株価指数								
先物取引								
買 建	382,635,418	-	378,888,887	3,746,531	728,741,047	-	708,174,313	20,566,734

合計	382,635,418	-	378,888,887	3,746,531	728,741,047	-	708,174,313	20,566,734

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2020年9月7日 現在				2021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	-	-	-	-	500,619	-	500,547	72
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	500,619	-	500,547	72
買 建	209,247,420	-	209,459,400	211,980	80,777,040	-	80,616,961	160,079
アメリカ・ドル	209,247,420	-	209,459,400	211,980	80,777,040	-	80,616,961	160,079
合計	209,247,420	-	209,459,400	211,980	81,277,659	-	81,117,508	160,007

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2020年9月7日現在	2021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)	1,3856円 (13,856円)	1,8996円 (18,996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	
	JOYY INC-ADR	1,000	64.600	64,600.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	5,200	2.360	12,272.000	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	29,000	5.300	153,700.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,800	162.980	456,344.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	5,600	15.400	86,240.000	
	CANADIAN SOLAR INC	2,300	37.120	85,376.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,400	30.840	104,856.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	35,350	9.330	329,815.500	
	JD.COM INC-ADR	7,800	79.855	622,869.000	
	NETEASE INC-ADR	3,000	92.990	278,970.000	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	9,300	31.420	292,206.000	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	191,217	1.432	273,822.740	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	32.300	235,467.000		

TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	9,608	39.780	382,206.240	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	36,075	4.628	166,955.100	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	16,993	33.750	573,513.750	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,694	14.925	308,857.950	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	156,977	18.000	2,825,586.000	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,498	254.400	635,491.200	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	20,288	86.480	1,754,506.240	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	91,299	7.494	684,194.700	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	392,339	8.872	3,480,831.600	
SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	22.820	307,157.200	
TATNEFT PJSC - PREF	15,509	6.263	97,147.240	
SISTEMA PJSFC	319,200	0.427	136,488.000	
INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.066	180,884.910	
ALROSA PJSC	180,310	2.015	363,387.750	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	2.559	144,892.380	
AEROFLOT PJSC	164,910	0.946	156,149.810	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 15,194,788.310 (1,668,083,861)	
インド・ルピー	株	インド・ルピー	インド・ルピー	
RELIANCE INDUSTRIES-PARTLY P	2,519	1,783.200	4,491,880.800	
TATA STEEL LTD	34,872	1,437.000	50,111,064.000	
AXIS BANK LTD	43,190	800.800	34,586,552.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,950	6,846.900	13,351,455.000	
TATA POWER CO LTD	79,437	132.200	10,501,571.400	
BANK OF BARODA	73,629	78.900	5,809,328.100	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	5,223	2,780.600	14,523,073.800	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	66,496	269.950	17,950,595.200	
STATE BANK OF INDIA	78,270	431.050	33,738,283.500	
NTPC LTD	240,522	116.450	28,008,786.900	
JSW STEEL LTD	31,764	686.650	21,810,750.600	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	86,798	174.100	15,111,531.800	
INDIAN OIL CORP LTD	230,471	111.600	25,720,563.600	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	68,605	490.800	33,671,334.000	

JINDAL STEEL & POWER LTD	22,088	390.300	8,620,946.400	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,097	7,952.600	8,724,002.200	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,346	1,346.450	7,198,121.700	
TECH MAHINDRA LTD	9,274	1,461.150	13,550,705.100	
YES BANK LTD	17,640	11.000	194,040.000	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	28,202	139.650	3,938,409.300	
REC LTD	53,060	152.750	8,104,915.000	
COAL INDIA LTD	144,050	146.350	21,081,717.500	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	62,266	231.100	14,389,672.600	
GAIL INDIA LTD	69,194	146.900	10,164,598.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	64,018	469.250	30,040,446.500	
GRASIM INDUSTRIES LTD	13,620	1,531.000	20,852,220.000	
WIPRO LTD	16,049	686.450	11,016,836.050	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,898	3,852.000	41,979,096.000	
INFOSYS LTD	48,724	1,730.400	84,312,009.600	
LARSEN & TOUBRO LTD	13,549	1,694.200	22,954,715.800	
TATA MOTORS LTD	110,373	297.450	32,830,448.850	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	21,890	2,765.300	60,532,417.000	
ICICI BANK LTD	22,299	721.150	16,080,923.850	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	52,681	2,425.600	127,783,033.600	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	238,025	121.650	28,955,741.250	
ITC LTD	80,434	209.300	16,834,836.200	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	23,485	754.750	17,725,303.750	
HERO MOTOCORP LTD	2,967	2,817.200	8,358,632.400	
BHARTI AIRTEL LTD	29,016	654.600	18,993,873.600	
UPL LTD	13,776	755.750	10,411,212.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14,760	784.250	11,575,530.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	16,274	1,200.150	19,531,241.100	
VEDANTA LTD	132,916	315.150	41,888,477.400	
インド・ルピー 小計			インド・ルピー 1,028,010,894.050 (1,552,296,450)	
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	493,300	5,425.000	2,676,152,500.000	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	101,300	7,825.000	792,672,500.000	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,806,100	3,390.000	6,122,679,000.000	

	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	425,000	5,450.000	2,316,250,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	119,400	32,875.000	3,925,275,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	547,400	6,200.000	3,393,880,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	857,000	1,095.000	938,415,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,345,200	3,850.000	5,179,020,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	1,289,500	1,365.000	1,760,167,500.000	
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 27,104,511,500.000 (208,704,738)	
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	73,700	19.360	1,426,832.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	149,500	4.470	668,265.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO- A	17,500	18.480	323,400.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO- A	24,900	51.580	1,284,342.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	379,600	4.730	1,795,508.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	9,300	19.900	185,070.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-A	9,400	31.050	291,870.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	2,900	62.130	180,177.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	300	1,670.670	501,201.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	8,000	45.700	365,600.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD- A	50,000	12.040	602,000.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK- A	173,300	9.210	1,596,093.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	14,800	26.820	396,936.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	38,800	51.200	1,986,560.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	46,400	18.450	856,080.000	
	GF SECURITIES CO LTD-A	13,400	21.720	291,048.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	394,000	5.150	2,029,100.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-A	10,100	28.800	290,880.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	63,000	19.950	1,256,850.000	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	33,700	4.130	139,181.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO- A	42,100	5.990	252,179.000	

CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	28,900	3.980	115,022.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	17,160	19.990	343,028.400	
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	90,300	5.070	457,821.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	70,400	7.960	560,384.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	6,800	25.950	176,460.000	
YANZHOU COAL MINING CO-A	8,100	26.200	212,220.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,600	6.000	183,600.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	804,600	3.010	2,421,846.000	
BANK OF CHINA LTD-A	258,100	3.060	789,786.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	208,900	4.360	910,804.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	331,500	4.510	1,495,065.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	39,800	20.770	826,646.000	
CHINA VANKE CO LTD -A	34,400	20.550	706,920.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	15,300	28.490	435,897.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	48,700	4.710	229,377.000	
CHINA MINSHENG BANKING-A	303,300	4.120	1,249,596.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	253,000	3.480	880,440.000	
CGN POWER CO LTD-A	18,900	2.830	53,487.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	15,400	18.050	277,970.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	22,900	13.510	309,379.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	6.290	1,163,650.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	91,500	10.240	936,960.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	5,200	43.010	223,652.000	
HUAXIA BANK CO LTD-A	117,400	5.700	669,180.000	
AIR CHINA LTD-A	20,700	7.540	156,078.000	
BYD CO LTD -A	700	277.600	194,320.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	7,100	19.610	139,231.000	
WEICHAI POWER CO LTD-A	9,800	19.900	195,020.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	13,000	10.950	142,350.000	
HUANENG POWER INTL INC-A	66,500	7.330	487,445.000	
オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元	

				33,662,806.400 (572,951,064)	
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	13,173	122.800	1,617,644.400	
	SAUDI TELECOM CO	5,452	136.000	741,472.000	
	AL RAJHI BANK	24,162	122.000	2,947,764.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	17,690	31.900	564,311.000	
	ALINMA BANK	32,925	23.740	781,639.500	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	11,842	61.800	731,835.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	28,037	35.100	984,098.700	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	28,525	19.020	542,545.500	
	SAUDI ELECTRICITY CO	36,617	27.700	1,014,290.900	
サウジアラビア・リアル 小計				サウジアラビア・リアル 9,925,601.600 (290,919,383)	
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	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	142,700	1.620	231,174.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 231,174.000 (18,921,591)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	BANPU NON-VOTING DR PCL	124,100	10.800	1,340,280.000	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,100	114.000	3,089,400.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	45,800	424.000	19,419,200.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	121.500	4,677,750.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	113,900	32.000	3,644,800.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,900	122.000	2,061,800.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	164,100	104.000	17,066,400.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,168,300	1.060	3,358,398.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	91,700	42.250	3,874,325.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	41,200	191.500	7,889,800.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	641,800	11.100	7,123,980.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	372,300	12.900	4,802,670.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	152,000	23.200	3,526,400.000	

	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	67,000	108.500	7,269,500.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,120,200	4.000	4,480,800.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	104,800	27.250	2,855,800.000	
	PTT PCL-NVDR	1,036,800	38.000	39,398,400.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	96,100	49.500	4,756,950.000	
	CP ALL PCL-NVDR	144,700	62.500	9,043,750.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	53,900	63.000	3,395,700.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	18,700	114.000	2,131,800.000	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	327,100	8.150	2,665,865.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	229,400	26.500	6,079,100.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	140,400	60.000	8,424,000.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 172,376,868.000 (582,633,814)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	CENCOSUD SA	46,115	1,446.000	66,682,290.000	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,898,696	39.840	115,484,048.640	
	ENEL AMERICAS SA	1,221,763	105.280	128,627,208.640	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,472	41,350.000	60,867,200.000	
	FALABELLA SA	21,593	3,015.000	65,102,895.000	
	BANCO DE CHILE	1,034,539	75.850	78,469,783.150	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 515,233,425.430 (73,184,271)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A	32,496	15.050	489,064.800	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	241,841	9.910	2,396,644.310	
	AKBANK T.A.S.	334,274	5.910	1,975,559.340	
	TURKIYE IS BANKASI-C	249,856	5.750	1,436,672.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	87,760	16.110	1,413,813.600	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	19,990	104.300	2,084,957.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	84,222	18.250	1,537,051.500	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	127,923	10.250	1,311,210.750	
	TURKIYE HALK BANKASI	110,822	4.800	531,945.600	

	YAPI VE KREDI BANKASI	237,787	2.680	637,269.160	
	KOC HOLDING AS	80,781	23.240	1,877,350.440	
	TURK HAVA YOLLARI AO	129,489	12.950	1,676,882.550	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,396	70.950	879,496.200	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 18,247,917.250 (241,863,370)	
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	16,400	6.080	99,712.000	
	ENERGISA SA-UNITS	10,600	44.240	468,944.000	
	RUMO SA	28,500	18.940	539,790.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	176,500	5.270	930,155.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	18,400	27.940	514,096.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	75,500	25.720	1,941,860.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	10,800	28.940	312,552.000	
	TIM SA	48,526	12.140	589,105.640	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	443,800	26.460	11,742,948.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	421,218	22.400	9,435,283.200	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	485,736	30.150	14,644,940.400	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	18,500	34.150	631,775.000	
	VALE SA	94,890	97.060	9,210,023.400	
	GERDAU SA-PREF	57,000	27.690	1,578,330.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	367,300	27.370	10,053,001.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER- PRF	107,487	13.490	1,449,999.630	
	ITAUSA SA	136,100	11.460	1,559,706.000	
	BRASKEM SA-PREF A	26,100	67.070	1,750,527.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	22,200	38.360	851,592.000	
	BANCO DO BRASIL S.A.	154,300	29.650	4,574,995.000	
	COSAN SA	64,400	22.350	1,439,340.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	37,200	37.800	1,406,160.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI- PFB	79,200	7.130	564,696.000	
	EMBRAER SA	71,200	21.550	1,534,360.000	

	METALURGICA GERDAU SA-PREF	94,900	12.530	1,189,097.000	
	CCR SA	88,600	11.980	1,061,428.000	
	BRF SA	57,100	23.980	1,369,258.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,000	35.600	925,600.000	
	LOJAS RENNER S.A.	19,705	37.120	731,449.600	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	14,784	6.200	91,660.800	
	JBS SA	96,500	32.100	3,097,650.000	
	SUZANO SA	12,245	61.480	752,822.600	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	37,900	21.890	829,631.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	90,600	14.320	1,297,392.000	
	CIELO SA	244,228	2.630	642,319.640	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	37,000	25.400	939,800.000	
	SUL AMERICA SA - UNITS	18,818	28.880	543,463.840	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	18,654	15.820	295,106.280	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	33,200	39.170	1,300,444.000	
	RAIA DROGASIL SA	23,500	26.160	614,760.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,900	42.430	1,565,667.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	73,200	14.970	1,095,804.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	51,600	28.090	1,449,444.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	4,693	5.940	27,876.420	
	COGNA EDUCACAO	264,300	3.060	808,758.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	126,765	19.380	2,456,705.700	
	AMBEV SA	187,200	17.190	3,217,968.000	
	ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 104,127,997.150 (2,210,856,049)	
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	
	MALAYAN BANKING BHD	58,300	8.330	485,639.000	
	GENTING BHD	87,800	5.090	446,902.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	261,700	4.090	1,070,353.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	136,000	4.960	674,560.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	49,700	10.340	513,898.000	
	マレーシア・リンギット 小計			マレーシア・リンギット 3,191,352.000 (84,499,979)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,800	236.050	2,077,240.000	

	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	896,500	19.090	17,114,185.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	75,800	50.490	3,827,142.000	
	CEMEX SAB-CPO	896,719	16.170	14,499,946.230	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA- UBD	75,600	173.070	13,084,092.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	57,400	90.840	5,214,216.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	159,300	70.600	11,246,580.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	65,300	127.380	8,317,914.000	
メキシコ・ペソ	小計			メキシコ・ペソ 75,381,315.230 (416,104,860)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	460,000	4.490	2,065,400.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	62,000	12.980	804,760.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	78,000	27.950	2,180,100.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	51,000	15.900	810,900.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	49,200	22.700	1,116,840.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL- H	2,079,800	3.910	8,132,018.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	246,000	8.650	2,127,900.000	
	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	354,000	0.860	304,440.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	29,000	33.400	968,600.000	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	71,500	10.440	746,460.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	21,500	505.000	10,857,500.000	
	AIR CHINA LTD-H	110,000	5.360	589,600.000	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	60,500	16.280	984,940.000	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	258,000	2.540	655,320.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,052,000	3.520	7,223,040.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	15,500	66.600	1,032,300.000	
	HUANENG POWER INTL INC-H	612,000	4.470	2,735,640.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	35,500	48.450	1,719,975.000	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP- H	105,000	16.180	1,698,900.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,708,000	5.720	26,929,760.000	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	124,200	12.260	1,522,692.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	704,000	3.660	2,576,640.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	50,000	15.180	759,000.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	48,400	12.200	590,480.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	27,500	44.200	1,215,500.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	475,000	5.640	2,679,000.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	76,000	4.580	348,080.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	245,000	17.780	4,356,100.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	109,120	10.000	1,091,200.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	102,800	21.100	2,169,080.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	110,000	29.800	3,278,000.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	182,000	14.760	2,686,320.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	128,500	6.850	880,225.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	22,000	46.750	1,028,500.000	
BYD CO LTD-H	5,000	274.200	1,371,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,523,000	2.690	6,786,870.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	82,000	8.510	697,820.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	25,400	11.320	287,528.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	35,800	24.050	860,990.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP-H	390,000	2.510	978,900.000	
CITIC LTD	215,000	9.830	2,113,450.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	116,500	10.580	1,232,570.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	5,490,000	4.460	24,485,400.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,676,000	1.050	1,759,800.000	
MEITUAN-CLASS B	5,200	247.400	1,286,480.000	
SEAZEN GROUP LTD	124,000	7.010	869,240.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	95,100	168.000	15,976,800.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	86,000	11.260	968,360.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA-H	215,000	2.970	638,550.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,000	30.500	762,500.000	

CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	318,000	18.040	5,736,720.000	
CGN POWER CO LTD-H	457,000	1.910	872,870.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	194,000	60.750	11,785,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	104,000	19.900	2,069,600.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	76,050	14.160	1,076,868.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	733,580	3.350	2,457,493.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	244,000	8.620	2,103,280.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	6,000	156.900	941,400.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	89,900	21.450	1,928,355.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	290,000	2.130	617,700.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	96,000	8.790	843,840.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,400	175.400	1,122,560.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	33,000	46.650	1,539,450.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	360,000	7.340	2,642,400.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	41,500	33.600	1,394,400.000	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	56,000	20.550	1,150,800.000	
SUNNY OPTICAL TECH	3,700	234.400	867,280.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	292,000	5.960	1,740,320.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	88,200	24.550	2,165,310.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	60,600	16.560	1,003,536.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	195,000	13.500	2,632,500.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	13,200	154.600	2,040,720.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	66,000	11.280	744,480.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	202,000	8.400	1,696,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	62,000	11.120	689,440.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	128,000	7.160	916,480.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	268,000	12.380	3,317,840.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	852,100	4.590	3,911,139.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	142,000	3.870	549,540.000	

	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	198,000	3.040	601,920.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	380,000	1.980	752,400.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	101,000	65.050	6,570,050.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	3,350,000	2.760	9,246,000.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	44,000	20.800	915,200.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	240,000	2.880	691,200.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	127,200	7.490	952,728.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	94,000	7.300	686,200.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	58,000	35.400	2,053,200.000	
	香港・ドル 小計			香港・ドル 242,968,987.000 (3,430,722,096)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	FUBON FINANCIAL HOLDING LTD	7,182	0.000	0.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING LTD	4,368	0.000	0.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	22,000	136.500	3,003,000.000	
	TAIWAN CEMENT	148,145	48.800	7,229,476.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	116,000	124.500	14,442,000.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	9,000	179.500	1,615,500.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	88,112	71.500	6,300,008.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	80,600	99.300	8,003,580.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	62,140	87.500	5,437,250.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	59,390	82.200	4,881,858.000	
	CHINA STEEL CORP	320,686	38.850	12,458,651.100	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	67,616	60.900	4,117,814.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	34,000	273.500	9,299,000.000	
	YAGEO CORPORATION	8,000	480.500	3,844,000.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	75,000	30.300	2,272,500.000	
	ACER INC	173,000	25.000	4,325,000.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	67,000	64.000	4,288,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	72,000	76.800	5,529,600.000	
	AU OPTRONICS CORP	668,000	16.950	11,322,600.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	83,400	111.000	9,257,400.000	
	MEDIATEK INC	16,003	896.000	14,338,688.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	36,000	162.000	5,832,000.000	

	EVA AIRWAYS CORP	169,000	17.700	2,991,300.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	118,000	28.700	3,386,600.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	207,252	77.200	15,999,854.400	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	196,838	59.200	11,652,809.600	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	412,000	13.800	5,685,600.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	219,124	26.250	5,752,005.000	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	255,381	24.500	6,256,834.500	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	176,993	32.500	5,752,272.500	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	448,231	9.350	4,190,959.850	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	247,028	22.850	5,644,589.800	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	148,214	22.650	3,357,047.100	
	LARGAN PRECISION CO LTD	2,000	2,705.000	5,410,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	8,000	430.000	3,440,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	34,000	98.600	3,352,400.000	
	WISTRON CORP	133,110	27.550	3,667,180.500	
	INNOLUX CORP	660,000	16.400	10,824,000.000	
	PEGATRON CORP	168,000	65.300	10,970,400.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	24,000	98.400	2,361,600.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	27,794	253.500	7,045,779.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	32,400	110.000	3,564,000.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	36,000	96.600	3,477,600.000	
	COMPAL ELECTRONICS	185,000	22.650	4,190,250.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	214,000	631.000	135,034,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	916,902	111.000	101,776,122.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	279.500	3,633,500.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	31,760	323.000	10,258,480.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	206,000	69.900	14,399,400.000	
台湾・ドル	小計			台湾・ドル 531,872,509.750 (2,116,107,967)	
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	24,142	132.690	3,203,401.980	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,503	1,853.220	2,785,389.660	

NEPI ROCKCASTLE PLC	15,107	104.100	1,572,638.700	
MULTICHOICE GROUP LTD	11,808	112.830	1,332,296.640	
OLD MUTUAL LTD	129,577	15.750	2,040,837.750	
VODACOM GROUP LTD	14,150	138.880	1,965,152.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,717	178.800	2,810,199.600	
NEDBANK GROUP LTD	13,946	181.190	2,526,875.740	
BIDVEST GROUP LTD	9,087	198.730	1,805,859.510	
BID CORP LTD	6,849	305.470	2,092,164.030	
STANDARD BANK GROUP LTD	32,036	145.130	4,649,384.680	
SASOL LTD	27,310	216.600	5,915,346.000	
DISCOVERY LTD	13,047	121.560	1,585,993.320	
SANLAM LTD	53,072	63.070	3,347,251.040	
FIRSTRAND LTD	121,528	61.050	7,419,284.400	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,895	62.220	1,735,626.900	
ABSA GROUP LTD	25,581	152.000	3,888,312.000	
NASPERS LTD-N SHS	2,673	2,637.640	7,050,411.720	
MTN GROUP LTD	43,366	129.780	5,628,039.480	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	6,445	198.080	1,276,625.600	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,970	201.020	2,406,209.400	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	12,225	235.830	2,883,021.750	
MR PRICE GROUP LTD	7,944	209.920	1,667,604.480	
SIBANYE STILLWATER LTD	34,477	54.710	1,886,236.670	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 73,474,163.050 (566,485,797)	
合計			14,034,335,290 [14,034,335,290]	

## (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	359,600	アメリカ・ドル 8,411,044.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 8,411,044.000 (923,364,411)	
投資証券 合計				923,364,411 [923,364,411]	
合計				923,364,411	

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 29銘柄 投資証券 1銘柄	64.4%	35.6%	17.3%
インド・ルピー	株式 43銘柄	100%	-%	10.4%
インドネシア・ルピア	株式 9銘柄	100%	-%	1.4%
オフショア・人民元	株式 51銘柄	100%	-%	3.8%
サウジアラビア・リアル	株式 9銘柄	100%	-%	1.9%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 24銘柄	100%	-%	3.9%
チリ・ペソ	株式 6銘柄	100%	-%	0.5%
トルコ・リラ	株式 13銘柄	100%	-%	1.6%
ブラジル・レアル	株式 47銘柄	100%	-%	14.8%
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 8銘柄	100%	-%	2.8%
香港・ドル	株式 88銘柄	100%	-%	23.0%
台湾・ドル	株式 49銘柄	100%	-%	14.1%
南アフリカ・ランド	株式 24銘柄	100%	-%	3.8%

## 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

	2020年9月7日現在	2021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	24,200,578	-
コール・ローン	141,495,862	157,536,907
国債証券	19,490,511,720	29,570,161,880
地方債証券	1,559,737,800	1,872,143,200
特殊債券	833,384,100	729,574,600
社債券	728,591,200	1,026,234,000
未収利息	55,401,337	69,688,654
前払費用	2,984,725	3,414,413
流動資産合計	22,836,307,322	33,428,753,654
資産合計	22,836,307,322	33,428,753,654
負債の部		
流動負債		
未払金	76,184,100	-
未払解約金	11,318	2,051,120
その他未払費用	120	-
流動負債合計	76,195,538	2,051,120
負債合計	76,195,538	2,051,120
純資産の部		
元本等		
元本	1 17,672,155,283	25,844,711,462
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,087,956,501	7,581,991,072
元本等合計	22,760,111,784	33,426,702,534
純資産合計	22,760,111,784	33,426,702,534
負債純資産合計	22,836,307,322	33,428,753,654

## 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9月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

個別法に基づき、時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	14,329,790,025円	17,672,155,283円
期中追加設定元本額	5,448,716,965円	8,590,816,286円
期中一部解約元本額	2,106,351,707円	418,260,107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（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	277,774,351円	639,795,959円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2050	2,129,262円	- 円
i F r e e 日本債券イン デックス	133,413,372円	2,898,539,667円
i F r e e 8 資産バランス	2,155,267,221円	3,248,738,657円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	6,778,854,869円	8,098,255,357円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,039,023,893円	5,338,209,559円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,234,024,213円	1,709,300,327円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	1,023,865,794円	1,344,364,000円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6 分散コー ス）	765,579,968円	1,019,443,177円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 成長コース）	247,347,157円	365,817,220円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	52,751,675円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	64,915,732円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,439,445円	- 円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	346,605,713円	646,104,950円
ダイワつみたてインデックス バランス30	25,222,208円	27,871,552円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,852,221円	11,656,233円
ダイワつみたてインデックス バランス70	3,762,294円	7,792,902円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	304,558,160円	289,059,335円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	194,767,735円	199,762,567円
計	17,672,155,283円	25,844,711,462円
2. 期末日における受益権の総数	17,672,155,283口	25,844,711,462口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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ます。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021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	2020年9月7日現在	2021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	317,831,200	68,499,480
地方債証券	5,542,100	7,682,300
特殊債券	4,715,400	2,708,900
社債券	4,428,400	3,261,700
合計	332,517,100	82,152,380

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年12月3日から2020年9月7日まで、及び2020年12月1日から2021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

2020年9月7日現在	2021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）

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.2879円	1.2934円
（1万口当たり純資産額）	（12,879円）	（12,934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 1 7 2年国債	130,000,000	130,317,200	
	4 1 8 2年国債	160,000,000	160,422,400	
	4 1 9 2年国債	350,000,000	350,990,500	
	4 2 0 2年国債	100,000,000	100,302,000	
	4 2 1 2年国債	130,000,000	130,418,600	
	4 2 2 2年国債	200,000,000	200,680,000	
	4 2 3 2年国債	30,000,000	30,063,300	
	4 2 4 2年国債	150,000,000	150,333,000	
	4 2 5 2年国債	130,000,000	130,302,900	
	4 2 6 2年国債	60,000,000	60,147,000	
	1 3 4 5年国債	170,000,000	170,479,400	
	1 3 5 5年国債	420,000,000	421,444,800	
	1 3 6 5年国債	380,000,000	381,523,800	
	1 3 7 5年国債	590,000,000	592,702,200	
	1 3 8 5年国債	510,000,000	512,621,400	
	1 3 9 5年国債	430,000,000	432,451,000	
	1 4 0 5年国債	300,000,000	301,881,000	
	1 4 1 5年国債	430,000,000	432,876,700	
	1 4 2 5年国債	200,000,000	201,448,000	
	1 4 3 5年国債	380,000,000	382,891,800	
	1 4 4 5年国債	350,000,000	352,856,000	
	1 4 5 5年国債	410,000,000	413,571,100	
	1 4 6 5年国債	170,000,000	171,535,100	
	1 4 7 5年国債	406,000,000	408,030,000	
	1 4 8 5年国債	290,000,000	291,461,600	
	1 4 0年国債	30,000,000	43,554,300	
	2 4 0年国債	48,000,000	67,500,480	
	3 4 0年国債	19,000,000	26,829,900	
	4 4 0年国債	54,000,000	76,439,700	
	5 4 0年国債	35,000,000	47,828,200	

6	40年国債	40,000,000	53,786,800	
7	40年国債	41,000,000	53,058,100	
8	40年国債	33,000,000	39,978,510	
9	40年国債	40,000,000	36,359,600	
10	40年国債	91,000,000	96,590,130	
11	40年国債	85,000,000	87,472,650	
12	40年国債	99,000,000	92,020,500	
13	40年国債	252,000,000	233,168,040	
14	40年国債	115,000,000	113,592,400	
326	10年国債	20,000,000	20,209,200	
327	10年国債	90,000,000	91,056,600	
328	10年国債	60,000,000	60,661,200	
329	10年国債	200,000,000	203,282,000	
330	10年国債	81,000,000	82,517,940	
331	10年国債	10,000,000	10,146,700	
332	10年国債	65,000,000	66,070,550	
333	10年国債	83,000,000	84,515,580	
334	10年国債	320,000,000	326,473,600	
335	10年国債	210,000,000	213,962,700	
337	10年国債	300,000,000	304,149,000	
338	10年国債	80,000,000	81,459,200	
339	10年国債	135,000,000	137,639,250	
340	10年国債	190,000,000	193,963,400	
341	10年国債	15,000,000	15,264,600	
342	10年国債	140,000,000	141,304,800	
343	10年国債	270,000,000	272,659,500	
344	10年国債	130,000,000	131,314,300	
345	10年国債	320,000,000	323,398,400	
346	10年国債	160,000,000	161,777,600	
347	10年国債	400,000,000	404,648,000	
348	10年国債	310,000,000	313,667,300	
349	10年国債	250,000,000	253,080,000	
350	10年国債	350,000,000	354,364,500	
351	10年国債	300,000,000	303,888,000	
352	10年国債	360,000,000	364,708,800	
353	10年国債	290,000,000	293,822,200	
354	10年国債	280,000,000	283,710,000	
355	10年国債	200,000,000	202,580,000	
356	10年国債	270,000,000	273,375,000	

357	10年国債	205,000,000	207,470,250
358	10年国債	310,000,000	313,577,400
359	10年国債	340,000,000	343,740,000
360	10年国債	350,000,000	353,479,000
361	10年国債	330,000,000	332,907,300
362	10年国債	315,000,000	317,394,000
363	10年国債	230,000,000	231,455,900
2	30年国債	9,000,000	10,862,280
3	30年国債	4,000,000	4,812,560
4	30年国債	8,000,000	10,139,040
5	30年国債	8,000,000	9,682,960
6	30年国債	9,000,000	11,146,320
7	30年国債	12,000,000	14,848,800
10	30年国債	25,000,000	27,865,000
11	30年国債	9,000,000	10,670,400
12	30年国債	11,000,000	13,591,490
13	30年国債	11,000,000	13,494,800
14	30年国債	22,000,000	28,156,480
15	30年国債	21,000,000	27,222,720
16	30年国債	26,000,000	33,810,140
17	30年国債	17,000,000	21,966,890
18	30年国債	20,000,000	25,650,600
19	30年国債	15,000,000	19,302,150
20	30年国債	16,000,000	21,095,040
21	30年国債	16,000,000	20,708,640
22	30年国債	17,000,000	22,536,220
23	30年国債	16,000,000	21,283,040
24	30年国債	15,000,000	20,005,650
25	30年国債	17,000,000	22,228,010
26	30年国債	32,000,000	42,442,880
27	30年国債	32,000,000	43,165,120
28	30年国債	34,000,000	46,069,320
29	30年国債	43,000,000	57,819,950
30	30年国債	56,000,000	74,651,360
31	30年国債	76,000,000	100,359,520
32	30年国債	45,000,000	60,426,450
33	30年国債	95,000,000	122,860,650
34	30年国債	110,000,000	146,795,000
35	30年国債	120,000,000	156,188,400

3 6	3 0 年国債	118,000,000	154,109,180
3 7	3 0 年国債	117,000,000	151,048,170
3 8	3 0 年国債	65,000,000	82,873,050
3 9	3 0 年国債	88,000,000	114,216,960
4 0	3 0 年国債	70,000,000	89,481,000
4 1	3 0 年国債	65,000,000	81,868,800
4 2	3 0 年国債	63,000,000	79,432,920
4 3	3 0 年国債	70,000,000	88,353,300
4 4	3 0 年国債	55,000,000	69,492,500
4 5	3 0 年国債	80,000,000	97,701,600
4 6	3 0 年国債	90,000,000	109,988,100
4 7	3 0 年国債	105,000,000	130,798,500
4 8	3 0 年国債	110,000,000	132,090,200
4 9	3 0 年国債	68,000,000	81,693,840
5 0	3 0 年国債	85,000,000	90,472,300
5 1	3 0 年国債	95,000,000	90,016,300
5 2	3 0 年国債	92,000,000	91,288,840
5 3	3 0 年国債	75,000,000	76,085,250
5 4	3 0 年国債	84,000,000	89,099,640
5 5	3 0 年国債	96,000,000	101,762,880
5 6	3 0 年国債	88,000,000	93,221,920
5 7	3 0 年国債	70,000,000	74,103,400
5 8	3 0 年国債	114,000,000	120,597,180
5 9	3 0 年国債	70,000,000	72,198,000
6 0	3 0 年国債	80,000,000	86,385,600
6 1	3 0 年国債	70,000,000	71,978,200
6 2	3 0 年国債	46,000,000	44,860,120
6 3	3 0 年国債	85,000,000	80,568,100
6 4	3 0 年国債	90,000,000	85,068,000
6 5	3 0 年国債	76,000,000	71,717,400
6 6	3 0 年国債	100,000,000	94,210,000
6 7	3 0 年国債	80,000,000	79,318,400
6 8	3 0 年国債	76,000,000	75,255,200
6 9	3 0 年国債	106,000,000	107,567,740
7 0	3 0 年国債	166,000,000	168,055,080
7 1	3 0 年国債	56,000,000	56,627,760
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,069,900
6 1	2 0 年国債	40,000,000	40,686,000
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,262,560

63	20年国債	30,000,000	31,027,800
64	20年国債	35,000,000	36,440,600
65	20年国債	42,000,000	43,936,200
66	20年国債	30,000,000	31,314,300
67	20年国債	19,000,000	19,970,900
68	20年国債	25,000,000	26,467,750
69	20年国債	12,000,000	12,674,040
70	20年国債	18,000,000	19,265,580
71	20年国債	17,000,000	18,100,410
72	20年国債	53,000,000	56,572,730
75	20年国債	14,000,000	15,095,920
76	20年国債	25,000,000	26,780,000
78	20年国債	17,000,000	18,297,270
79	20年国債	14,000,000	15,121,400
81	20年国債	65,000,000	70,555,550
82	20年国債	28,000,000	30,506,560
85	20年国債	31,000,000	34,110,230
86	20年国債	6,000,000	6,656,580
87	20年国債	35,000,000	38,670,800
88	20年国債	33,000,000	36,804,570
89	20年国債	15,000,000	16,657,200
92	20年国債	60,000,000	66,991,200
93	20年国債	18,000,000	20,095,740
94	20年国債	45,000,000	50,489,550
95	20年国債	30,000,000	34,176,300
96	20年国債	63,000,000	71,037,540
97	20年国債	25,000,000	28,472,500
98	20年国債	34,000,000	38,516,560
99	20年国債	53,000,000	60,333,080
100	20年国債	35,000,000	40,250,350
101	20年国債	18,000,000	20,936,520
102	20年国債	10,000,000	11,694,800
103	20年国債	21,000,000	24,415,860
104	20年国債	64,000,000	73,536,640
105	20年国債	38,000,000	43,858,840
106	20年国債	16,000,000	18,580,000
107	20年国債	40,000,000	46,370,000
108	20年国債	68,000,000	77,833,480
109	20年国債	60,000,000	68,946,000

110	20年国債	27,000,000	31,434,210
111	20年国債	35,000,000	41,183,450
112	20年国債	40,000,000	46,754,000
113	20年国債	70,000,000	82,138,000
114	20年国債	45,000,000	53,023,950
115	20年国債	42,000,000	49,838,460
116	20年国債	27,000,000	32,161,860
117	20年国債	77,000,000	91,062,510
118	20年国債	13,000,000	15,316,600
119	20年国債	23,000,000	26,693,800
120	20年国債	98,000,000	112,014,000
123	20年国債	42,000,000	50,163,540
124	20年国債	100,000,000	118,509,000
125	20年国債	25,000,000	30,183,250
126	20年国債	21,000,000	24,954,510
127	20年国債	110,000,000	129,668,000
128	20年国債	32,000,000	37,817,280
129	20年国債	95,000,000	111,343,800
130	20年国債	28,000,000	32,907,840
131	20年国債	150,000,000	174,793,500
132	20年国債	25,000,000	29,204,750
133	20年国債	110,000,000	129,625,100
134	20年国債	15,000,000	17,730,750
135	20年国債	20,000,000	23,431,600
136	20年国債	120,000,000	139,334,400
137	20年国債	18,000,000	21,139,380
139	20年国債	140,000,000	162,919,400
140	20年国債	40,000,000	47,086,400
141	20年国債	48,000,000	56,630,880
142	20年国債	140,000,000	166,737,200
143	20年国債	100,000,000	117,162,000
144	20年国債	70,000,000	81,215,400
145	20年国債	130,000,000	154,128,000
146	20年国債	165,000,000	196,038,150
147	20年国債	165,000,000	194,439,300
148	20年国債	145,000,000	169,384,650
149	20年国債	165,000,000	193,053,300
150	20年国債	185,000,000	214,422,400
151	20年国債	155,000,000	175,850,600

152	20年国債	160,000,000	181,673,600		
153	20年国債	180,000,000	207,108,000		
154	20年国債	155,000,000	176,397,750		
155	20年国債	165,000,000	183,328,200		
156	20年国債	140,000,000	143,547,600		
157	20年国債	160,000,000	159,313,600		
158	20年国債	205,000,000	212,886,350		
159	20年国債	145,000,000	152,582,050		
160	20年国債	130,000,000	138,743,800		
161	20年国債	115,000,000	120,927,100		
162	20年国債	175,000,000	183,874,250		
163	20年国債	120,000,000	125,979,600		
164	20年国債	185,000,000	190,975,500		
165	20年国債	115,000,000	118,578,800		
166	20年国債	170,000,000	180,725,300		
167	20年国債	125,000,000	128,578,750		
168	20年国債	120,000,000	121,190,400		
169	20年国債	115,000,000	113,942,000		
170	20年国債	125,000,000	123,625,000		
171	20年国債	105,000,000	103,651,800		
172	20年国債	165,000,000	165,570,900		
173	20年国債	130,000,000	130,226,200		
174	20年国債	135,000,000	135,000,000		
175	20年国債	135,000,000	137,293,650		
176	20年国債	150,000,000	152,440,500		
177	20年国債	44,000,000	43,838,960		
国債証券 合計			29,570,161,880		
地方債証券	751	東京都公債	100,000,000	101,493,100	
	27-15	北海道公債	100,000,000	100,847,000	
	3-5	北海道公債	100,000,000	100,066,800	
	222	神奈川県公債	100,000,000	100,195,800	
	401	大阪府公債	100,000,000	101,861,100	
	3	兵庫県公債12年	100,000,000	101,919,800	
	11	兵庫県公債20年	100,000,000	115,303,800	
	28-1	静岡県公債	100,000,000	100,266,400	
	24-16	愛知県公債	100,000,000	101,042,200	
	9	埼玉県20年	100,000,000	117,873,500	
	22-1	福岡県15年	100,000,000	106,926,400	
	29-6	千葉県公債	100,000,000	101,253,000	

	1 1 6 共同発行地方	100,000,000	100,964,500	
	1 1 7 共同発行地方	100,000,000	100,914,500	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,980,800	
	2 7 - 1 滋賀県公債	100,000,000	101,907,200	
	2 5 - 6 大阪市公債	100,000,000	101,478,700	
	1 1 名古屋市 2 0 年	100,000,000	116,848,600	
地方債証券	合計		1,872,143,200	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	107,389,600	
	8 1 政保道路機構	100,000,000	116,085,000	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	101,069,400	
	2 4 1 政保道路機構	100,000,000	101,653,400	
	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	101,606,100	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,600,000	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	100,171,100	
特殊債券	合計		729,574,600	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	100,190,500	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	101,591,100	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,362,300	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,390,500	
	5 N T Tファイナンス	100,000,000	101,523,200	
	8 0 三菱地所	100,000,000	111,859,400	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	105,565,500	
	9 ソフトバンク	100,000,000	100,182,000	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	103,388,200	
	6 5 東京瓦斯	100,000,000	100,181,300	
社債券	合計		1,026,234,000	
合計			33,198,113,680	

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	490,246,399	3,741,013,085
金銭信託	250,265,526	-
コール・ローン	1,463,251,667	1,176,672,553
国債証券	207,276,345,009	226,941,943,997
派生商品評価勘定	6,404,065	2,355,749
未収入金	-	600,311
未収利息	1,133,352,685	1,134,314,909
前払費用	55,994,215	23,265,639
流動資産合計	210,675,859,566	233,020,166,243
資産合計	210,675,859,566	233,020,166,243
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	37,986	501,792
未払金	-	3,279,982,788
未払解約金	39,857,702	261,036,765
その他未払費用	1,488	-
流動負債合計	39,897,176	3,541,521,345
負債合計	39,897,176	3,541,521,345
純資産の部		
元本等		
元本	1 69,294,023,744	73,446,052,175
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	141,341,938,646	156,032,592,723
元本等合計	210,635,962,390	229,478,644,898
純資産合計	210,635,962,390	229,478,644,898
負債純資産合計	210,675,859,566	233,020,166,243

## 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	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	64,884,126,052円	69,294,023,744円
期中追加設定元本額	11,883,280,333円	12,397,440,575円
期中一部解約元本額	7,473,382,641円	8,245,412,144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	619,439,410円	512,609,280円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	16,394,286円	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	104,485,816円	83,767,450円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	29,631,947円	22,513,805円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	347,995,057円	306,378,425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)	72,630,080円	179,493,449円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマージ ングプラス(為替ヘッジな し)	462,210,176円	507,539,232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)	1,764,861,209円	2,222,567,014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)	641,943,287円	828,065,947円
D-I's 外国債券インデッ クス	1,101,524円	1,025,990円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	910,973円	5,228,333円
iFree 外国債券イン デックス	646,512,133円	1,440,562,083円
iFree 8資産バランス	917,298,628円	1,345,747,943円
iFree 年金バランス	37,616,571円	188,922,736円
DCダイワ外国債券インデッ クス	48,137,448,595円	49,667,564,680円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	787,595,796円	916,471,858円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	431,244,535円	553,687,283円

ダイワ・ライフ・バランス70	262,640,586円	355,583,319円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	435,390,378円	558,715,222円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	326,114,604円	423,101,565円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	105,202,617円	152,013,664円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	8,986,991円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	19,218,139円	26,730,544円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,685,011円	9,205,366円
ダイワつみたてインデックス外国債券	148,838,637円	486,527,537円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,938,110円	3,149,570円
ダイワつみたてインデックスバランス50	837,194円	1,212,872円
ダイワつみたてインデックスバランス70	802,053円	1,621,513円
ダイワ世界バランスファンド40VA	182,332,430円	167,650,251円
ダイワ世界バランスファンド60VA	138,793,711円	137,927,578円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,283,805,122円	3,980,210,426円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	256,763,016円	240,831,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	147,389,137円	145,184,441円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	32,291,656円	41,586,662円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,958,427,646円	1,960,405,575円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,852,076,418円	5,845,944,132円
ダイワライフスタイル25	32,696,083円	33,184,771円

	ダイワライフスタイル50	58,954,721円	65,028,843円
	ダイワライフスタイル75	15,519,461円	17,335,260円
計		69,294,023,744円	73,446,052,175円
2.	期末日における受益権の総数	69,294,023,744口	73,446,052,175口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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	2021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	2020年9月7日現在	2021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	6,315,681,141	6,813,464,607
合計	6,315,681,141	6,813,464,607

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年12月3日から2020年9月7日まで、及び2020年12月1日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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	-	-	-	-	53,533,019	-	53,489,082	43,937
イギリス・ポンド	-	-	-	-	10,500,199	-	10,488,641	11,558
イスラエル・ シェケル	-	-	-	-	43,032,820	-	43,000,441	32,379
買 建	1,641,255,891	-	1,647,621,970	6,366,079	991,025,375	-	992,835,395	1,810,020
アメリカ・ドル	490,344,159	-	494,281,680	3,937,521	558,486,044	-	557,984,252	501,792
イギリス・ポ ンド	18,725,728	-	18,741,030	15,302	-	-	-	-

オーストラリア ・ドル	16,465,234	-	16,427,880	37,354	-	-	-	-
カナダ・ドル	30,892,358	-	31,141,730	249,372	19,249,917	-	19,360,484	110,567
シンガポール ・ドル	25,707,346	-	25,781,590	74,244	30,874,510	-	30,925,692	51,182
デンマーク・ク ローネ	30,193,719	-	30,252,960	59,241	52,836,670	-	53,128,660	291,990
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	14,064,415	-	14,167,315	102,900
ユーロ	1,028,927,347	-	1,030,995,100	2,067,753	315,513,819	-	317,268,992	1,755,173
合計	1,641,255,891	-	1,647,621,970	6,366,079	1,044,558,394	-	1,046,324,477	1,853,957

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.0397円	3.1245円
(1万口当たり純資産額)	(30,397円)	(31,245円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,786,223.640	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,465,362.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,807,981.250	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,770,499.440	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,293,590.090	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,540,491.530	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,192,327.840	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	730,714.200	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,054,454.400	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	929,782.600	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	908,845.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	951,496.020	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,012,423.440	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,273,613.740	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,641,707.760	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,256,134.880	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	768,953.600			
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	739,289.550			

3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,340,831.800	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,566,328.460	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,525,149.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,718,575.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,479,094.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,393,247.500	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,466,194.900	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,069,791.620	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,878,930.900	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,958,229.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,015,106.950	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,769,565.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,984,750.470	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,622,436.420	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,575,577.950	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,881,427.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,210,468.820	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,705,159.640	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,230,427.500	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,793,971.410	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,367,687.180	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,242,956.370	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,519,149.520	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,371,377.570	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,257,727.270	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,312,142.820	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,035,720.710	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,846,621.580	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,114,906.240	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,429,130.950	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,052,317.980	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	3,999,770.860	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,487,298.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,514,765.600	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,223,454.400	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	799,189.070	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,609,646.020	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,431,852.480	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,121,043.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	5,059,666.800	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,618,110.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,502,748.120	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,020,647.600	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,697,271.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	8,045,966.290	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,118,748.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	3,144,765.540	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,563,275.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,065,970.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,589,162.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,701,571.600	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,835,794.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,455,104.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,563,892.550	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,620,862.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,573,925.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,788,045.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,592,886.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,613,750.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,912,126.400	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,596,733.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,320,575.100	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,404,029.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,758,799.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,928,192.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,440,380.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,132,060.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,537,016.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,508,456.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,353,061.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,150,330.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,030,704.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,247,744.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,087,180.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,546,775.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,629,100.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,553,700.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,923,885.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,091,850.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,696,175.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,368,736.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,961,000.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,608,395.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	7,044,245.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,419,856.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,773,966.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,907,765.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,647,096.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,005,328.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,113,063.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,259,324.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,271,095.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,605,175.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,058,365.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,851,040.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,610,250.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,609,175.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,243,270.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,037,225.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,507,886.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,172,791.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,717,175.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,780,252.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,900,492.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,736,425.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,163,110.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,740,025.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,225,000.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,219,295.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	5,923,821.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,276,540.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,115,220.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,789,695.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,634,550.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,307,916.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,209,200.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,708,100.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,780,812.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,698,225.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,468,597.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,671,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,595,763.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,252,365.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,674,300.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,011,176.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,192,300.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,634,925.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,946,328.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,715,050.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,632,125.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,861,915.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	4,908,660.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,879,940.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,099,680.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,043,710.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,602,325.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,098,190.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,940,426.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,033,350.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,123,030.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,111,846.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	4,933,620.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,082,340.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,100,050.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,057,420.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,620,000.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,604,475.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,074,040.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,749,402.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,289,712.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	5,114,250.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,310,496.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,466,420.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	304,323.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,304,572.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,221,462.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,498,290.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,204,224.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,578,000.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,401,732.000	

0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,497,235.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,681,964.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,347,968.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,732,000.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,442,950.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,419,745.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,962,380.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,505,335.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,402,725.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,417,400.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,390.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,352,570.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,490,540.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,461,300.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,840,400.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,837,375.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,314,680.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,410,015.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	3,002,460.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,996,000.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,396,130.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	3,001,620.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,863,400.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,446,520.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,189,962.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,000,000.000	2,998,800.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,460,430.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,500,665.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,933,560.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,887,160.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	6,304,076.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,710,105.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	3,000,210.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	5,035,638.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,891,400.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,989,440.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,883,950.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	986,400.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,700,000.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,983,400.000	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,886,250.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,801,765.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,548,595.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,978,700.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	1,999,600.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,926,350.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	5,032,600.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,725,145.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,971,170.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,999,280.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,996,320.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,998,350.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	7,000,000.000	7,094,850.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	4,002,160.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	3,002,460.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	8,958,216.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,085,210.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,500,855.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,398,130.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	6,079,680.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	5,500,000.000	6,046,975.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	500,000.000	533,550.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	999,060.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	4,049,680.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,998,710.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,993,500.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,498,170.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	5,057,800.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	5,023,800.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,498,240.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,997,420.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,000,000.000	3,972,960.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	2,200,000.000	2,228,864.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,000,000.000	2,943,750.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,496,275.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,954,040.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,971,850.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,994,960.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 943,001,843.440 (103,522,742,372)	

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	1,736,188.260	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,628,848.260	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,552,006.350	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,138,908.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,350,000.000	2,628,310.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,226,625.800	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,482,967.500	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,037,110.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,625,025.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	940,000.000	1,234,464.400	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,840,590.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	1,414,175.400	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	993,667.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	821,600.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,929,735.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,237,516.700	
	0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,301,081.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,250,113.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	640,297.500	

0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,490,190.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,569,424.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	986,414.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,252,407.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,298,622.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	800,000.000	766,440.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	479,650.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	100,000.000	100,127.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	315,327.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	610,740.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,323,646.220	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,514,212.800	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,718,147.840	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,425,522.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,181,296.080	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,706,957.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,336,529.340	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,525,905.920	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,026,481.440	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	2,197,312.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,403,097.050	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,230,845.420	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,269,675.200	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,321,538.040	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,477,183.140	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,671,023.040	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,279,957.060	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,119,754.780	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,649,994.360	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	2,748,798.360	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,176,662.760	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	2,602,671.080	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 94,495,783.400 (14,364,304,035)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	2,000,000.000	2,591,600.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,919,358.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,056,720.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,186,560.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,432,549.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,944,666.000	

	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,015,800.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,134,880.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,983,096.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,547,085.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,394,504.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,613,648.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,638,222.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	2,002,780.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	201,122.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 29,662,590.000 (1,016,338,220)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,168,000.000	1,271,718.400	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,429,066.250	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,114,503.560	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,754,000.000	2,044,848.280	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,983,445.720	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,689,682.700	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,748,000.000	3,208,729.680	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,431,996.930	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,506,957.930	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	963,499.680	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,866,804.720	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,282,158.760	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,477,097.080	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	2,026,116.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,899,765.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,151,959.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	3,200,365.700	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,575,175.800	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,913,896.800	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,294,995.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,397,552.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,500,000.000	3,442,495.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,281,840.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,900,000.000	1,879,708.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,438,800.000	
0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,190,496.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,149,379.000	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 52,113,052.990	

			(4,262,847,735)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	405,000.000	515,212.650	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,326,125.980	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,646,647.890	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,515,267.600	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,286,928.280	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,308,584.090	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,278,273.010	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,480,912.150	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,637,771.520	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,224,458.320	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,001,277.390	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,248,295.600	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,762,740.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	694,037.500	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,392,536.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,341,002.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,930,633.700	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,330,849.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,252,488.000	

1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,438,948.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,485,190.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	715,267.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,866,591.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	699,790.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,700,000.000	1,598,493.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,050,944.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,192,572.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,499,145.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,098,559.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	302,331.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	1,900,000.000	1,946,132.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	99,732.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	1,005,170.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	100,000.000	98,949.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	1,001,250.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 51,273,103.880 (4,493,574,825)	
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	876,220.000	
3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	809,835.480	

3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	991,763.500	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	913,361.000	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	461,904.000	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	699,853.000	
3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	679,044.000	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	701,875.000	
2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	558,112.400	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	805,648.000	
2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	478,008.000	
2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	805,620.000	
1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	458,977.500	
2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	603,625.000	
2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	508,130.000	
2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	382,725.000	
1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	714,714.400	
0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	150,000.000	148,770.000	
1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	300,000.000	306,441.000	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,904,627.280 (974,393,744)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	スウェーデン・クローナ スウェーデン・クローナ 6,997,535.650

	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,341,024.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,358,905.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,587,967.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,297,096.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,784,794.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,777,326.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,963,920.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 51,108,569.350 (656,234,031)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	24,418,092.600	デンマーク・クローネ
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,067,559.120	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,584,716.040	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,335,922.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,172,592.500	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,341,151.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,700,000.000	2,607,201.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	503,410.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	1,016,980.000	
	デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 63,047,624.260 (1,105,855,329)	

ノルウェー・クローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	ノルウェー・クローネ 8,204,000.000	ノルウェー・クローネ 8,397,040.120	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,311,748.350	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,540,125.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,426,583.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,600,499.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,684,905.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,999,457.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,840,560.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,481,975.000	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 43,282,892.970 (549,259,912)		
ポーランド・ズロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	ポーランド・ズロチ 2,309,000.000	ポーランド・ズロチ 2,445,808.250	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,637,650.350	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,361,151.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,965,577.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,005,894.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,231,749.600	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,551,708.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,989,360.000	

	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,862,630.000	
	Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	992,450.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	1,300,000.000	1,225,640.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,073,487.350	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,820,037.500	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,942,912.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,975,496.250	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 46,081,552.300 (1,328,337,611)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,446,515.540	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,286,576.260	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,628,170.740	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,401,907.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	769,275.160	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,025,013.990	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,446,193.150	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,965,947.540	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	800,000.000	881,568.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,110,325.650	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,828,296.720	

3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,185,032.700	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,294,200.400	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,346,619.540	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	994,821.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	688,434.500	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	786,937.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,253,403.200	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,144,688.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,257,960.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,751,578.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,307,388.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	659,502.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	685,392.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,005,098.900	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,307,544.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	412,176.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,307,553.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,701,017.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,650,000.000	1,619,673.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,000,000.000	952,930.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット	

			40,451,739.490 (1,071,073,068)
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ
	5.75% Mexican Bonos 20260305	31,290,000.000	30,330,961.500
	8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	20,242,805.000
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	24,958,584.000
	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,498,936.000
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	31,343,039.460
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	26,533,346.700
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	28,970,932.480
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,084,602.140
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	32,334,726.240
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	18,622,425.140
	7.75% Mexican Bonos 20310529	20,015,000.000	21,069,590.350
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	20,187,802.640
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	8,329,284.000
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 291,507,035.650 (1,609,118,836)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	398,161.400
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	296,398.440
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	853,455.850
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	710,353.000
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	456,073.200
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	849,760.000
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	766,701.100
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	532,615.000
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	533,520.000
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,224.000

0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	310,951.700	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	401,888.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	510,600.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	369,260.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	300,000.000	308,451.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,480,519.630	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,203,480.060	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	989,298.240	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	330,211.200	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	913,041.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,355,891.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	934,567.200	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	402,948.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,294,392.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,041,181.400	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	816,496.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	999,884.200	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,011,890.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	750,512.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	376,008.000	

0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	342,604.500	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	1,014,000.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	491,582.400	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,794,194.970	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,972,226.760	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,329,165.400	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	2,006,246.070	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,517,095.320	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	940,102.400	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	958,339.400	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,185,239.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,089,511.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	840,280.800	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	472,408.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,615,323.900	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	745,400.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,642,980.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	750,384.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,253,903.800	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	652,601.400	

Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,235,688.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,300,000.000	1,307,319.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	680,000.000	602,405.200	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,134,427.540	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,667,502.960	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,043,512.260	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,307,181.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,085,838.170	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,428,289.840	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,841,328.600	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,912,790.380	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,381,078.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,359,504.540	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,774,000.000	4,712,304.760	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,435,881.840	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,680,611.880	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,456,233.900	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,886,118.680	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,685,330.010	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,657,797.610	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,326,718.950	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,691,807.840	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,253,517.860	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,289,965.560	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,351,969.700	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,498,595.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,505,063.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,415,880.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,460,333.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,670,000.000	3,495,483.900	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,040,144.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,284,760.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,335,784.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,126,750.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,050,000.000	1,972,981.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,823,937.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,943,928.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,079,020.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,874,430.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,257,048.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	935,730.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	600,000.000	609,534.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,000,000.000	1,040,410.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,071,433.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,800,000.000	1,867,482.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	100,734.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	100,923.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,011,050.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,012,850.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	101,468.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,116,317.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,797,556.700	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,930,457.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,957,651.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,739,950.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,464,248.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,369,943.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	103,236.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,272,864.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	300,000.000	310,497.000	

8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,284,834.250	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,862,592.250	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,820,044.730	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	4,816,290.690	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,320,502.740	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,443,116.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,835,220.740	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,528,880.680	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,864,000.000	6,829,156.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,511,917.460	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,341,474.500	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	6,837,261.270	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,817,749.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,138,496.680	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,217,702.460	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,494,253.220	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,301,114.290	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,281,758.870	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,639,187.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,447,612.950	

1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,689,684.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	3,976,501.480	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,423,118.180	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,694,090.970	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,800,000.000	3,952,418.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,196,129.100	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,688,830.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,783,147.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,425,968.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,738,800.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,499,524.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,342,584.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,458,514.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,547,522.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	4,615,002.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,199,329.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,278,498.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,424,576.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,751,385.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,075,180.000	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	2,216,456.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	4,048,560.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	880,000.000	722,964.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,645.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	500,000.000	492,285.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	3,300,000.000	3,309,834.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	900,000.000	922,779.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	400,000.000	393,860.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	609,721.240	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,583,118.880	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,529,674.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	839,519.940	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	3,028,481.820	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,531,960.480	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,449,818.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,729,000.000	2,873,857.350	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,633,394.040	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,857,356.550	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	2,047,690.800	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,373,602.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,424,668.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,467,261.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,262,328.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	978,570.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,441,174.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	825,424.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	850,000.000	798,031.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,332,773.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	894,060.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,089,972.360	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,524,696.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,312,082.800	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,976,389.280	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,024,066.970	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,643,556.650	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,252,791.100	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,060,112.130	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,534,049.920	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,974,069.300	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,388,626.200	

1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,569,554.980	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,686,613.720	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,135,508.280	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,585,572.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,169,469.840	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,763,880.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,689,765.500	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,376,869.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,572,684.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	3,000,348.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,687,840.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,635,777.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,336,229.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,940,318.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,378,871.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,998,188.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,331,956.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,720,608.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,639,709.700	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,861,062.500	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,279,905.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,328,084.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,315,229.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,606,600.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,033,057.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	745,505.600	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,325,688.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,446,467.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,817,902.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,571,985.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,039,240.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,475,927.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,067,440.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,625,456.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,318,772.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,778,353.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,742,415.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,300,000.000	1,384,331.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,355,384.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,109,900.000	

1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	900,000.000	900,009.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	677,600.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,898,119.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,700,000.000	2,679,345.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	697,872.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,101,782.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,513,050.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221129	100,000.000	100,588.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	463,514.400	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	809,800.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,100,000.000	1,123,287.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,016,200.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	500,000.000	504,155.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	300,000.000	299,526.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,820,100.940	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,290,394.570	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,773,563.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,419,469.960	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,824,081.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,249,081.080	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,475,537.250	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,505,699.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,608,471.110	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,495,633.400	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,754,829.280	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,095,142.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,145,001.800	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,050,785.320	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,951,491.480	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,460,571.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,467,497.080	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,897,801.340	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,391,385.500	
5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,493,649.920	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,743,321.200	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,239,238.000	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,385,261.080	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,119,417.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,409,288.640	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,436,581.590	

2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,645,612.150	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,023,897.960	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,250,840.130	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	667,960.800	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	669,423.880	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,179,022.070	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,024,140.920	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,150,685.200	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	665,230.500	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	352,474.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	867,720.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	855,022.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	854,377.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,049,132.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	834,351.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	357,791.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	829,816.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	821,896.000	
IRISH TREASURY 20311018	500,000.000	499,625.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	402,664.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,159,958.250	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,226,813.780	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,097,486.250	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	915,974.960	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	728,748.280	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,013,415.410	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,010,833.950	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,003,880.550	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,002,449.880	

4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	788,594.100	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	476,112.660	
1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	319,547.280	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	462,256.700	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	609,006.310	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	567,167.350	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,849,616.680	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,202,914.900	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,382,946.560	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,430,599.200	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,030,842.340	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,730,320.960	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,452,053.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,854,365.300	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,092,508.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,137,625.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,259,489.500	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,620,480.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,644,008.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,767,961.000	

0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,443,872.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	3,203,572.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,778,992.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,157,821.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,352,762.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,925,608.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,405,872.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,485,264.200	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,543,000.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,300,000.000	1,224,951.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,544,240.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,182,837.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,360,047.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	508,300.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,169,640.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	304,293.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	598,689.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	504,090.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	909,414.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	600,000.000	610,986.000	

	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,449,465.950	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,430,024.500	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,706,472.900	
	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,901,786.940	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,343,426.070	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,631,178.000	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,573,422.950	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,124,057.980	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,107,391.570	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,436,174.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,199,000.000	2,228,917.020	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,199,958.100	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,316,262.320	
	ユーロ 小計		ユーロ 705,320,229.100 (91,987,864,279)	
国債証券	合計		226,941,943,997 [226,941,943,997]	
合計			226,941,943,997 [226,941,943,997]	

- (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 256銘柄	100%	45.7%

イギリス・ポンド	国債証券	51銘柄	100%	6.3%
イスラエル・シケル	国債証券	15銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	100%	1.9%
カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券	31銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	352銘柄	100%	40.5%

## 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

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	163,343,622	136,516,124
金銭信託	27,085,007	-
コール・ローン	158,360,534	226,415,371
国債証券	16,082,945,127	21,361,895,992
派生商品評価勘定	1,870,918	226,141
未収入金	-	22,337,536
未収利息	205,790,810	292,092,457
前払費用	23,733,989	22,637,518
その他未収収益	-	1,193
流動資産合計	16,663,130,007	22,062,122,332
資産合計	16,663,130,007	22,062,122,332

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,373,372	115,549
未払金	29,036,624	49,272,743
未払解約金	7,612,716	21,986,798
その他未払費用	168	-
流動負債合計	39,022,880	71,375,090
負債合計	39,022,880	71,375,090
純資産の部		
元本等		
元本	1	12,256,994,427
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,367,112,700
元本等合計		16,624,107,127
純資産合計		16,624,107,127
負債純資産合計		16,663,130,007
		22,062,122,332

## 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	為替予約取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	10,015,179,396円	12,256,994,427円
期中追加設定元本額	3,334,908,979円	3,515,963,600円
期中一部解約元本額	1,093,093,948円	642,185,200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)	63,982,469円	157,594,408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)	258,222,119円	273,518,080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)	358,926,042円	449,770,342円
D-I's 新興国債券インデックス	55,788,261円	58,097,550円

iFree 新興国債券イン デックス	2,957,472,086円	4,062,915,785円
iFree 8資産バランス	2,065,719,756円	2,915,477,206円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	6,282,460,991円	7,016,649,882円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	174,895,312円	163,614,930円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	39,527,391円	33,134,644円
計	12,256,994,427円	15,130,772,827円
2. 期末日における受益権の総数	12,256,994,427口	15,130,772,827口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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	2021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	2020年9月7日現在	2021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	8,997,064	39,729,405
合計	8,997,064	39,729,405

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年7月7日から2020年9月7日まで、及び2021年7月6日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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	41,754,042	-	41,789,644	35,602
アメリカ・ドル	18,611,845	-	18,611,250	595	20,557,732	-	20,557,544	188

ブラジル・リアル	-	-	-	-	21,196,310	-	21,232,100	35,790
買建	222,522,605	-	222,019,556	503,049	135,757,370	-	135,903,564	146,194
コロンビア・ペソ	-	-	-	-	20,557,732	-	20,509,208	48,524
チェコ・コルナ	-	-	-	-	7,936,519	-	7,910,614	25,905
トルコ・リラ	-	-	-	-	25,736,895	-	25,776,475	39,580
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	5,913,389	-	5,908,059	5,330
メキシコ・ペソ	75,598,601	-	77,239,080	1,640,479	23,758,495	-	23,940,140	181,645
ルーマニア・レイ	30,029,068	-	29,802,240	226,828	51,854,340	-	51,859,068	4,728
南アフリカ・ランド	9,678,296	-	9,908,140	229,844	-	-	-	-
合計	241,134,450	-	240,630,806	502,454	177,511,412	-	177,693,208	110,592

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.3563円	1.4534円

(1万口当たり純資産額)	(13,563円)	(14,534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	9,314,745,000.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	7,090,980,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,939,340,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,728,364,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,954,000,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,200,000,000.000	8,274,168,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	13,651,440,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	14,300,000,000.000	15,187,887,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	16,000,000,000.000	16,908,480,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	9,300,000,000.000	9,982,992,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	10,000,000,000.000	10,696,300,000.000	
		5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	15,400,000,000.000	15,695,218,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	15,800,000,000.000	16,264,994,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	4,300,000,000.000	4,288,003,000.000			

	11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	4,382,496,000.000	
	10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	2,180,000,000.000	2,821,792,000.000	
	9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,643,685,100.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	14,637,698,320.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,388,732,500.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	11,139,562,100.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20220515	11,060,000,000.000	11,355,965,600.000	
	5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	10,910,000,000.000	11,221,371,400.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,761,669,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	7,134,642,250.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	14,379,094,800.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	14,408,849,500.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	8,120,000,000.000	9,572,424,400.000	
	インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 273,824,893,970.000 (2,108,451,684)	
ウルグアイ・ペ ソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,921,016.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	7,000,000.000	7,106,470.000	
	ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 10,027,486.000 (25,850,859)	
オフショア・人 民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	

3.29% China Government Bond 20231018	3,900,000.000	3,969,303.000	
3.22% China Government Bond 20251206	5,700,000.000	5,831,100.000	
3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,927,152.000	
3.19% China Government Bond 20240411	5,300,000.000	5,394,817.000	
3.29% China Government Bond 20290523	8,200,000.000	8,434,930.000	
3.25% China Government Bond 20260606	6,800,000.000	6,977,548.000	
3.12% China Government Bond 20261205	7,000,000.000	7,134,190.000	
3.13% China Government Bond 20291121	7,000,000.000	7,116,690.000	
2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,548,105.000	
2.85% China Government Bond 20270604	8,600,000.000	8,620,726.000	
2.68% China Government Bond 20300521	9,400,000.000	9,214,726.000	
1.99% China Government Bond 20250409	8,000,000.000	7,818,000.000	
2.36% China Government Bond 20230702	6,150,000.000	6,137,577.000	
2.88% China Government Bond 20231105	4,900,000.000	4,939,739.000	
3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,108,290.000	
3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,150,700.000	
3.27% China Government Bond 20301119	7,300,000.000	7,542,725.000	
3.03% China Government Bond 20260311	1,700,000.000	1,727,421.000	
3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	6,182,278.000	
2.84% China Government Bond 20240408	2,500,000.000	2,519,700.000	

	3.01% China Government Bond 20280513	1,000,000.000	1,010,040.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	1,000,000.000	1,061,320.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	4,200,000.000	4,265,772.000	
オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 127,632,849.000 (2,172,349,380)	
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	107,042,400.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	45,224,100.000	
	7% Colombian TES 20220504	3,635,000,000.000	3,750,047,750.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,050,000,000.000	3,441,650,500.000	
	6% Colombian TES 20280428	4,290,000,000.000	4,140,579,300.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	3,710,000,000.000	3,920,950,600.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	2,844,153,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	3,800,000,000.000	3,715,640,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,700,000,000.000	2,746,413,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	3,400,000,000.000	3,344,410,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	2,400,000,000.000	2,304,552,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	1,410,000,000.000	1,299,625,200.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	1,200,000,000.000	1,051,260,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	700,000,000.000	687,652,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			コロンビア・ペソ 33,399,199,850.000 (965,604,267)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	30,050,000.000	37,709,745.000	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	24,587,558.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	26,610,000.000	30,159,241.800	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	28,700,000.000	34,064,317.000	

1.875% Thailand Government Bond 20220617	17,200,000.000	17,390,060.000	
3.4% Thailand Government Bond 20360617	23,600,000.000	27,410,928.000	
2.125% Thailand Government Bond 20261217	35,400,000.000	37,684,716.000	
2% Thailand Government Bond 20221217	24,000,000.000	24,465,360.000	
3.775% Thailand Government Bond 20320625	32,500,000.000	39,032,825.000	
2.875% Thailand Government Bond 20460617	24,900,000.000	27,233,379.000	
2.4% Thailand Government Bond 20231217	24,500,000.000	25,544,435.000	
2.875% Thailand Government Bond 20281217	26,500,000.000	29,460,845.000	
3.3% Thailand Government Bond 20380617	31,500,000.000	36,190,665.000	
1.45% Thailand Government Bond 20241217	30,000,000.000	30,851,700.000	
1.6% Thailand Government Bond 20291217	27,500,000.000	27,838,800.000	
1.6% Thailand Government Bond 20350617	15,500,000.000	14,802,500.000	
0.95% Thailand Government Bond 20250617	34,000,000.000	34,417,520.000	
0.75% Thailand Government Bond 20240617	20,900,000.000	21,015,995.000	
1.585% Thailand Government Bond 20351217	12,400,000.000	11,755,076.000	
2% Thailand Government Bond 20311217	9,000,000.000	9,298,440.000	
2% Thailand Government Bond 20420617	7,000,000.000	6,630,540.000	
1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	8,000,000.000	8,050,480.000	
タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 555,595,125.800 (1,877,911,525)	
チェコ・コロナ		チェコ・コロナ	チェコ・コロナ

	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	15,600,000.000	16,363,620.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	9,552,020.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	8,700,000.000	9,035,385.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	16,529,870.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	17,900,000.000	17,297,665.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	16,000,000.000	14,927,200.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	9,900,000.000	9,663,390.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	15,500,000.000	14,307,275.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	15,000,000.000	16,084,200.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	17,000,000.000	17,317,050.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	13,000,000.000	12,280,710.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	6,000,000.000	5,226,180.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	7,500,000.000	9,723,150.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	7,000,000.000	6,974,170.000	
	1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	14,000,000.000	13,833,820.000	
	チェコ・コロナ 小計		チェコ・コロナ 189,115,705.000 (970,863,294)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	503,000,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000	553,031,100.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000	443,521,600.000	

	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	410,000,000.000	401,172,700.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	250,830,000.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	650,000,000.000	614,464,500.000	
	2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	100,000,000.000	84,868,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	202,088,000.000	
	チリ・ペソ 小計		チリ・ペソ 3,052,975,900.000 (433,647,750)	
トルコ・リラ	8.5% Turkey Government Bond 20220914	トルコ・リラ 790,000.000	トルコ・リラ 726,033.700	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	2,411,121.800	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	585,323.600	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,337,268.300	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,065,435.800	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	2,084,578.400	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,366,288.100	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,788,793.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	2,500,000.000	1,936,225.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,313,592.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	1,674,700.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	1,400,000.000	1,372,294.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	6,100,000.000	5,354,702.000	

	11.7% Turkey Government Bond 20301113	4,300,000.000	3,363,890.000	
トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 28,380,245.700 (376,160,291)	
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 13,145,000.000	
ドミニカ・ペソ 小計			ドミニカ・ペソ 13,145,000.000 (25,363,278)	
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	101,139,800.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	174,731,100.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	140,862,400.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	131,803,100.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	111,601,600.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	145,000,000.000	148,320,500.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	160,000,000.000	161,553,600.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	202,000,000.000	209,090,200.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	40,176,400.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	130,000,000.000	123,201,000.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	75,000,000.000	70,830,000.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	95,000,000.000	91,181,000.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	80,000,000.000	76,391,200.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	145,000,000.000	134,143,850.000	

	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	95,474,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	145,111,800.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	130,681,250.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	159,134,025.000	
ハンガリー・フォロント 小計			ハンガリー・フォロント 2,245,426,825.000 (842,237,148)	
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 11,963,000.000	
フィリピン・ペソ 小計			フィリピン・ペソ 11,963,000.000 (26,295,871)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	ブラジル・リアル 10,210,000.000	ブラジル・リアル 10,355,594.600	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	10,690,000.000	10,733,615.200	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	9,150,000.000	9,022,174.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	5,300,000.000	5,151,388.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	3,600,000.000	3,438,396.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	8,300,000.000	7,791,708.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	12,700,000.000	10,828,147.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	24,200,000.000	19,606,840.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240701	7,800,000.000	6,009,276.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 82,937,139.300 (1,760,929,636)	

ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 730,000.000	ペルー・ソル 768,266.600	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,022,520.200	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	1,801,900.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	1,900,000.000	1,897,074.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,050,000.000	1,793,606.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,000,000.000	809,010.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,565,000.000	1,795,211.500	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	2,009,534.100	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,014,560.000	
ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 14,911,682.900 (398,999,355)		
ポーランド・ズ ロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	ポーランド・ズロチ 3,610,000.000	ポーランド・ズロチ 3,823,892.500	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	5,990,000.000	6,346,704.500	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	4,140,000.000	4,389,642.000	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,200,000.000	3,247,744.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	4,500,000.000	4,635,090.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	4,700,000.000	4,922,545.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	6,450,000.000	6,972,063.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,100,000.000	3,238,322.000	

	0.75% Poland Government Bond 20250425	4,000,000.000	3,978,720.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	4,600,000.000	4,389,366.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	3,400,000.000	3,205,520.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	3,530,000.000	3,792,279.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	4,500,000.000	4,861,125.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	5,150,000.000	5,581,312.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 63,384,325.500 (1,827,103,890)	
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	
	3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414	3,400,000.000	3,444,302.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,919,178.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,081,600.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,700,000.000	1,832,702.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,600,000.000	1,702,016.000	
	3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	1,700,000.000	1,765,943.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	2,200,000.000	2,301,970.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	2,500,000.000	2,534,100.000	
	3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	2,200,000.000	2,247,366.000	
	3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	1,500,000.000	1,432,050.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	1,750,000.000	1,804,215.000	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	800,000.000	819,192.000	

3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	2,350,000.000	2,449,616.500	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,827,783.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	2,950,000.000	3,105,052.000	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,800,000.000	1,909,476.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,447,978.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	2,000,000.000	2,118,260.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,205,112.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	3,020,000.000	3,168,735.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,520,000.000	2,654,265.600	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,600,000.000	2,859,584.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,442,476.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,108,900.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,950,000.000	3,096,880.500	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	1,100,000.000	1,133,484.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,350,000.000	2,363,653.500	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,800,000.000	1,749,618.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,800,000.000	2,748,536.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,900,000.000	1,810,567.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 63,084,611.100 (1,670,341,716)	
メキシコ・ペソ 5.75% Mexican Bonos 20260305	メキシコ・ペソ 37,400,000.000	メキシコ・ペソ 36,253,690.000	

	8% Mexican Bonos 20471107	20,500,000.000	21,501,425.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	26,000,000.000	27,265,680.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	23,000,000.000	23,399,740.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	27,250,000.000	28,438,645.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	26,550,000.000	29,451,915.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	30,230,000.000	31,314,047.800	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	9,230,922.900	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	30,730,000.000	33,632,755.800	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	24,900,000.000	27,447,519.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	25,450,000.000	26,790,960.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,450,000.000	28,681,014.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	20,120,000.000	20,666,459.200	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	10,935,855.000	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 355,010,629.200 (1,959,658,672)	
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	1,499,240.600	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,201,991.500	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	2,347,821.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,101,401.400	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,604,608.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,536,525.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,801,630.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,600,000.000	1,691,072.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	1,400,000.000	1,362,354.000	
	4.5% Romania Government Bond 20240617	900,000.000	931,185.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	1,500,000.000	1,515,975.000	

	4.15% Romania Government Bond 20280126	800,000.000	822,176.000	
	3.7% Romania Government Bond 20241125	1,300,000.000	1,319,240.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	800,000.000	791,792.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	1,000,000.000	1,018,460.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	800,000.000	831,352.000	
	ルーマニア・レイ 小計		ルーマニア・レイ 22,376,823.500 (589,947,049)	
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	49,592,253.200	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	32,910,000.000	33,173,609.100	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	14,442,048.000	
	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	46,791,007.200	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	33,800,000.000	33,968,324.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	31,000,000.000	34,503,000.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	51,600,000.000	53,807,964.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	44,000,000.000	44,346,720.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	46,100,000.000	48,641,032.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	48,600,000.000	49,023,306.000	
	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	38,000,000.000	37,774,660.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	45,000,000.000	45,638,100.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	51,000,000.000	51,131,070.000	

	7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	51,000,000.000	53,525,520.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	55,819,500.000	
	7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	59,000,000.000	59,745,760.000	
	7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	65,000,000.000	68,287,050.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	40,117,360.000	
	6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	58,000,000.000	55,763,520.000	
	4.5% Russian Federal Bond - OFZ 20250716	57,000,000.000	52,593,330.000	
	6.1% Russian Federal Bond - OFZ 20350718	53,000,000.000	48,243,780.000	
	5.7% Russian Federal Bond - OFZ 20280517	65,000,000.000	61,216,350.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 1,038,145,263.500 (1,567,599,348)	
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	37,550,000.000	42,653,045.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,220,000.000	8,001,655.200	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,780,000.000	6,609,813.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	12,440,000.000	10,764,954.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	11,380,000.000	11,846,921.400	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	34,020,000.000	28,927,886.400	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	23,900,000.000	20,617,335.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	31,400,000.000	29,951,832.000	

	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	20,100,000.000	17,104,497.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	21,600,000.000	19,873,728.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	20,600,000.000	18,819,130.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	15,200,000.000	13,438,928.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 228,609,725.000 (1,762,580,979)	
国債証券	合計		21,361,895,992 [21,361,895,992]	
合計			21,361,895,992 [21,361,895,992]	

- (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 27銘柄	100%	9.9%
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 23銘柄	100%	10.2%
コロンビア・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	4.5%
タイ・バーツ	国債証券 22銘柄	100%	8.8%
チェコ・コルナ	国債証券 15銘柄	100%	4.5%
チリ・ペソ	国債証券 8銘柄	100%	2.0%
トルコ・リラ	国債証券 14銘柄	100%	1.8%
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 18銘柄	100%	3.9%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ブラジル・リアル	国債証券 9銘柄	100%	8.2%
ペルー・ソル	国債証券 9銘柄	100%	1.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	8.6%
マレーシア・リンギット	国債証券 30銘柄	100%	7.8%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.2%
ルーマニア・レイ	国債証券 16銘柄	100%	2.8%
ロシア・ルーブル	国債証券 22銘柄	100%	7.3%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	100%	8.3%

## 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

	2020年9月7日現在	2021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	759,908,277	-
コール・ローン	4,443,029,250	9,049,899,340
投資証券 2	345,406,939,740	475,939,964,100
未収入金	68,413,210	1,022,517,459
未収配当金	4,621,562,149	5,258,663,033
流動資産合計	355,299,852,626	491,271,043,932
資産合計	355,299,852,626	491,271,043,932
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	57,802,500	57,176,000
前受金	104,127,400	7,840,000
未払金	713,041,408	573,923,700
未払解約金	33,654,000	591,401,000
その他未払費用	4,623	-
流動負債合計	908,629,931	1,230,340,700
負債合計	908,629,931	1,230,340,700
純資産の部		
元本等		
元本 1	130,880,999,900	138,556,634,922
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	223,510,222,795	351,484,068,310
元本等合計	354,391,222,695	490,040,703,232
純資産合計	354,391,222,695	490,040,703,232

負債純資産合計	355,299,852,626	491,271,043,932
---------	-----------------	-----------------

## 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9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	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	104,354,428,940円	130,880,999,900円
期中追加設定元本額	48,492,275,048円	33,975,234,504円
期中一部解約元本額	21,965,704,088円	26,299,599,482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	5,691,649,149円	5,124,278,617円

	ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	114,727,765,723円	122,438,993,777円
	ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	332,368,636円	338,225,196円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,188,915円	6,504,394円
	iFree J-REITイ ンデックス	133,232,767円	483,006,494円
	iFree 8資産バランス DC・ダイワJ-REIT オープン	1,030,596,868円	1,197,273,510円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	5,330,291,237円	5,394,658,162円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	2,477,304円	- 円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,631,249円	5,225,396円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,800,390円	4,036,190円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	100,959,881円	99,168,219円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,710,148,234円	1,827,586,069円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	262,363,036円	148,721,866円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	412,746,462円	487,256,716円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,137,780,049円	1,001,700,316円
計		130,880,999,900円	138,556,634,922円
2.	期末日における受益権の総数	130,880,999,900口	138,556,634,922口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 4,479,350,000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 6,000,300,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2020年9月8日 至 2021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)における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021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	2020年9月7日現在	2021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	29,151,211,333	41,211,046,557
合計	29,151,211,333	41,211,046,557

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年3月17日から2020年9月7日まで、及び2021年3月16日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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	8,966,475,000	-	8,909,250,000	57,225,000	12,026,560,000	-	11,970,000,000	56,560,000
合計	8,966,475,000	-	8,909,250,000	57,225,000	12,026,560,000	-	11,970,000,000	56,560,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.7077円	3.5368円
（1万口当たり純資産額）	（27,077円）	（35,368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	8,178	1,120,386,000	
	サンケイリアルエステート	12,864	1,623,436,800	
	SOSILA物流リート投	17,037	3,158,659,800	
	東海道リート投資法	3,110	329,660,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	14,023	9,128,973,000	
	森ヒルズリート	47,756	7,492,916,400	
	産業ファンド	57,655	12,649,507,000	
	アドバンス・レジデンス	40,606	15,247,553,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27,738	6,304,847,400	
	A P I 投資法人	21,655	9,863,852,500	
	G L P 投資法人	131,532	26,069,642,400	
	コンフォリア・レジデンシャル	18,286	6,390,957,000	
	日本プロロジスリート	64,341	25,993,764,000	
	星野リゾート・リート	6,266	4,461,392,000	
	ONE リート投資法人	6,330	1,968,630,000	
	イオンリート投資	47,761	7,121,165,100	
	ヒューリックリート投資法	35,701	6,422,609,900	
	日本リート投資法人	12,532	5,470,218,000	
	積水ハウス・リート投資	119,450	11,001,345,000	
	トーセイ・リート投資法人	8,486	1,186,342,800	
	ケネディクス商業リート	16,215	4,825,584,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	8,662	1,308,828,200	
	サムティ・レジデンシャル	9,199	1,098,360,600	
	野村不動産マスターF	131,330	22,391,765,000	
	いちごホテルリート投資	6,728	623,685,600	
	ラサールロジポート投資	49,717	9,764,418,800	
スターアジア不動産投	41,970	2,396,487,000		
マリモ地方創生リート	3,805	492,747,500		
三井不ロジパーク	15,096	9,616,152,000		
大江戸温泉リート	6,555	525,055,500		

投資法人みらい	46,298	2,472,313,200	
森トラスト・ホテルリート投	9,528	1,288,185,600	
三菱地所物流REIT	10,321	5,346,278,000	
CREロジスティクスファンド	13,930	3,050,670,000	
ザイマックス・リート	5,895	667,314,000	
タカラレーベン不動産投	16,015	1,739,229,000	
伊藤忠アドバンスロジ	15,835	2,577,938,000	
日本ビルファンド	46,026	34,335,396,000	
ジャパンリアルエステイト	40,612	28,387,788,000	
日本都市ファンド投資法人	204,909	22,806,371,700	
オリックス不動産投資	80,919	15,876,307,800	
日本プライムリアルティ	26,690	10,916,210,000	
NTT都市開発リート投資法人	36,682	5,700,382,800	
東急リアル・エステート	27,229	5,184,401,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	28,201	3,460,262,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	91,425	14,426,865,000	
森トラスト総合リート	29,025	4,452,435,000	
インヴィンシブル投資法人	178,750	7,882,875,000	
フロンティア不動産投資	14,237	6,712,745,500	
平和不動産リート	26,310	4,293,792,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	26,535	9,167,842,500	
福岡リート投資法人	21,004	3,644,194,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,563	9,811,703,000	
いちごオフィスリート投資法人	33,277	3,138,021,100	
大和証券オフィス投資法人	8,586	6,628,392,000	
阪急阪神リート投資法人	18,344	3,057,944,800	
スターツプロシード投資法人	6,324	1,670,800,800	
大和ハウスリート投資法人	60,979	21,007,265,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	124,417	8,360,822,400	
大和証券リビング投資法人	53,120	6,448,768,000	
ジャパンエクセレント投資法人	37,684	5,377,506,800	
投資証券 合計		475,939,964,100	
合計		475,939,964,100	

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せん。

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	48,519,710	248,399,636
金銭信託	62,073,225	-
コール・ローン	362,929,529	276,222,106
投資信託受益証券	26,132,652	565,003,409
投資証券	26,170,300,071	44,420,137,328
派生商品評価勘定	9,397,363	42,304,577
未収入金	701,114	1,180,796
未収配当金	29,200,354	38,645,017
差入委託証拠金	240,195,819	352,988,631
流動資産合計	26,949,449,837	45,944,881,500
資産合計	26,949,449,837	45,944,881,500
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,181,605	699,877
未払金	26,196,319	42,622,634
未払解約金	12,817,000	14,072,300
その他未払費用	474	-
流動負債合計	46,195,398	57,394,811
負債合計	46,195,398	57,394,811
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,710,434,181	15,069,273,862
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,192,820,258	30,818,212,827
元本等合計	26,903,254,439	45,887,486,689

純資産合計	26,903,254,439	45,887,486,689
負債純資産合計	26,949,449,837	45,944,881,500

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年9月7日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2019年9月10日	2020年9月8日
期首元本額	10,095,442,480円	12,710,434,181円
期中追加設定元本額	5,387,342,068円	4,942,761,042円
期中一部解約元本額	2,772,350,367円	2,583,921,361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	5,923,738,240円	6,320,386,503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	1,095,052,315円	1,145,157,463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イン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	350,937,429円	339,268,737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)	256,912,078円	285,819,023円
D-I's グローバルREITインデックス	2,351,557円	2,091,742円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	1,557,802円	6,536,630円
iFree 外国REITインデックス	118,408,376円	540,457,173円
iFree 8資産バランス	1,321,841,726円	1,418,312,242円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	29,687,634円	209,938,602円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	18,871,924円	102,389,007円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,645,406,694円	3,118,282,148円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,233,380円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,024,373円	6,128,053円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,635,506円	4,881,134円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	249,211,041円	183,749,014円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	- 円	184,925,099円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	254,423,431円	247,424,169円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	51,363,816円	62,138,978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)	172,589,274円	875,372,290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)	205,187,585円	16,015,855円
計	12,710,434,181円	15,069,273,862円
2. 期末日における受益権の総数	12,710,434,181口	15,069,273,862口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月8日 至 2021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	2021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	2020年9月7日現在	2021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	3,191	20,910,225
投資証券	4,945,220,898	8,958,970,297
合計	4,945,224,089	8,979,880,522

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年12月3日から2020年9月7日まで、及び2020年12月1日から2021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	2020年9月7日 現在				2021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	721,672,433	-	723,152,137	1,479,704	860,954,445	-	902,772,136	41,817,691
合計	721,672,433	-	723,152,137	1,479,704	860,954,445	-	902,772,136	41,817,691

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2020年9月7日 現在				2021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	433,116,146	-	433,852,200	736,054	262,061,691	-	261,848,700	212,991
アメリカ・ドル	309,171,136	-	310,460,400	1,289,264	168,396,315	-	167,917,500	478,815
ユーロ	123,945,010	-	123,391,800	553,210	93,665,376	-	93,931,200	265,824
合計	433,116,146	-	433,852,200	736,054	262,061,691	-	261,848,700	212,991

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（1口当たり情報）

	2020年9月7日現在	2021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）	2,1166円 (21,166円)	3,0451円 (30,451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	46,400,000	5,146,688,000	
		アメリカ・ドル 小計		5,146,688,000 (565,003,409)	
投資信託受益証券 合計				565,003,409 [565,003,409]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33,200	722,100,000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,900	165,564,000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	28,682	544,671,180	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	28,800	493,632,000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	35,200	8,196,320,000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	82,947	11,260,055,250	
		BOSTON PROPERTIES INC	35,800	4,076,904,000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	36,789	272,606,490	
		VORNADO REALTY TRUST	39,664	1,660,335,040	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	21,200	460,464,000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	19,900	1,169,523,000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	5,500	368,940,000	
		EQUITY RESIDENTIAL	86,800	7,429,212,000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	52,600	795,838,000			

EPR PROPERTIES	18,900	979,020.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,100	77,461.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	151,683.000	
GLOBAL NET LEASE INC	24,133	416,294.250	
EQUINIX INC	22,600	19,951,958.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19,829	575,041.000	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	128,412.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	8,800	138,600.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,900	1,146,333.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	30,000	546,900.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,500	272,635.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	177,900	2,876,643.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	69,008	2,933,530.080	
CORESITE REALTY CORP	10,900	1,682,742.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	38,100	1,042,035.000	
RLJ LODGING TRUST	41,871	602,942.400	
FARMLAND PARTNERS INC	6,700	84,018.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	54,500	1,031,140.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14,000	191,100.000	
CYRUSONE INC	30,900	2,493,630.000	
KIMCO REALTY CORP	151,162	3,345,215.060	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	13,800	219,282.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	55,250	1,728,220.000	
WHITESTONE REIT	8,500	83,470.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	55,137	2,830,182.210	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	32,300	576,878.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	59,680	1,114,822.400	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	126,711	867,970.350	
INVITATION HOMES INC	143,197	6,007,114.150	
JBG SMITH PROPERTIES	27,932	851,926.000	
ALEXANDER & BALDWIN INC	18,700	428,043.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	12,138.000	
GLADSTONE LAND CORP	6,400	152,704.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	63,600	2,396,448.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,900	442,656.000	
VICI PROPERTIES INC	135,400	4,336,862.000	
RETAIL VALUE INC	4,490	116,021.600	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	26,676.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,100	1,537,688.000	

SAFEHOLD INC	3,800	322,354.000	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	26,000	221,520.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	29,700	970,596.000	
COREPOINT LODGING INC	10,700	152,582.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,400	174,788.000	
STORE CAPITAL CORP	61,500	2,217,690.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,900	41,300.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	39,900	1,110,018.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25,300	231,495.000	
LIFE STORAGE INC	19,450	2,510,800.500	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,300	489,417.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	26,582	556,361.260	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12,200	155,428.000	
PARAMOUNT GROUP INC	40,200	354,162.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34,000	344,760.000	
NETSTREIT CORP	6,300	164,493.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	39,589	2,070,900.590	
CTO REALTY GROWTH INC	1,200	68,196.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	33,900	2,150,616.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	28,100	464,774.000	
STAG INDUSTRIAL INC	40,300	1,743,781.000	
VENTAS INC	94,579	5,325,743.490	
CARETRUST REIT INC	24,503	546,906.960	
GEO GROUP INC/THE	27,400	216,734.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	75,000	1,772,250.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11,800	314,588.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	54,487	893,586.800	
UMH PROPERTIES INC	10,600	264,788.000	
IRON MOUNTAIN INC	72,800	3,594,864.000	
TERRENO REALTY CORP	17,600	1,218,976.000	
VEREIT INC	57,681	2,920,389.030	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	29,020	1,507,589.000	
SUN COMMUNITIES INC	28,200	5,897,466.000	
ACADIA REALTY TRUST	21,111	451,142.070	
ALEXANDER'S INC	500	128,970.000	
PROLOGIS INC	186,819	25,965,972.810	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	34,600	7,211,332.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	43,300	606,200.000	
SAUL CENTERS INC	3,200	145,504.000	

MACK-CALI REALTY CORP	22,500	402,525.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	24,600	3,774,624.000	
COUSINS PROPERTIES INC	37,406	1,460,704.300	
SITE CENTERS CORP	43,978	710,684.480	
DUKE REALTY CORP	94,500	5,067,090.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	10,100	1,863,652.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,367	5,492,437.860	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	32,600	1,848,094.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,900	2,199,194.000	
GETTY REALTY CORP	8,803	279,671.310	
WELLTOWER INC	105,400	9,143,450.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	136,000	4,943,600.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26,300	1,216,638.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	41,700	471,210.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	35,800	1,107,652.000	
EQUITY COMMONWEALTH	31,775	841,402.000	
KILROY REALTY CORP	26,800	1,784,344.000	
LTC PROPERTIES INC	9,600	331,872.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	70,100	978,596.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,928	5,673,937.920	
MACERICH CO/THE	42,279	730,158.330	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,700	3,763,151.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,900	729,946.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	44,300	2,102,921.000	
REALTY INCOME CORP	94,217	6,811,889.100	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28,500	806,835.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17,000	35,530.000	
PUBLIC STORAGE	38,400	12,701,184.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5,100	815,439.000	
REGENCY CENTERS CORP	39,820	2,761,118.800	
RPT REALTY	21,100	274,933.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	26,300	458,146.000	
SL GREEN REALTY CORP	17,557	1,232,501.400	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57,500	213,900.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	7,600	145,616.000	
UDR INC	74,800	4,141,676.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,100	179,521.000	
WP CAREY INC	44,900	3,561,019.000	
WASHINGTON REIT	21,600	552,744.000	

AGREE REALTY CORP	17,400	1,298,214.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	59,448	2,010,531.360	
CUBESMART	50,800	2,786,380.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	56,326	664,646.800	
DIGITAL REALTY TRUST INC	71,078	11,912,672.800	
EXTRA SPACE STORAGE INC	33,700	6,528,027.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	73,710.000	
CENTERSPACE	3,360	352,531.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	20,550	427,029.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	24,900	473,100.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,633	116,001.690	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	34,800	1,809,252.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,800	199,672.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	51,342	455,916.960	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	148,300	3,210,695.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	93,030.000	
DOUGLAS EMMETT INC	41,700	1,394,031.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	54,400	732,224.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	364,562	266,130.260	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	193,400	149,885.000	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	6,165.000	
PRIME US REIT	99,000	84,645.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 304,165,731.540 (33,391,314,009)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
HOME REIT PLC	60,000	300.000	
ASSURA PLC	668,520	520,777.080	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159,570	154,463.760	
STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	69,500.000	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	140,213.190	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	146,110	139,535.050	
REGIONAL REIT LTD	111,310	100,401.620	
NEWRIVER REIT PLC	69,330	54,493.380	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	211,290	371,870.400	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155,490	158,599.800	
CUSTODIAN REIT PLC	109,420	104,824.360	
GCP STUDENT LIVING PLC	112,860	239,263.200	

	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	90,900	105,080.400	
	LXI REIT PLC	163,188	240,539.110	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98,200	102,913.600	
	AEW UK REIT PLC	49,610	53,181.920	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	201,120	193,075.200	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	207,000	244,260.000	
	HOME REIT PLC	60,000	68,400.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	188,731	1,381,510.920	
	SEGRO PLC	301,710	3,881,499.150	
	HAMMERSON PLC	1,076,984	373,282.650	
	UNITE GROUP PLC/THE	102,490	1,252,940.250	
	BRITISH LAND CO PLC	235,590	1,265,118.300	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	63,371	497,462.350	
	DERWENT LONDON PLC	28,170	1,071,023.400	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	346,370	576,706.050	
	WORKSPACE GROUP PLC	32,260	303,889.200	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	52,650	620,743.500	
	SHAFTESBURY PLC	75,770	483,033.750	
	BIG YELLOW GROUP PLC	41,360	644,802.400	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	237,150	615,641.400	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	63,232.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	444,740	1,053,144.320	
	イギリス・ボンド 小計		イギリス・ボンド 17,145,721.710 (2,606,321,157)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	48,840	934,309.200	イスラエル・シュケル
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 934,309.200 (32,012,517)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	275,130	2,930,134.500	オーストラリア・ドル
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93,380	356,711.600	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	485,284	424,623.500	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	120,890	488,395.600	
	AVENTUS GROUP	103,000	352,260.000	
	RURAL FUNDS GROUP	108,595	284,518.900	
	WAYPOINT REIT	215,830	610,798.900	

	CHARTER HALL LONG WALE REIT	149,458	801,094.880	
	CENTURIA OFFICE REIT	105,950	274,410.500	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	155,880	540,903.600	
	IRONGATE GROUP	149,630	219,956.100	
	HOME CONSORTIUM	48,000	347,520.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	130,340	213,757.600	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	276,860	753,059.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70,547	307,584.920	
	NATIONAL STORAGE REIT	288,195	691,668.000	
	APN INDUSTRIA REIT	42,760	165,053.600	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	149,205.100	
	SCENTRE GROUP	1,331,650	3,888,418.000	
	ARENA REIT	93,890	399,032.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	137,114.000	
	BWP TRUST	123,870	511,583.100	
	GPT GROUP	493,390	2,462,016.100	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	130,400	507,256.000	
	MIRVAC GROUP	1,009,470	3,119,262.300	
	STOCKLAND	611,970	2,827,301.400	
	ABACUS PROPERTY GROUP	107,930	382,072.200	
	GOODMAN GROUP	431,720	10,067,710.400	
	VICINITY CENTRES	1,017,460	1,816,166.100	
	CHARTER HALL GROUP	119,320	2,172,817.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	76,660	495,223.600	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 38,697,629.400 (3,165,466,085)	
カナダ・ドル	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,100	196,308.000	カナダ・ドル
	SLATE GROCERY REIT	7,000	95,480.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14,700	319,725.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	27,183.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	98,490.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	23,400	313,326.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	20,600	444,548.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	83,888.000	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	10,800	293,544.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	53,300.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,500	782,255.000	

	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	24,800	417,880.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,500	309,575.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	27,600	500,112.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	41,100	626,364.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	74,970.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,100	253,095.000	
	PLAZA RETAIL REIT	11,100	50,838.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	18,000	551,160.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	21,700	1,348,655.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	235,114.100	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	36,066	594,367.680	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	40,700	918,192.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,200	168,336.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,900	283,259.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12,300	225,705.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	16,000	691,520.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 9,957,189.780 (872,648,112)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	331,683	842,474.820	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	419,876	111,267.140	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	542,000	547,420.000	
	AIMS APAC REIT	119,000	190,400.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	201,800	101,909.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	748,190	1,144,730.700	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134,000	121,270.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208,900	185,921.000	
	EC WORLD REIT	57,000	46,170.000	
	IREIT GLOBAL	175,124	112,954.980	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	842,677	2,620,725.470	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	1,161,622	2,427,789.980	
	SUNTEC REIT	565,400	819,830.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	745,200	1,572,372.000	
	KEPPEL REIT	501,400	546,526.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	505,456	520,619.680	
	ESR-REIT	709,902	337,203.450	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	191,600	229,920.000	

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	347,776	820,751.360	
	STARHILL GLOBAL REIT	383,800	241,794.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	269,442	355,663.440	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	98,300	481,670.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,214,720	72,883.200	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	496,469	1,444,724.790	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	354,500	319,050.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	560,184	1,165,182.720	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248,100	152,581.500	
	SPH REIT	275,600	261,820.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	99,827.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	651,063	286,467.720	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 18,181,919.950 (1,488,190,148)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	224,470	388,333.100	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	392,920	463,645.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	102,920	331,917.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	299,220	761,514.900	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	328,820	565,570.400	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 2,510,981.000 (197,086,898)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	42,190	692,759.800	ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	17,280	164,021.760	
	WERELDHAVE NV	8,970	117,955.500	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,950	2,310,783.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	9,887	207,824.740	
	NSI NV	4,131	145,824.300	
	VASTNED RETAIL NV	4,700	110,920.000	
	ICADE	7,390	528,015.500	
	CARMILA	11,800	139,712.000	
	ALTAREA	890	180,225.000	
	GECINA SA	12,931	1,654,521.450	
	KLEPIERRE	49,310	1,015,292.900	
	COVIVIO	11,902	912,407.320	
MERCIALYS	8,630	82,848.000		

	AEDIFICA	8,516	1,031,287.600	
	COFINIMMO	7,190	991,501.000	
	BEFIMMO	6,570	230,607.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	5,480	137,548.000	
	RETAIL ESTATES	2,540	173,990.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	32,350	1,256,474.000	
	CARE PROPERTY INVEST	6,100	171,410.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,580	237,702.000	
	MONTEA NV	2,500	312,500.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,240	51,305.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,530	79,188.500	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	60,133	525,261.750	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	79,000	777,202.000	
	CROMWELL REIT EUR	70,920	185,101.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102,050	159,198.000	
	HIBERNIA REIT PLC	159,240	202,234.800	
ユーロ 小計			ユーロ 14,785,622.620 (1,928,340,902)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	49,260,000.000	韓国・ウォン
	LOTTE REIT CO LTD	34,375	194,562,500.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17,960	84,412,000.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	31,304,000.000	
	JR REIT XXVII	25,500	135,405,000.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8,500	53,125,000.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27,000	179,280,000.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 727,348,500.000 (68,952,637)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398,000	1,611,900.000	香港・ドル
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250,000	1,250,000.000	
	FORTUNE REIT	378,000	3,137,400.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	939,000.000	
	LINK REIT	540,700	38,362,665.000	
	CHAMPION REIT	481,000	2,135,640.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 47,436,605.000 (669,804,863)	

投資証券 合計		44,420,137,328 [44,420,137,328]	
合計		44,985,140,737 [44,985,140,737]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄 投資証券 153銘柄	1.7%	98.3%	75.5%
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-%	100%	5.8%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	7.0%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	3.3%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 30銘柄	-%	100%	4.3%
韓国・ウォン	投資証券 7銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.5%

## 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（2021年9月8日から2022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 2022年3月7日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	433,665,651
親投資信託受益証券	36,827,905,786
流動資産合計	37,261,571,437
資産合計	37,261,571,437
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	12,716,693
未払受託者報酬	3,994,682
未払委託者報酬	39,947,275
その他未払費用	1,092,743
流動負債合計	57,751,393
負債合計	57,751,393
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 26,786,889,393
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,416,930,651
（分配準備積立金）	5,384,651,074
元本等合計	37,203,820,044
純資産合計	37,203,820,044
負債純資産合計	37,261,571,437

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年9月8日 至 2022年3月7日
<b>営業収益</b>	
受取利息	71
有価証券売買等損益	1,971,665,527
その他収益	378
<b>営業収益合計</b>	<b>1,971,665,078</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	47,780
受託者報酬	3,994,682
委託者報酬	39,947,275
その他費用	1,092,743
<b>営業費用合計</b>	<b>45,082,480</b>
営業利益又は営業損失( )	2,016,747,558
経常利益又は経常損失( )	2,016,747,558
中間純利益又は中間純損失( )	2,016,747,558
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	13,057,642
期首剰余金又は期首欠損金( )	10,970,215,271
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,055,587,032
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,055,587,032
剰余金減少額又は欠損金増加額	605,181,736
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	605,181,736
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,416,930,651

## (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 2021年9月8日 至 2022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 2022年3月7日現在
1. 1 期首元本額	23,584,320,551円
期中追加設定元本額	4,505,009,217円
期中一部解約元本額	1,302,440,375円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	26,786,889,393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 2021年9月8日 至 2022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 2022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 2022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 2022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)	1,3889円 (13,889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

	2022年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	

流動資産		
コール・ローン		13,374,343,343
株式	2 3	171,889,656,350
未収配当金		278,213,314
未収利息		712,057
前払金		87,501,900
その他未収収益	4	39,735,602
流動資産合計		185,670,162,566
資産合計		185,670,162,566
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		154,769,050
未払金		3,718,429,689
未払解約金		46,067,810
受入担保金		7,773,080,910
流動負債合計		11,692,347,459
負債合計		11,692,347,459
純資産の部		
元本等		
元本	1	142,034,314,911
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		31,943,500,196
元本等合計		173,977,815,107
純資産合計		173,977,815,107
負債純資産合計		185,670,162,566

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 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> <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、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	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	138,110,552,502円
期中追加設定元本額	11,677,948,628円
期中一部解約元本額	7,754,186,219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	2,975,401,949円
ファンド	

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	5,316,415,372円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	922,564円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	24,770,708円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	365,759,507円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	21,795,176円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	680,293,332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)	306,315,206円
D-I's TOPIXイン デックス	43,606,847円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	175,296,257円
iFree TOPIXイン デックス	5,422,200,111円
iFree 8資産バランス	3,632,019,791円
iFree 年金バランス	623,172,989円
DCダイワ日本株式インデッ クス	67,786,344,207円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,183,313,188円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,437,114,627円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,323,256,452円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,143,153,719円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	60,912,572円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	61,222,995円

ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,794,015,208円
ダイワつみたてインデックス バランス30	11,405,521円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,104,336円
ダイワつみたてインデックス バランス70	21,381,125円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	859,218円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	105,724,177円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	125,074,476円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,813,286,212円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	523,671,011円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	73,437,877円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	137,284,503円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	228,203,944円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,904,019,234円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,823,853,078円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,755,096,470円
ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,197,308,521円
ダイワライフスタイル25	152,194,609円
ダイワライフスタイル50	602,691,384円
ダイワライフスタイル75	460,701,579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)	9,710,714,859円

計		142,034,314,911円
2.	期末日における受益権の総数	142,034,314,911口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,064,816,600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 827,280,000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38,789,350円が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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

## 株式関連

種 類	2022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	2,179,101,900	-	2,024,395,000	154,706,900
合計	2,179,101,900	-	2,024,395,000	154,706,900

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2022年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.2249円
(1万口当たり純資産額)	(12,249円)

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年3月7日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	611,223,468
コール・ローン	4,237,503,222
株式	226,759,743,552
投資証券	5,915,001,934
派生商品評価勘定	18,764,666
未収入金	36,400,813
未収配当金	322,366,844
差入委託証拠金	4,554,762,807

流動資産合計		242,455,767,306
資産合計		242,455,767,306
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		572,236,157
未払解約金		9,795,400
流動負債合計		582,031,557
負債合計		582,031,557
純資産の部		
元本等		
元本	1	63,280,370,411
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		178,593,365,338
元本等合計		241,873,735,749
純資産合計		241,873,735,749
負債純資産合計		242,455,767,306

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	60,251,266,888円
期中追加設定元本額	6,733,266,130円
期中一部解約元本額	3,704,162,607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	358,916,450円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	4,236,578円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	51,568,512円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	7,268,163円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	221,399,443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)	45,954,963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)	515,996,140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)	2,582,961,261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)	513,605,747円
D-I's 外国株式インデッ クス	15,471,461円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	37,579,659円

i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	4,627,388,376円
i F r e e 8資産バランス	1,189,863,361円
i F r e e 年金バランス	204,859,812円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	39,670,726,029円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	525,795,394円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	976,495,645円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	790,210,106円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,760,680,816円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	13,699,259円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	11,193,708円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	907,372,639円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	1,874,595円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	2,224,784円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	3,917,720円
ダイワ先進国株式インデック ス(為替ヘッジなし)(投資 一任専用)	246,621円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	103,419,999円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	203,924,025円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	1,417,677,495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)	72,955,779円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	194,296,563円

ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	188,669,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,017,486,845円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	360,472,057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）	1,808,690,235円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,771,384,851円
ダイワライフスタイル25	12,507,667円
ダイワライフスタイル50	49,480,354円
ダイワライフスタイル75	37,898,253円
計	63,280,370,411円
2. 期末日における受益権の総数	63,280,370,411口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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	2022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	9,613,300,335	-	9,095,957,261	517,343,074
合計	9,613,300,335	-	9,095,957,261	517,343,074

## (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	2022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	4,215,655,117	-	4,179,526,700	36,128,417
アメリカ・ドル	2,327,342,690	-	2,321,788,000	5,554,690
イギリス・ポンド	174,533,552	-	171,567,900	2,965,652
オーストラリア・ドル	265,150,329	-	269,418,300	4,267,971
カナダ・ドル	261,670,642	-	259,948,800	1,721,842
スイス・フラン	286,497,835	-	285,205,200	1,292,635
ユーロ	900,460,069	-	871,598,500	28,861,569
合計	4,215,655,117	-	4,179,526,700	36,128,417

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2022年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.8223円
(1万口当たり純資産額)	(38,223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

	2022年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	391,670,545
コール・ローン	191,167,073
株式	14,732,121,310
投資証券	1,827,010,806
派生商品評価勘定	6,739

未収配当金		24,461,490
差入委託証拠金		109,064,879
流動資産合計		17,275,502,842
資産合計		17,275,502,842
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		54,605,170
未払解約金		1,404,295
流動負債合計		56,009,465
負債合計		56,009,465
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,539,463,151
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,680,030,226
元本等合計		17,219,493,377
純資産合計		17,219,493,377
負債純資産合計		17,275,502,842

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	8,253,886,066円
期中追加設定元本額	1,553,687,984円
期中一部解約元本額	268,110,899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）	620,539,930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	1,249,735,569円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	357,680,108円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	88,970,548円
計	9,539,463,151円
2. 期末日における受益権の総数	9,539,463,151口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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	2022年3月7日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
市場取引		うち 1年超	

株価指数 先物取引				
買 建	633,995,415	-	579,390,245	54,605,170
合計	633,995,415	-	579,390,245	54,605,170

(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	2022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	113,898,801	-	113,905,540	6,739
アメリカ・ドル	113,898,801	-	113,905,540	6,739
合計	113,898,801	-	113,905,540	6,739

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.8051円
(1万口当たり純資産額)	(18,051円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	153,704,499
国債証券	33,903,204,040
地方債証券	1,558,775,700
特殊債券	832,514,000
社債券	1,321,090,400
未収利息	76,549,102
前払費用	2,586,120
流動資産合計	37,848,423,861
資産合計	37,848,423,861
負債の部	
流動負債	

未払解約金		5,426,482
流動負債合計		5,426,482
負債合計		5,426,482
純資産の部		
元本等		
元本	1	29,590,556,979
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,252,440,400
元本等合計		37,842,997,379
純資産合計		37,842,997,379
負債純資産合計		37,848,423,861

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	25,844,711,462円
期中追加設定元本額	4,028,045,828円
期中一部解約元本額	282,200,311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（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	914,762,659円
i F r e e 日本債券イン デックス	3,756,240,708円
i F r e e 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,730,891,535円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	8,850,236,559円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	6,041,546,447円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,957,323,153円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	1,432,985,885円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	1,096,516,923円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	400,390,446円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	897,084,518円
ダイワつみたてインデックス バランス30	31,896,300円
ダイワつみたてインデックス バランス50	13,801,782円
ダイワつみたてインデックス バランス70	9,742,744円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	267,369,719円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	189,767,601円
計	29,590,556,979円
2. 期末日における受益権の総数	29,590,556,979口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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)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

2022年3月7日現在	
該当事項はありません。	

（1口当たり情報）

2022年3月7日現在	
1口当たり純資産額	1.2789円
（1万口当たり純資産額）	（12,789円）

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

2022年3月7日現在	
金額（円）	
資産の部	
流動資産	
預金	1,719,815,311
コール・ローン	978,244,180
国債証券	227,379,843,250
派生商品評価勘定	2,847
未収利息	1,207,438,826
前払費用	46,752,699
流動資産合計	231,332,097,113
資産合計	
231,332,097,113	
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定		5,510,006
未払金		1,145,677,173
未払解約金		33,910,542
流動負債合計		1,185,097,721
負債合計		1,185,097,721
純資産の部		
元本等		
元本	1	75,530,763,357
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		154,616,236,035
元本等合計		230,146,999,392
純資産合計		230,146,999,392
負債純資産合計		231,332,097,113

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	73,446,052,175円
期中追加設定元本額	4,868,666,643円
期中一部解約元本額	2,783,955,461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)	539,149,841円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,334,455,324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)	860,578,294円
D-I's 外国債券インデッ クス	822,176円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	8,024,249円
iFree 外国債券イン デックス	1,939,334,715円
iFree 8資産バランス	1,546,823,643円
iFree 年金バランス	258,220,820円
DCダイワ外国債券インデッ クス	50,076,017,640円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,006,763,498円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	627,686,222円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	407,126,472円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	595,394,377円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	455,935,579円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	166,465,964円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	30,697,722円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	10,619,564円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	824,715,049円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,616,304円

ダイワつみたてインデックス バランス50	1,427,112円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,014,440円
ダイワ先進国債券インデック ス(為替ヘッジなし)(ラッ プ専用)	326,608円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	156,521,044円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	132,252,874円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,732,994,507円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	227,054,760円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	144,648,515円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	45,594,510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)	2,434,596,829円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,739,535,190円
ダイワライフスタイル25	32,117,694円
ダイワライフスタイル50	64,214,125円
ダイワライフスタイル75	16,185,373円
計	75,530,763,357円
2. 期末日における受益権の総数	75,530,763,357口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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	2022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	911,558,090	-	906,050,931	5,507,159
アメリカ・ドル	817,404,042	-	813,908,549	3,495,493
イギリス・ポンド	11,373,267	-	11,235,679	137,588
ユーロ	82,780,781	-	80,906,703	1,874,078
合計	911,558,090	-	906,050,931	5,507,159

#### （注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧

客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2022年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.0471円
(1万口当たり純資産額)	(30,471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

	2022年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	489,166,199
コール・ローン	146,178,000
国債証券	21,317,160,669
派生商品評価勘定	336,000
未収利息	309,197,895
前払費用	32,272,589
流動資産合計	22,294,311,352
資産合計	22,294,311,352
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,153,858
未払金	251,332,246
未払解約金	16,340,400
流動負債合計	270,826,504
負債合計	270,826,504
純資産の部	
元本等	

元本	1	16,627,563,249
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,395,921,599
元本等合計		22,023,484,848
純資産合計		22,023,484,848
負債純資産合計		22,294,311,352

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	15,130,772,827円
期中追加設定元本額	1,848,589,153円
期中一部解約元本額	351,798,731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)	210,220,092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)	286,807,402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)	456,157,299円
D-I's 新興国債券インデックス	58,017,128円
iFree 新興国債券インデックス	4,691,188,700円
iFree 8資産バランス	3,325,175,397円
ダイワ新興国債券インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	680,268円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	7,420,856,225円

ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	145,958,814円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	32,501,924円
計	16,627,563,249円
2. 期末日における受益権の総数	16,627,563,249口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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	2022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				
売 建	128,336,000	-	128,000,000	336,000
インドネシア・ルピア	128,336,000	-	128,000,000	336,000

買 建	91,802,495	-	88,648,637	3,153,858
メキシコ・ペ ソ	21,826,060	-	21,282,250	543,810
ルーマニア ・レイ	69,976,435	-	67,366,387	2,610,048
合計	220,138,495	-	216,648,637	2,817,858

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2022年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.3245円
(1万口当たり純資産額)	(13,245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

	2022年3月7日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	

コール・ローン		5,899,773,190
投資証券	2	409,253,545,100
未収配当金		5,245,053,778
前払金		624,400,000
流動資産合計		421,022,772,068
資産合計		421,022,772,068
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		61,656,000
未払金		1,114,072,976
未払解約金		53,791,000
流動負債合計		1,229,519,976
負債合計		1,229,519,976
純資産の部		
元本等		
元本	1	133,248,706,206
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		286,544,545,886
元本等合計		419,793,252,092
純資産合計		419,793,252,092
負債純資産合計		421,022,772,068

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	138,556,634,922円
期中追加設定元本額	9,850,242,890円
期中一部解約元本額	15,158,171,606円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - REITオープン	4,717,560,633円
ダイワJ - REITオープン	116,744,113,490円
(毎月分配型)	
ダイワJ - REITオープン	347,305,182円
(年1回決算型)	
DCダイワ・ターゲットイ	10,876,538円
ヤー2050	
iFree J - REITイン	615,118,619円
デックス	
iFree 8資産バランス	1,496,679,924円
DC・ダイワJ - REIT	5,338,827,950円
オープン	
DCダイワ・ターゲットイ	6,471,390円
ヤー2030	
DCダイワ・ターゲットイ	5,144,574円
ヤー2040	
ダイワ国内REITインデッ	313,431円
クス(投資一任専用)	
ダイワ・ノーロード J - R	97,373,343円
EITファンド	
ダイワファンドラップ J -	2,070,099,624円
REITインデックス	

	ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	321,288,727円
	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	530,839,108円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	946,693,673円
計		133,248,706,206円
2.	期末日における受益権の総数	133,248,706,206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 5,235,750,000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	2022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	2022年3月7日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
市場取引		うち 1年超	

不動産投信 指数先物取引				
買 建	10,521,840,000	-	10,460,800,000	61,040,000
合計	10,521,840,000	-	10,460,800,000	61,040,000

## (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)

	2022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)	3.1504円 (31,504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

	2022年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	192,580,914
コール・ローン	490,231,792
投資信託受益証券	357,088,792
投資証券	46,409,913,164
派生商品評価勘定	203
未収入金	22,733,718
未収配当金	47,288,658

差入委託証拠金		389,150,941
流動資産合計		47,908,988,182
資産合計		47,908,988,182
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		81,370,387
未払金		49,775,256
未払解約金		94,500
流動負債合計		131,240,143
負債合計		131,240,143
純資産の部		
元本等		
元本	1	15,362,573,900
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		32,415,174,139
元本等合計		47,777,748,039
純資産合計		47,777,748,039
負債純資産合計		47,908,988,182

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月8日 至 2022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>
<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	2022年3月7日現在
1. 1 期首	2021年9月8日
期首元本額	15,069,273,862円
期中追加設定元本額	2,568,629,621円
期中一部解約元本額	2,275,329,583円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	6,451,741,609円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	1,154,078,788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)	285,648,071円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,640,316円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	9,587,535円
iFree 外国REITイ ンデックス	687,281,307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)	1,530,976,773円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	241,141,652円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	125,422,953円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	3,446,727,053円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	6,696,295円
ダイワ海外REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(投 資一任専用)	5,258,613円
	320,982円

ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	168,184,947円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	163,031,381円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	249,302,844円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	60,518,886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)	771,024,731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)	3,989,164円
計	15,362,573,900円
2. 期末日における受益権の総数	15,362,573,900口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年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. 不動産投信関連

種 類	2022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	1,165,862,679	-	1,086,483,298	79,379,381
合計	1,165,862,679	-	1,086,483,298	79,379,381

## (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	2022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  売 建	26,191,872	-	26,191,669	203
カナダ・ドル	26,191,872	-	26,191,669	203
買 建	593,172,458	-	591,181,452	1,991,006
アメリカ・ドル	567,305,058	-	566,171,452	1,133,606
ユーロ	25,867,400	-	25,010,000	857,400

合計	619,364,330	-	617,373,121	1,990,803
----	-------------	---	-------------	-----------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2022年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.1100円
(1万口当たり純資産額)	(31,100円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2022年3月31日

資産総額	40,882,772,536円
負債総額	57,899,478円
純資産総額（ - ）	40,824,873,058円
発行済数量	27,223,616,044口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4996円

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年3月31日

資産総額	200,743,714,619円
負債総額	9,196,404,465円
純資産総額（ - ）	191,547,310,154円
発行済数量	142,546,971,682口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3437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

2022年3月31日

資産総額	450,336,459,364円
負債総額	2,358,655,669円
純資産総額（ - ）	447,977,803,695円
発行済数量	133,211,504,659口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.3629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

2022年3月31日

資産総額	38,410,722,518円
負債総額	270,080,564円
純資産総額( - )	38,140,641,954円
発行済数量	30,023,550,963口
1単位当たり純資産額( / )	1.2704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

2022年3月31日

資産総額	19,575,144,865円
負債総額	21,880,457円
純資産総額( - )	19,553,264,408円
発行済数量	9,841,990,116口
1単位当たり純資産額( / )	1.9867円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2022年3月31日

資産総額	278,657,998,544円
負債総額	129,712,119円
純資産総額( - )	278,528,286,425円
発行済数量	63,699,560,968口
1単位当たり純資産額( / )	4.3725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

2022年3月31日

資産総額	29,200,949,352円
負債総額	392,992,796円
純資産総額( - )	28,807,956,556円

発行済数量	8,219,385,492口
1単位当たり純資産額( / )	3.5049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

2022年3月31日

資産総額	24,484,774,524円
負債総額	110,011,007円
純資産総額( - )	24,374,763,517円
発行済数量	16,923,653,073口
1単位当たり純資産額( / )	1.4403円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2022年3月31日

資産総額	238,408,574,400円
負債総額	522,535,226円
純資産総額( - )	237,886,039,174円
発行済数量	75,586,837,568口
1単位当たり純資産額( / )	3.1472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

2022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年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年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	66	208,634
追加型株式投資信託	781	21,485,357
株式投資信託 合計	847	21,693,991
単位型公社債投資信託	78	193,964
追加型公社債投資信託	14	1,434,851
公社債投資信託 合計	92	1,628,815
総合計	939	23,322,805

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

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

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

(追加情報)

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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

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

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

(注記に関する表示方法の変更)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

効力発生日

2021年6月23日

## （金融商品関係）

### 1．金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

##### 市場リスクの管理

##### （ ）為替変動リスクの管理

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

##### （ ）価格変動リスクの管理

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

##### 信用リスクの管理

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

### 2．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

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

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

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

#### 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

#### 2．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

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

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

#### ( 関連当事者情報 )

##### 1. 関連当事者との取引

###### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

###### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

## 前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

## 2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

（単位：百万円）

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

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

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2021年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	2	927

流動負債合計		13,635
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2

固定負債合計		2,571
--------	--	-------

## 負債合計

負債合計		16,206
------	--	--------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		15,174
-----	--	--------

## 資本剰余金

資本準備金		11,495
-------	--	--------

資本剰余金合計		11,495
---------	--	--------

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

## (2)中間損益計算書

(単位:百万円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

### （１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

### （２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

### （１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
----	--------

器具備品	4～20年
------	-------

### （２）無形固定資産

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

## 3．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

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

### （２）退職給付引当金

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

### （３）役員退職慰労引当金

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

## 4．収益及び費用の計上基準

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

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

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

#### 5. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

#### 6. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### 7. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

#### (会計方針の変更)

##### (収益認識に関する会計基準等の適用)

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

#### (中間貸借対照表関係)

##### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

##### 2 消費税等の取扱い

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

##### 3 保証債務

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

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

2 営業外収益の主要項目

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

3 営業外費用の主要項目

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

4 特別損失の項目

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「2019年適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

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

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

## 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年9月30日）

### 1．子会社株式及び関連会社株式

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

### 2．その他有価証券

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

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

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

## 〔セグメント情報等〕

## 〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

## 〔関連情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔1株当たり情報〕

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

1株当たり中間純利益

2,456.52円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

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

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

- ・ 監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

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

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	

販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	(注1)	
	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	株式会社 S B I 証券	48,323百万円	(注1)	
	岡三証券株式会社	5,000百万円	(注1)	
	O K B 証券株式会社	1,500百万円	(注1)	
	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	(注1)	
	京銀証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	G M O クリック証券株式会社	4,346百万円	(注1)	
	静岡東海証券株式会社	600百万円	(注1)	
	株式会社証券ジャパン	3,000百万円	(注1)	
	第四北越証券株式会社	600百万円	(注1)	
	立花証券株式会社	6,695百万円	(注1)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	百五証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	ほくほく T T 証券株式会社	1,250百万円	(注1)	
	松井証券株式会社	11,945百万円	(注1)	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	(注1)	
	むさし証券株式会社	5,000百万円	(注1)	
	楽天証券株式会社	7,495百万円	(注1)	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	(注1)	
	株式会社愛知銀行	18,000百万円	(注3)	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	(注3)	
	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	(注3)	
	株式会社沖縄銀行	22,725百万円	(注3)	
	株式会社香川銀行	12,000百万円	(注3)	
	株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	(注3)	
	株式会社北九州銀行	10,000百万円	(注3)	
	株式会社きらやか銀行	24,200百万円	(注3)	
	株式会社高知銀行	19,544百万円	(注3)	
	株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	(注3)	
株式会社静岡銀行	90,845百万円	(注3)		
株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	(注3)		
株式会社島根銀行	7,886百万円	(注3)		
株式会社清水銀行	10,816百万円	(注3)		
信金中央金庫	690,998百万円	(注4)		
株式会社新生銀行	512,204百万円	(注3)		

スルガ銀行株式会社	30,043百万円	(注3)	
全国信用協同組合連合会	111,875百万円	(注5)	
株式会社大東銀行	14,743百万円	(注3)	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	(注3)	
株式会社中京銀行	31,844百万円	(注3)	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	(注3)	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	(注3)	
株式会社徳島大正銀行	11,036百万円	(注3)	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	(注3)	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	(注3)	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	(注3)	
株式会社長野銀行	13,017百万円	(注3)	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	(注3)	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	(注3)	
株式会社百五銀行	20,000百万円	(注3)	
株式会社福井銀行	17,965百万円	(注3)	
株式会社福島銀行	18,682百万円	(注3)	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	(注3)	
株式会社みちのく銀行	36,986百万円	(注3)	
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	(注3)	
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	(注6)	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	(注3)	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	(注3)	
株式会社山口銀行	10,005百万円	(注3)	
PayPay銀行株式会社	37,250百万円	(注3)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

## 2【関係業務の概要】

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

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

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

### 3【資本関係】

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しています。

### 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みます。）を掲載することがあります。
- ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- ・ 「iFreeのポイント」を記載することがあります。

- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年10月8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 竹内 知明 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2020年9月8日から2021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2021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**

2021年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年4月8日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているiFree 8資産バランスの2021年9月8日から2022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、iFree 8資産バランスの2022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（2021年9月8日から2022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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。