ダイワ・ライフ・バランス30

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書（請求目論見書）

2025年2月27日

本文書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書（請求目論見書）です。

本文書にかかる「ダイワ・ライフ・バランス30」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2025年2月26日に関東財務局長に提出しており、2025年2月27日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

◇TSM0371320250227◇

第一部【証券情報】

⑴【ファンドの名称】

ダイワ・ライフ・バランス３０

⑵【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。

⑶【発行（売出）価額の総額】

5,000 億円を上限とします。

⑷【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/

⑸【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。

⑹【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

⑺【申込期間】

2025 年 2 月 27 日から 2025 年 8 月 29 日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

⑻【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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）	補足分類
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（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・	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

追加型		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・		「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・

	ファンズ	オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	ＴＯＰＩＸ	目論見書等において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

＜信託金の限度額＞

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

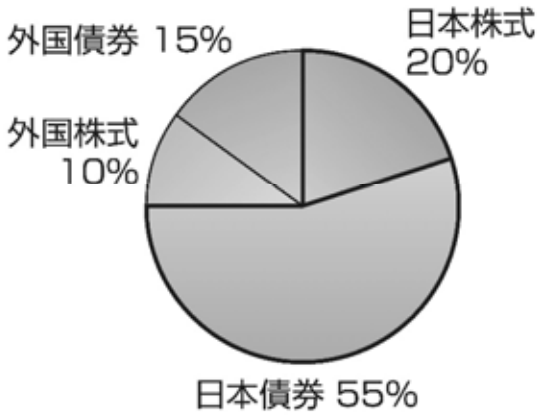
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国　内	海　外	合　計
株　式	20%	10%	30%
債　券	55%	15%	70%
合　計	75%	25%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

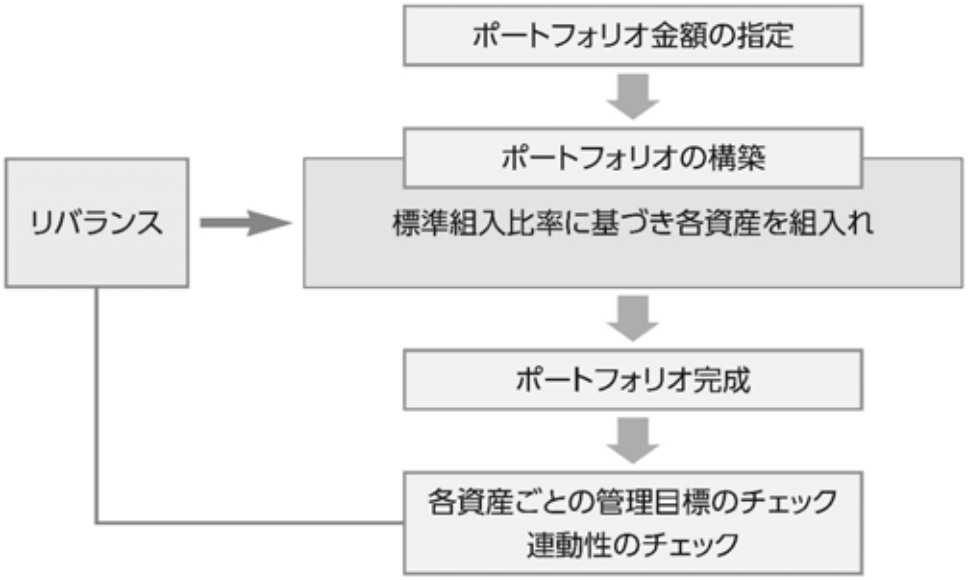
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

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

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

3 毎年6月5日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。
　ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

●外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

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

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは
　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。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。
　配当込み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。

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

（注1）リスクモデルとは…
債券のリターンを、国債イールドカーブの変化、種別スプレッドの変化、個別銘柄独自の変化など、リターンに共通の影響を与える複数の要素に分解して説明可能とする計量モデルです。当ファンドでは、NOMURA-BPI総合指数に連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

（注2）層化抽出法とは…
ポートフォリオを残存期間やセクターなどの特性値で分類し、各グループの構成比をベンチマークの構成比に近づけることをめざす手法です。

NOMURA-BPI総合指数とは

NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表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の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等ならびに当ファンドおよび同指数に関連して行なわれる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

3．外国株式インデックスマザーファンド

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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

4．外国債券インデックスマザーファンド

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

(2)【ファンドの沿革】

2005年6月6日　　信託契約締結、当初設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）、内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）、外国の株式（預託証書を含みます。）、外国の公社債　など（ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

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

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

＜委託会社の概況（2024 年 12 月末日現在）＞

・資本金の額　414 億 2,454 万 1,896 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
2024年10月 1日	株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目 9 番 1 号	2,608,525	80.00
		株	%
株式会社かんぽ生命保険	東京都千代田区大手町二丁目 3 番 1 号	652,132	20.00

２【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

※　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（配当込み））

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
（ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース））

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
（FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

②　投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の 20%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券：信託財産の純資産総額の 55%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の 10%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の 15%

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

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

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

(a)投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
5. 株券または新株引受権証書
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの
17. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
18. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの

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

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

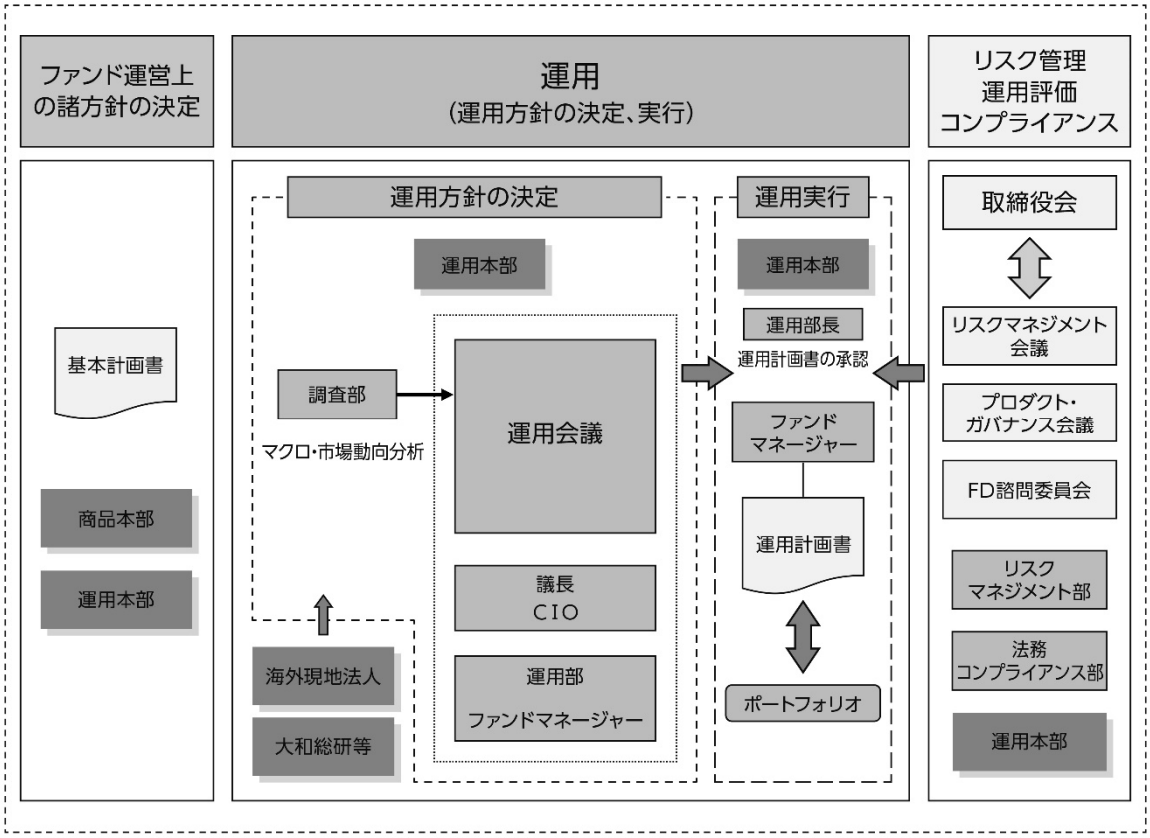
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1 名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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10～20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．プロダクト・ガバナンス会議

経営会議の分科会として、運用状況・商品性およびこれらの開示の適切性について検証結果の報告を行ない、対応方針を審議・決定したうえでその実行状況を確認します。加えて、その他当社が運用するプロダクトの品質の維持・向上に関する事項の審議・決定・報告を行ないます。

ハ．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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2024年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

②　原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

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

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③ 投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥ 信用取引（信託約款）

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

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

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

3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前 5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦ 先物取引等（信託約款）

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

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

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

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

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の 1. から 4. までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商

品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

⑧ スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 50 を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 50 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産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。

⑭　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。

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　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。

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 基本的な投資態度

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

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

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

ロ．ポートフォリオは、東証株価指数（配当込み）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（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

２．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 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。

② 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

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　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。

⑤　スワップ取引

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

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

はこの限りではありません。

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものを

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

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

(3) 主な投資制限
① 株式への投資割合には、制限を設けません。
② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針
① 主要投資対象
外国の公社債を主要投資対象とします。
② 投資態度
イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本としま

す。

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

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

(2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前 1. から前 11. までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前 20. の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取

引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、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。

② 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。

③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

なお、当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避す

るための為替ヘッジは行ないません。このため、当ファンドの基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

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

④　その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

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

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

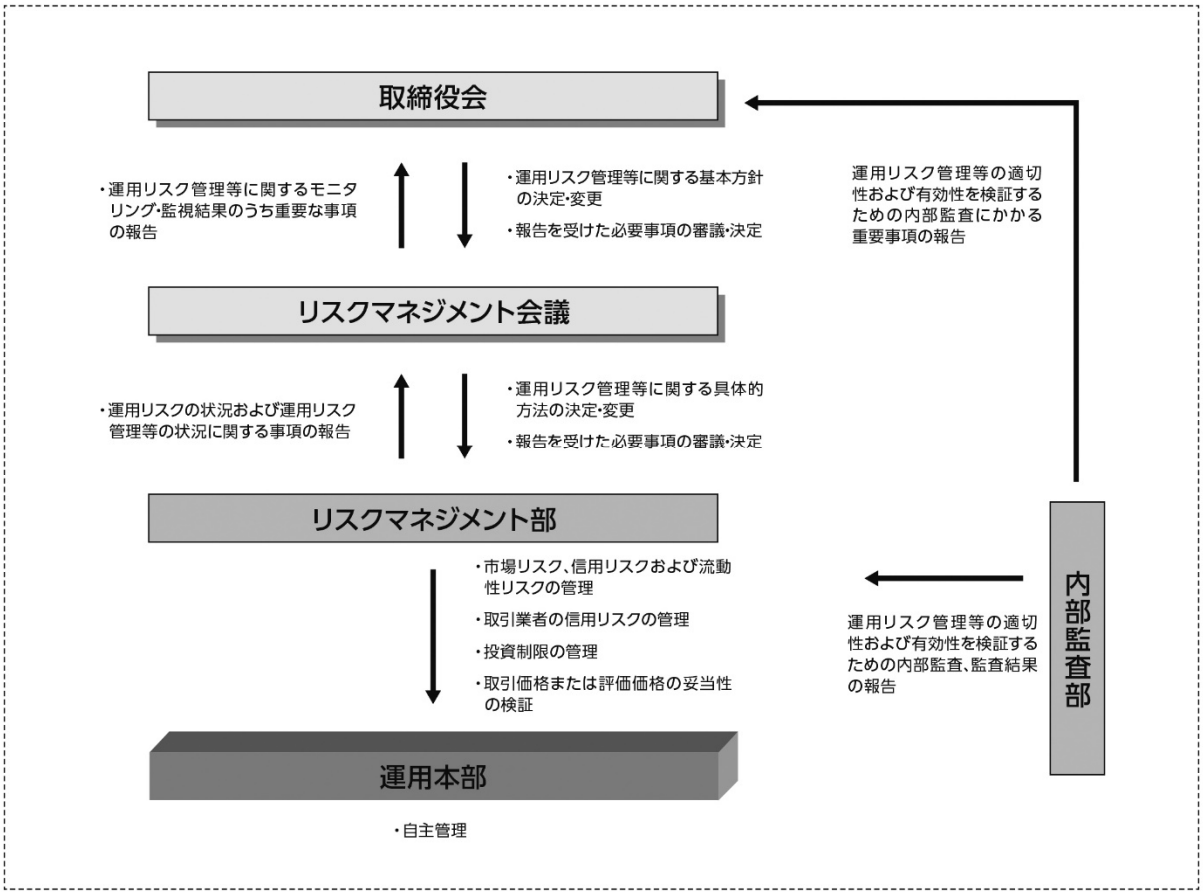
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

・　委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。

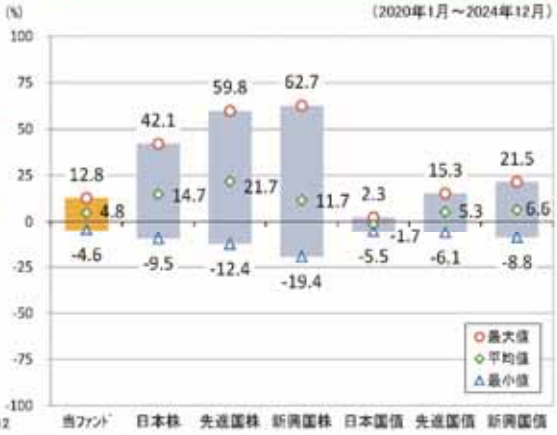
・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

※指数について
●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。【https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html】●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.198%（税抜 0.18%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.07%（税抜）	年率 0.08%（税抜）	年率 0.03%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属

する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にＮＩＳＡの適用対象となります。

当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

② 法人の投資者に対する課税

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

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

＜注 1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注 2＞収益分配金の課税について

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

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

（※）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
（※）上記は、2024 年 12 月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2024 年 12 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		29,728,654,037	99.70
	内 日本	29,728,654,037	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		88,300,310	0.30
純資産総額		29,816,954,347	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】 (2024 年 12 月 30 日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	13,471,143,073	1.1942 16,087,368,019	1.1916 16,052,214,085	53.84
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,968,184,707	1.9939 5,918,385,339	2.0481 6,079,139,098	20.39
3	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	1,194,574,765	3.6790 4,394,910,858	3.7621 4,494,109,723	15.07
4	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	428,735,995	6.4520 2,766,233,604	7.2380 3,103,191,131	10.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.70%
合計	99.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10計算期間末 (2015年6月5日)	8,454,565,041	8,454,565,041	1.5046	1.5046
第11計算期間末 (2016年6月6日)	9,718,025,934	9,718,025,934	1.4562	1.4562
第12計算期間末 (2017年6月5日)	11,222,055,163	11,222,055,163	1.5385	1.5385
第13計算期間末 (2018年6月5日)	13,026,301,702	13,026,301,702	1.6003	1.6003
第14計算期間末 (2019年6月5日)	14,072,433,495	14,072,433,495	1.5859	1.5859
第15計算期間末 (2020年6月5日)	15,530,358,611	15,530,358,611	1.6516	1.6516
第16計算期間末 (2021年6月7日)	18,546,912,272	18,546,912,272	1.7945	1.7945
第17計算期間末 (2022年6月6日)	21,413,908,388	21,413,908,388	1.8071	1.8071
第18計算期間末 (2023年6月5日)	24,597,288,125	24,597,288,125	1.8839	1.8839
2023年12月末日	26,705,284,949	－	1.9344	－
2024年1月末日	27,329,031,054	－	1.9734	－
2月末日	27,973,139,284	－	2.0102	－
3月末日	28,605,630,987	－	2.0396	－
4月末日	28,530,309,104	－	2.0316	－
5月末日	28,638,582,386	－	2.0256	－
第19計算期間末 (2024年6月5日)	28,658,333,052	28,658,333,052	2.0276	2.0276
6月末日	29,394,069,316	－	2.0579	－
7月末日	29,068,009,747	－	2.0303	－
8月末日	28,947,921,329	－	2.0196	－
9月末日	28,983,397,381	－	2.0190	－
10月末日	29,570,589,265	－	2.0487	－
11月末日	29,296,678,074	－	2.0335	－
12月末日	29,816,954,347	－	2.0662	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
第 12 計算期間	0.0000
第 13 計算期間	0.0000
第 14 計算期間	0.0000
第 15 計算期間	0.0000
第 16 計算期間	0.0000
第 17 計算期間	0.0000
第 18 計算期間	0.0000
第 19 計算期間	0.0000
2024 年 6 月 6 日～ 2024 年 12 月 5 日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 10 計算期間	12.8
第 11 計算期間	△3.2
第 12 計算期間	5.7
第 13 計算期間	4.0
第 14 計算期間	△0.9
第 15 計算期間	4.1
第 16 計算期間	8.7
第 17 計算期間	0.7
第 18 計算期間	4.2
第 19 計算期間	7.6
2024 年 6 月 6 日～ 2024 年 12 月 5 日	0.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 10 計算期間	831,794,916	828,193,384
第 11 計算期間	1,838,391,481	783,789,547
第 12 計算期間	1,530,048,110	909,776,924
第 13 計算期間	1,687,964,003	842,013,940
第 14 計算期間	1,656,062,300	922,499,442
第 15 計算期間	1,724,540,656	1,194,566,590
第 16 計算期間	2,234,492,064	1,302,806,211
第 17 計算期間	2,805,049,493	1,290,489,988
第 18 計算期間	2,534,773,978	1,327,571,993
第 19 計算期間	2,844,164,776	1,767,299,812
2024 年 6 月 6 日～ 2024 年 12 月 5 日	1,174,206,588	886,811,655

（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（2024 年 12 月 30 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		409,408,926,410	98.05
	内　日本	409,408,926,410	98.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		8,135,524,843	1.95
純資産総額		417,544,451,253	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)		7,885,795,000	1.89
	内　日本	7,885,795,000	1.89

(注 1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注 2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
(注 3) 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（2024 年 12 月 30 日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	5,475,100	2,614.96 14,317,206,091	3,146.00 17,224,664,600	4.13
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,606,800	2,660.14 9,594,618,914	3,369.00 12,151,309,200	2.91
3	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	6,507,000	1,472.17 9,579,455,766	1,846.00 12,011,922,000	2.88
4	日　立	日本	株式	電気機器	2,678,700	3,698.65 9,907,589,002	3,937.00 10,546,041,900	2.53
5	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	826,100	9,284.68 7,670,075,400	11,145.00 9,206,884,500	2.21
6	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	2,116,100	3,021.75 6,394,328,172	3,764.00 7,965,000,400	1.91
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	103,000	67,273.86 6,929,208,002	64,630.00 6,656,890,000	1.59
8	任 天 堂	日本	株式	その他製品	650,200	7,726.52 5,023,788,446	9,264.00 6,023,452,800	1.44

	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 (%)
9	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	732,500	7,670.91 5,618,945,172	7,832.00 5,736,940,000	1.37
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	990,400	5,229.36 5,179,159,357	5,728.00 5,673,011,200	1.36
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,369,200	2,881.87 3,945,857,046	3,873.00 5,302,911,600	1.27
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,601,100	2,952.90 4,727,902,127	3,311.00 5,301,242,100	1.27
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	218,000	23,096.03 5,034,934,623	24,185.00 5,272,330,000	1.26
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,014,000	2,874.32 5,788,881,262	2,604.00 5,244,456,000	1.26
15	信越化学	日本	株式	化学	925,100	5,754.48 5,323,474,405	5,296.00 4,899,329,600	1.17
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	30,726,100	150.32 4,618,884,547	158.00 4,854,723,800	1.16
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	509,600	8,455.19 4,308,768,959	9,185.00 4,680,676,000	1.12
18	第一三共	日本	株式	医薬品	974,900	4,939.02 4,815,051,829	4,352.00 4,242,764,800	1.02
19	三菱重工業	日本	株式	機械	1,819,100	1,887.13 3,432,895,554	2,223.00 4,043,859,300	0.97
20	HOYA	日本	株式	精密機器	201,200	19,309.43 3,885,058,431	19,815.00 3,986,778,000	0.95
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	919,100	4,259.69 3,915,088,494	4,181.00 3,842,757,100	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	759,800	4,819.52 3,661,874,722	5,042.00 3,830,911,600	0.92
23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,440,300	1,537.30 3,751,478,321	1,535.00 3,745,860,500	0.90
24	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	61,300	46,295.58 2,837,919,286	53,820.00 3,299,166,000	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	16,532,600	197.23 3,260,784,168	198.90 3,288,334,140	0.79
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,203,800	2,180.17 2,624,496,192	2,487.00 2,993,850,600	0.72
27	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	324,600	6,563.78 2,130,603,490	9,198.00 2,985,670,800	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,058,100	2,266.72 2,398,426,554	2,687.00 2,843,114,700	0.68
29	富 士 通	日本	株式	電気機器	957,200	2,914.77 2,790,024,240	2,799.50 2,679,681,400	0.64
30	キヤノン	日本	株式	電気機器	513,700	4,759.83 2,445,127,571	5,161.00 2,651,205,700	0.63

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.05%
合計	98.05%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.24%
建設業	2.11%
食料品	2.99%
繊維製品	0.40%
パルプ・紙	0.13%
化学	5.05%
医薬品	4.26%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.56%
ガラス・土石製品	0.65%
鉄鋼	0.80%
非鉄金属	0.82%
金属製品	0.48%
機械	5.45%
電気機器	17.28%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.35%
その他製品	2.61%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	2.20%
海運業	0.68%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.33%
卸売業	6.68%
小売業	4.51%
銀行業	8.39%
証券、商品先物取引業	0.87%
保険業	3.22%
その他金融業	1.18%
不動産業	1.73%
サービス業	5.04%
合計	98.05%

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX　先物 0703 月	買建	283	7,766,705,650	7,885,795,000	1.89%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2024 年 12 月 30 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		85,380,478,790	83.56
	内 日本	85,380,478,790	83.56
地方債証券		4,920,025,541	4.82
	内 日本	4,920,025,541	4.82
特殊債券		4,323,055,509	4.23
	内 日本	4,323,055,509	4.23
社債券		7,080,157,600	6.93
	内 日本	7,080,157,600	6.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		475,445,465	0.47
純資産総額		102,179,162,905	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（2024 年 12 月 30 日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	149 5 年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	98.94 2,275,666,000	99.05 2,278,242,000	0.005000 2026/09/20	2.23
2	154 5 年国債	日本	国債証券	2,180,000,000	98.55 2,148,520,800	98.69 2,151,551,000	0.100000 2027/09/20	2.11
3	158 5 年国債	日本	国債証券	1,730,000,000	98.22 1,699,309,800	98.36 1,701,766,400	0.100000 2028/03/20	1.67
4	153 5 年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	98.47 1,575,536,000	98.60 1,577,744,000	0.005000 2027/06/20	1.54
5	148 5 年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.11 1,486,785,000	99.23 1,488,540,000	0.005000 2026/06/20	1.46
6	163 5 年国債	日本	国債証券	1,470,000,000	98.96 1,454,756,100	99.05 1,456,167,300	0.400000 2028/09/20	1.43
7	150 5 年国債	日本	国債証券	1,450,000,000	98.79 1,432,556,500	98.90 1,434,166,000	0.005000 2026/12/20	1.40
8	362 10 年国債	日本	国債証券	1,430,000,000	95.97 1,372,485,400	95.89 1,371,269,900	0.100000 2031/03/20	1.34
9	374 10 年国債	日本	国債証券	1,370,000,000	98.17 1,344,983,800	98.02 1,342,942,500	0.800000 2034/03/20	1.31

	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 (%)
10	373 10年国債	日本	国債証券	1,260,000,000	96.76 1,219,190,600	96.59 1,217,071,800	0.600000 2033/12/20	1.19
11	164 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	98.05 1,176,612,000	98.15 1,177,824,000	0.200000 2028/12/20	1.15
12	156 5年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	98.71 1,154,926,500	98.82 1,156,240,800	0.200000 2027/12/20	1.13
13	360 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	96.33 1,136,717,200	96.36 1,137,107,000	0.100000 2030/09/20	1.11
14	366 10年国債	日本	国債証券	1,190,000,000	95.62 1,137,983,400	95.46 1,135,974,000	0.200000 2032/03/20	1.11
15	367 10年国債	日本	国債証券	1,160,000,000	95.32 1,105,761,800	95.14 1,103,670,400	0.200000 2032/06/20	1.08
16	358 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	96.66 1,102,020,400	96.74 1,102,904,400	0.100000 2030/03/20	1.08
17	369 10年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	97.07 1,096,902,300	96.85 1,094,416,300	0.500000 2032/12/20	1.07
18	370 10年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	96.80 1,084,171,200	96.61 1,082,065,600	0.500000 2033/03/20	1.06
19	371 10年国債	日本	国債証券	1,110,000,000	95.69 1,062,160,500	95.54 1,060,571,700	0.400000 2033/06/20	1.04
20	361 10年国債	日本	国債証券	1,020,000,000	96.15 980,791,200	96.15 980,811,600	0.100000 2030/12/20	0.96
21	359 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.48 964,880,000	96.57 965,700,000	0.100000 2030/06/20	0.95
22	368 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.03 950,380,000	94.85 948,540,000	0.200000 2032/09/20	0.93
23	372 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.74 938,049,000	98.55 936,282,000	0.800000 2033/09/20	0.92
24	120 住宅機構RMBS	日本	特殊債券	898,338,000	93.35 838,688,356	93.27 837,969,686	0.400000 2052/05/10	0.82
25	365 10年国債	日本	国債証券	880,000,000	95.23 838,068,000	95.07 836,660,000	0.100000 2031/12/20	0.82
26	364 10年国債	日本	国債証券	850,000,000	95.48 811,639,500	95.36 810,585,500	0.100000 2031/09/20	0.79
27	466 2年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.79 798,336,000	99.85 798,840,000	0.500000 2026/11/01	0.78
28	147 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.31 794,496,000	99.43 795,512,000	0.005000 2026/03/20	0.78
29	363 10年国債	日本	国債証券	830,000,000	95.73 794,600,500	95.61 793,621,100	0.100000 2031/06/20	0.78
30	458 2年国債	日本	国債証券	780,000,000	99.58 776,770,800	99.70 777,683,400	0.200000 2026/03/01	0.76

(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	83.56%
地方債証券	4.82%
特殊債券	4.23%
社債券	6.93%
合計	99.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024 年 12 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		664,948,937,471	93.92
	内 香港	3,278,069,956	0.46
	内 シンガポール	2,736,380,178	0.39
	内 イスラエル	1,649,747,543	0.23
	内 ノルウェー	1,001,666,836	0.14
	内 スウェーデン	6,198,717,354	0.88
	内 デンマーク	5,046,887,127	0.71
	内 イギリス	23,304,665,468	3.29
	内 アイルランド	449,777,616	0.06
	内 オランダ	7,450,885,512	1.05
	内 ベルギー	1,577,865,510	0.22
	内 フランス	17,623,980,655	2.49
	内 ドイツ	14,974,676,166	2.12
	内 スイス	14,493,342,974	2.05
	内 ポルトガル	264,776,302	0.04
	内 スペイン	4,398,985,152	0.62
	内 イタリア	4,514,558,654	0.64
	内 フィンランド	1,574,034,058	0.22
	内 オーストリア	310,533,061	0.04
	内 カナダ	19,423,534,158	2.74
	内 アメリカ	523,827,958,210	73.99
	内 オーストラリア	10,487,651,986	1.48
	内 ニュージーランド	360,242,995	0.05
投資証券		12,479,592,243	1.76
	内 香港	167,156,352	0.02
	内 シンガポール	165,248,323	0.02
	内 イギリス	160,464,025	0.02
	内 ベルギー	35,680,693	0.01
	内 フランス	219,838,528	0.03
	内 カナダ	22,314,046	0.00
	内 アメリカ	10,696,623,768	1.51
	内 オーストラリア	1,012,266,508	0.14

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	30,569,023,036	4.32
純資産総額	707,997,552,750	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)		30,745,648,148	4.34
	内 イギリス	1,931,379,639	0.27
	内 ドイツ	5,022,395,228	0.71
	内 カナダ	2,714,868,962	0.38
	内 アメリカ	19,877,365,431	2.81
	内 オーストラリア	1,199,638,888	0.17
為替予約取引(買建)		19,217,157,600	2.71
	内 日本	19,217,157,600	2.71

(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 (2024 年 12 月 30 日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	980,500	37,540.85 36,808,812,642	40,429.22 39,640,856,289	5.60
2	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,580,200	21,868.38 34,556,421,977	21,672.24 34,246,476,492	4.84
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	454,400	66,982.90 30,437,031,032	68,101.23 30,945,201,366	4.37
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	608,200	32,884.04 20,000,073,250	35,392.77 21,525,885,755	3.04
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	140,700	90,845.93 12,782,023,420	94,877.94 13,349,326,974	1.89
6	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	185,050	54,597.40 10,103,250,498	68,279.97 12,635,210,077	1.78
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	377,000	26,724.51 10,075,140,647	30,490.77 11,495,022,854	1.62

	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 (%)
8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	285,620	25,637.81 7,322,672,549	38,240.01 10,922,113,084	1.54
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	323,440	26,968.10 8,722,564,916	30,693.24 9,927,423,874	1.40
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	183,070	39,500.70 7,231,394,906	38,148.27 6,983,803,899	0.99
11	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	51,985	125,808.46 6,540,152,949	123,881.83 6,439,996,964	0.91
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	85,350	76,404.10 6,521,090,242	72,210.75 6,163,187,666	0.87
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	107,850	49,839.35 5,375,174,372	50,405.63 5,436,248,145	0.77
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	285,809	18,658.91 5,332,885,208	16,843.00 4,813,882,816	0.68
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	59,466	96,521.43 5,739,743,713	80,670.21 4,797,135,195	0.68
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	53,100	84,300.44 4,476,353,853	84,183.39 4,470,138,328	0.63
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	28,560	153,731.97 4,390,585,303	148,641.74 4,245,208,266	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	284,500	14,631.65 4,162,704,425	14,498.77 4,124,902,569	0.58
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	151,167	28,355.34 4,286,392,710	26,816.25 4,053,732,880	0.57
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	27,690	140,275.60 3,884,231,525	143,556.25 3,975,072,812	0.56
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	63,950	67,879.78 4,340,912,148	62,142.59 3,974,018,937	0.56
22	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	155,000	24,519.48 3,800,519,679	22,944.00 3,556,321,395	0.50
23	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	61,566	52,197.81 3,213,610,875	53,536.02 3,295,998,669	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	113,672	28,935.86 3,289,197,919	28,157.62 3,200,733,185	0.45
25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	449,301	7,515.13 3,376,556,233	7,013.70 3,151,262,963	0.45
26	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	213,987	16,743.90 3,582,977,571	14,059.74 3,008,603,509	0.42
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,033	29,237.99 3,129,429,912	26,726.09 2,860,573,891	0.40
28	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	25,150	108,583.32 2,730,870,699	112,953.70 2,840,785,756	0.40

	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 (%)
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	263,550	10,136.17 2,671,388,763	9,878.34 2,603,436,771	0.37
30	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	65,778	37,090.50 2,439,739,435	39,498.34 2,598,121,809	0.37

(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	93.92%
投資証券	1.76%
合計	95.68%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.59%
素材	2.97%
資本財・サービス	9.42%
一般消費財・サービス	10.38%
生活必需品	5.78%
ヘルスケア	10.00%
金融	15.16%
情報技術	26.07%
コミュニケーション・サービス	7.87%
公益事業	2.41%
不動産	0.27%
合計	93.92%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 25	買建	417	20,261,868,299	19,877,365,431	2.81%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 25	買建	119	1,952,918,031	1,931,379,639	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 25	買建	59	1,210,854,639	1,199,638,888	0.17%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 25	買建	83	2,759,761,983	2,714,868,962	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 25	買建	91	1,861,448,572	1,846,207,545	0.26%

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
		EURO STOXX 50 MAR 25	買建	392	3,219,887,690	3,176,187,683	0.45%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2025年1月	買建	7,500,000	728,422,240	737,712,000	0.10%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	8,500,000	1,348,394,820	1,400,522,900	0.20%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	78,900,000	11,904,185,770	12,463,044,000	1.76%
		スイス・フラン買/円売 2025年1月	買建	8,100,000	1,378,866,950	1,420,162,470	0.20%
		カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	17,000,000	1,815,234,350	1,864,279,500	0.26%
		英ポンド買/円売 2025年1月	買建	6,700,000	1,274,462,810	1,331,436,730	0.19%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2024 年 12 月 30 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		329,561,475,020	97.63
	内 ユーロ	98,988,156,413	29.32
	内 中国	37,401,130,797	11.08
	内 シンガポール	1,183,190,219	0.35
	内 マレーシア	1,652,564,172	0.49
	内 イスラエル	981,866,029	0.29
	内 ノルウェー	449,279,632	0.13
	内 スウェーデン	470,488,647	0.14
	内 デンマーク	677,336,592	0.20
	内 イギリス	16,896,608,775	5.01
	内 ポーランド	1,667,863,602	0.49
	内 カナダ	6,186,807,335	1.83
	内 アメリカ	155,950,958,216	46.20
	内 メキシコ	2,303,723,398	0.68
	内 オーストラリア	3,954,516,301	1.17
	内 ニュージーランド	796,984,892	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,000,731,379	2.37
純資産総額		337,562,206,399	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,731,096,765	0.51
	内 日本	1,731,096,765	0.51

（注 1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注 2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
（注 3）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（2024 年 12 月 30 日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 （円）	評価単価 時価 （円）	利率(%) 償還期限 （年/月/日）	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.98 1,859,386,851	101.70 1,872,607,291	1.850000 2027/05/15	0.55

	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 (%)
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	97.76 1,701,056,647	94.85 1,650,388,429	3.875000 2033/08/15	0.49
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,608,365,710	102.66 1,623,435,886	2.050000 2029/04/15	0.48
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,618,434,488	99.21 1,569,430,324	4.500000 2033/11/15	0.46
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,618,703,394	94.24 1,565,255,953	3.875000 2034/08/15	0.46
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,422,144,971	82.24 1,392,001,083	1.125000 2031/02/15	0.41
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,323,855,025	102.38 1,330,665,621	2.390000 2026/11/15	0.39
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,364,205,219	88.39 1,328,335,531	2.750000 2032/08/15	0.39
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,356,321,369	81.33 1,325,104,863	1.250000 2031/08/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,363,111,404	98.14 1,319,629,304	4.375000 2034/05/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	91.87 1,351,490,394	89.52 1,316,920,155	2.875000 2032/05/15	0.39
12	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,292,252,908	103.84 1,304,703,908	2.370000 2029/01/15	0.39
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,307,576,779	98.14 1,288,500,429	4.000000 2029/07/31	0.38
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,319,411,016	81.43 1,288,138,830	1.375000 2031/11/15	0.38
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,289,472,920	81.54 1,264,034,728	0.875000 2030/11/15	0.37
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	98.51 1,277,814,421	95.43 1,237,864,480	4.000000 2034/02/15	0.37
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	96.32 1,177,582,525	96.44 1,179,159,644	1.625000 2026/05/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,206,951,363	92.70 1,173,151,460	3.500000 2033/02/15	0.35
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	85.94 1,182,773,392	84.06 1,156,805,139	1.625000 2031/05/15	0.34
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,126,423,568	105.44 1,142,128,663	2.540000 2030/12/25	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	94.32 1,163,822,637	91.58 1,129,979,393	3.375000 2033/05/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,096,718,884	98.49 1,090,628,954	3.750000 2027/08/15	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.98 1,151,373,238	96.82 1,072,137,712	4.625000 2054/05/15	0.32

	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 (%)
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	94.40 1,045,275,585	94.39 1,045,231,294	1.125000 2026/10/31	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,700,000	99.87 1,058,491,840	97.21 1,030,301,000	4.125000 2032/11/15	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	82.41 1,042,849,104	80.94 1,024,361,025	0.625000 2030/08/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	95.76 1,014,902,019	94.85 1,005,300,177	2.875000 2028/08/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	90.08 997,441,953	89.61 992,226,758	0.750000 2028/01/31	0.29
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	102.43 976,307,555	104.00 991,319,460	2.280000 2031/03/25	0.29
30	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	100.68 959,694,381	103.69 988,374,267	2.110000 2034/08/25	0.29

(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	97.63%
合計	97.63%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2025年1月	買建	295,000	57,271,816	58,644,857	0.02%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2025年1月	買建	595,000	52,491,554	52,994,746	0.02%
		オフショア人民元買/円売 2025年1月	買建	26,825,000	556,578,360	580,512,483	0.17%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	3,052,000	475,309,857	482,262,300	0.14%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2025年1月	買建	848,000	11,623,366	12,194,494	0.00%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2025年1月	買建	1,911,000	25,771,172	26,608,572	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	671,000	72,177,138	73,596,623	0.02%

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
		メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	14,865,000	108,144,361	115,171,047	0.03%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	1,997,000	324,038,591	329,111,643	0.10%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワ・ライフ・バランス30

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	20,662円
純資産総額	298億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	2.3%
6カ月間	0.4%
1年間	6.8%
3年間	12.6%
5年間	24.4%
設定来	106.6%

※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 8 期 13年6月	第 9 期 14年6月	第 10 期 15年6月	第 11 期 16年6月	第 12 期 17年6月	第 13 期 18年6月	第 14 期 19年6月	第 15 期 20年6月	第 16 期 21年6月	第 17 期 22年6月	第 18 期 23年6月	第 19 期 24年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

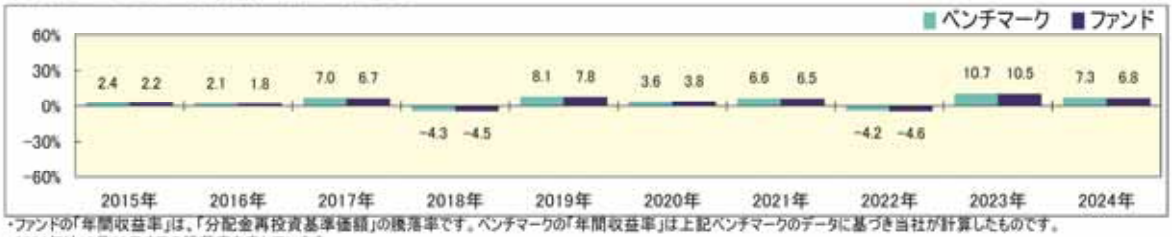
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
国内債券	389	53.6%	日本円	74.5%	直接利回り(%)	1.2	トヨタ自動車	日本	0.8%
国内株式・先物	2,091	20.4%	米ドル	15.3%	最終利回り(%)	1.6	ソニーグループ	日本	0.6%
外国債券	1,025	14.7%	ユーロ	5.3%	修正デュレーション	8.2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%
外国株式・先物	1,156	10.2%	オフショア人民元	1.7%	残存年数	9.5	APPLE INC	アメリカ	0.6%
外国リート	51	0.2%	英ポンド	1.1%	債券格付別構成	比率	日 立	日本	0.5%
外国投資証券	3	0.0%	カナダ・ドル	0.6%	AAA	85.5%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.5%
			豪ドル	0.4%	AA	8.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%
			スイス・フラン	0.2%	A	4.3%	リクルートホールディングス	日本	0.4%
			メキシコ・ペソ	0.1%	BBB	－	三井住友フィナンシャルG	日本	0.4%
コール・ローン、その他		1.8%	その他	0.7%	BB以下・無格付	1.8%	TOPIX　先物 0703月	日本	0.4%
合計	4,715	－	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		5.3%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.8%保有しております。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①＋②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワ・ライフ・バランス30	0.21%	0.20%	0.01%

※対象期間は2023年6月6日～2024年6月5日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分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。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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

２【換金（解約）手続等】

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分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、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

３【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3.価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前 1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の 1.から 6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

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

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
https://www.daiwa-am.co.jp/
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 19 期計算期間(2023 年 6 月 6 日から 2024 年 6 月 5 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。

独立監査人の監査報告書

2024年7月19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	秋山　範之
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	竹内　知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス３０の2023年6月6日から2024年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス３０の2024年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸

表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

１ 【財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス３０

(1)【貸借対照表】

	第18期 2023年6月5日現在 金　額（円）	第19期 2024年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,579,989	150,192,884
親投資信託受益証券	24,524,532,867	28,572,944,162
流動資産合計	24,643,112,856	28,723,137,046
資産合計	24,643,112,856	28,723,137,046
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,248,374	36,174,140
未払受託者報酬	3,772,190	4,580,765
未払委託者報酬	18,861,190	22,903,984
その他未払費用	942,977	1,145,105
流動負債合計	45,824,731	64,803,994
負債合計	45,824,731	64,803,994
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	13,056,918,437	14,133,783,401
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,540,369,688	14,524,549,651
（分配準備積立金）	3,649,052,648	5,066,840,490
元本等合計	24,597,288,125	28,658,333,052
純資産合計	24,597,288,125	28,658,333,052
負債純資産合計	24,643,112,856	28,723,137,046

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第18期 自2022年6月7日 至2023年6月5日 金　額（円）	第19期 自2023年6月6日 至2024年6月5日 金　額（円）
営業収益		
受取利息	41	21,424
有価証券売買等損益	1,056,533,568	2,030,364,295
営業収益合計	1,056,533,609	2,030,385,719
営業費用		
支払利息	33,545	23,247
受託者報酬	7,405,967	8,786,387
委託者報酬	37,030,307	43,932,339
その他費用	1,851,347	2,196,439
営業費用合計	46,321,166	54,938,412
営業利益又は営業損失（△）	1,010,212,443	1,975,447,307
経常利益又は経常損失（△）	1,010,212,443	1,975,447,307
当期純利益又は当期純損失（△）	1,010,212,443	1,975,447,307
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（△）	5,086,894	115,149,096
期首剰余金又は期首欠損金（△）	9,564,191,936	11,540,369,688
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,041,363,872	2,692,519,606
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,041,363,872	2,692,519,606
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,070,311,669	1,568,637,854
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,070,311,669	1,568,637,854
分配金　※1	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,540,369,688	14,524,549,651

(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19期 自2023年6月6日 至2024年6月5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18期 2023年6月5日現在	第19期 2024年6月5日現在
1. ※1 期首元本額	11,849,716,452円	13,056,918,437円
期中追加設定元本額	2,534,773,978円	2,844,164,776円
期中一部解約元本額	1,327,571,993円	1,767,299,812円
2. 計算期間末日における受益権の総数	13,056,918,437口	14,133,783,401口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第18期 自2022年6月7日 至2023年6月5日	第19期 自2023年6月6日 至2024年6月5日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,005,140,619円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,891,348,770円）及び分配準備積立金（2,643,912,029円）より分配対象額は11,540,401,418円（1万口当たり8,838.53円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（67円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,860,270,260円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,457,709,161円）及び分配準備積立金（3,206,570,163円）より分配対象額は14,524,549,651円（1万口当たり10,276.48円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第19期 自2023年6月6日 至2024年6月5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。

区分	第19期 自2023年6月6日 至2024年6月5日
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	第19期 2024年6月5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18期 2023年6月5日現在	第19期 2024年6月5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	1,022,487,404	1,923,346,438
合計	1,022,487,404	1,923,346,438

（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18期 2023年6月5日現在	第19期 2024年6月5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19期 自2023年6月6日 至2024年6月5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18期 2023年6月5日現在	第19期 2024年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8839円 （18,839円）	2.0276円 （20,276円）

(4)【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	3,004,647,121	5,996,374,259	
	外国株式インデックスマザーファンド	478,833,626	3,089,721,855	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,176,516,654	4,331,228,410	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	12,692,085,787	15,155,619,638	
親投資信託受益証券　合計			28,572,944,162	
合計			28,572,944,162	

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、「外国債券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

		2023年6月5日現在 金　額（円）	2024年6月5日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,496,544,143	19,339,500,913
株式	※2※3	235,920,131,577	349,141,127,490
派生商品評価勘定		572,330,500	26,412,650
未収入金		－	67,818,800
未収配当金		2,050,889,570	2,709,747,014
未収利息		480,343	－
その他未収収益	※4	38,322,027	24,814,523
差入委託証拠金		－	268,993,515
流動資産合計		249,078,698,160	371,578,414,905
資産合計		249,078,698,160	371,578,414,905
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	50,316,250
前受金		431,906,300	185,884,500
未払金		－	7,320,801,514
未払解約金		107,784,740	232,156,570
受入担保金		4,800,327,997	8,177,269,619
流動負債合計		5,340,019,037	15,966,428,453
負債合計		5,340,019,037	15,966,428,453
純資産の部			
元本等			
元本	※1	154,707,449,700	178,188,938,492
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		89,031,229,423	177,423,047,960
元本等合計		243,738,679,123	355,611,986,452
純資産合計		243,738,679,123	355,611,986,452
負債純資産合計		249,078,698,160	371,578,414,905

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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	2023 年 6 月 5 日現在	2024 年 6 月 5 日現在
1.　※1　期首	2022 年 6 月 7 日	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	144,218,034,186 円	154,707,449,700 円
期中追加設定元本額	23,949,619,642 円	39,690,949,399 円
期中一部解約元本額	13,460,204,128 円	16,209,460,607 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	2,766,727,363 円	2,780,326,066 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,582,469,170 円	4,091,254,535 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	914,473 円	908,055 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	16,539,530 円	9,102,808 円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	239,546,860 円	139,851,291 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	16,395,434 円	11,667,234 円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	462,005,847 円	344,658,301 円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	-円	1,193,640,356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）	582,944,013円	723,449,655円
Ｄ－Ｉ’ｓ ＴＯＰＩＸインデックス	13,713,849円	12,955,296円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	230,161,402円	240,438,554円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	6,665,168,340円	7,979,704,045円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,452,587,585円	4,634,420,825円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	861,208,807円	1,083,856,357円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	33,003円	3,190,937円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	69,887,459,503円	71,179,124,311円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,205,125,267円	3,004,647,121円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,812,288,474円	4,900,613,734円
ダイワ・ライフ・バランス７０	5,099,468,118円	5,876,164,957円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,096,930,330円	7,734,033,540円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	53,649,088円	46,611,262円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	71,886,039円	72,330,830円
ダイワつみたてインデックス日本株式	3,477,349,497円	5,635,921,835円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,632,163円	12,110,455円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	10,218,104円	12,116,962円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	30,731,620円	32,181,984円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	5,169,576,821円	17,295,931,594円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	68,265,420円	46,931,794円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	24,867,151円	19,120,292円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,404,601,154円	3,235,867,266円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	414,580,439円	320,340,775円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	59,675,537円	39,868,561円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	93,574,927円	59,424,894円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	206,174,498円	241,876,350円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	11,968,348,998円	12,600,334,549円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	3,416,099,506円	9,320,884,219円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,551,296,505円	3,356,045,033円
スタイル９（4資産分散・保守型）	−円	302,513円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	−円	2,454,260円
スタイル９（4資産分散・積極型）	−円	3,431,870円
スタイル９（6資産分散・保守型）	−円	189,174円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	−円	4,377,136円
スタイル９（6資産分散・積極型）	−円	5,424,192円
スタイル９（8資産分散・保守型）	−円	254,361円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	−円	3,690,361円
スタイル９（8資産分散・積極型）	−円	10,446,027円
ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ	1,181,419,940円	1,062,471,284円
ダイワライフスタイル２５	121,938,701円	93,947,166円
ダイワライフスタイル５０	524,432,231円	442,746,622円
ダイワライフスタイル７５	418,523,791円	382,356,001円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,435,920,202円	7,884,940,892円
計	154,707,449,700円	178,188,938,492円
2. 期末日における受益権の総数	154,707,449,700口	178,188,938,492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 4,697,417,000円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,649,604,490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 1,130,580,000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 764,480,000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が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024 年 6 月 5 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	2023年6月5日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2024年6月5日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	28,833,380,551	38,528,920,851
合計	28,833,380,551	38,528,920,851

（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	2023年6月5日現在				2024年6月5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	7,341,353,700	－	7,913,880,000	572,526,300	6,456,434,900	－	6,432,660,000	△23,774,900
合計	7,341,353,700	－	7,913,880,000	572,526,300	6,456,434,900	－	6,432,660,000	△23,774,900

（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）

	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5755円 （15,755円）	1.9957円 （19,957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	5,200	3,850.00	20,020,000	
ニッスイ	126,400	875.10	110,612,640	
マルハニチロ	18,700	3,225.00	60,307,500	
雪国まいたけ	10,800	966.00	10,432,800	貸付株式数 2,200株
カネコ種苗	3,600	1,404.00	5,054,400	
サカタのタネ	14,400	3,345.00	48,168,000	貸付株式数 5,600株
ホクト	10,100	1,843.00	18,614,300	
ホクリヨウ	700	994.00	695,800	貸付株式数 200株
ショーボンドＨＤ	17,200	5,858.00	100,757,600	
ミライト・ワン	38,200	1,958.50	74,814,700	
タマホーム	7,900	3,935.00	31,086,500	貸付株式数 3,100株
サンヨーホームズ	500	740.00	370,000	貸付株式数 100株 (100株)
日本アクア	1,700	868.00	1,475,600	
ファーストコーポレーション	1,200	767.00	920,400	貸付株式数 400株
ベステラ	1,000	955.00	955,000	貸付株式数 300株 (300株)
キャンディル	700	615.00	430,500	貸付株式数 200株
住石ホールディングス	16,100	1,375.00	22,137,500	貸付株式数 6,200株
日鉄鉱業	5,100	5,090.00	25,959,000	
三井松島HLDGS	7,500	4,605.00	34,537,500	貸付株式数 2,700株
ＩＮＰＥＸ	424,700	2,314.50	982,968,150	
石油資源開発	14,700	6,290.00	92,463,000	
K&Oエナジーグループ	5,700	3,740.00	21,318,000	
リョーサン菱洋HD	17,100	3,070.00	52,497,000	
ダイセキ環境ソリューション	800	985.00	788,000	貸付株式数 300株
第一カッター興業	3,600	1,529.00	5,504,400	
明豊ファシリティワークス	1,500	885.00	1,327,500	
安藤・間	73,200	1,128.00	82,569,600	
東急建設	39,500	761.00	30,059,500	
コムシスホールディングス	40,400	3,078.00	124,351,200	
ビーアールホールディングス	18,500	356.00	6,586,000	貸付株式数 6,700株
高松コンストラクションGP	9,400	2,910.00	27,354,000	
東建コーポレーション	3,200	10,790.00	34,528,000	
ソネック	400	929.00	371,600	貸付株式数 100株
ヤマウラ	6,400	1,295.00	8,288,000	貸付株式数 2,400株
オリエンタル白石	46,600	351.00	16,356,600	
大成建設	81,000	6,054.00	490,374,000	
大 林 組	316,400	1,792.00	566,988,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
清水建設	250,900	837.20	210,053,480	
飛島建設	9,100	1,452.00	13,213,200	
長谷工コーポレーション	81,100	1,790.50	145,209,550	
松井建設	8,300	813.00	6,747,900	
錢 高 組	500	4,335.00	2,167,500	貸付株式数 100株
鹿島建設	196,100	2,643.00	518,292,300	
不動テトラ	6,100	2,534.00	15,457,400	
大末建設	1,200	1,724.00	2,068,800	
鉄建建設	6,300	2,545.00	16,033,500	
西松建設	16,900	4,328.00	73,143,200	
三井住友建設	65,800	400.00	26,320,000	
大豊建設	3,100	3,220.00	9,982,000	
佐田建設	1,800	765.00	1,377,000	
ナカノフドー建設	2,000	507.00	1,014,000	
奥 村 組	14,300	4,860.00	69,498,000	
東鉄工業	11,000	3,145.00	34,595,000	
イチケン	700	2,538.00	1,776,600	
富士ピー・エス	1,300	446.00	579,800	貸付株式数 500株
淺沼組	6,500	3,645.00	23,692,500	
戸田建設	119,800	1,050.50	125,849,900	
熊 谷 組	14,600	3,630.00	52,998,000	
北野建設	500	3,545.00	1,772,500	
植 木 組	800	1,628.00	1,302,400	
矢作建設	12,000	1,542.00	18,504,000	
ピーエス三菱	11,200	1,012.00	11,334,400	
日本ハウスHLDGS	18,900	317.00	5,991,300	貸付株式数 6,500株
大東建託	32,500	17,005.00	552,662,500	
新日本建設	12,400	1,485.00	18,414,000	
サムティホールディングス	13,800	2,529.00	34,900,200	
東亜道路	17,300	1,164.00	20,137,200	
日本道路	10,400	1,756.00	18,262,400	
東亜建設	26,700	969.00	25,872,300	
日本国土開発	25,400	467.00	11,861,800	貸付株式数 9,800株
若築建設	3,100	3,430.00	10,633,000	
東洋建設	22,200	1,367.00	30,347,400	
五洋建設	125,400	652.30	81,798,420	
世紀東急	11,300	1,666.00	18,825,800	貸付株式数 4,100株
福 田 組	3,300	5,600.00	18,480,000	
日本ドライケミカル	700	2,602.00	1,821,400	貸付株式数 100株
住友林業	76,400	5,552.00	424,172,800	
日本基礎技術	1,800	614.00	1,105,200	
巴コーポレーション	3,700	804.00	2,974,800	
大和ハウス	244,700	4,185.00	1,024,069,500	
ライト工業	17,600	2,014.00	35,446,400	
積水ハウス	268,300	3,522.00	944,952,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日特建設	8,400	1,086.00	9,122,400	
北陸電気工事	6,100	1,107.00	6,752,700	貸付株式数　2,100株
ユアテック	19,500	1,521.00	29,659,500	
日本リーテック	6,900	1,145.00	7,900,500	
四電工	3,700	3,515.00	13,005,500	
中電工	13,800	3,135.00	43,263,000	
関 電 工	55,400	1,789.00	99,110,600	
きんでん	61,500	3,292.00	202,458,000	
東京エネシス	8,300	1,373.00	11,395,900	
トーエネック	2,900	5,580.00	16,182,000	
住友電設	8,400	3,450.00	28,980,000	
日本電設工業	16,600	1,963.00	32,585,800	
エクシオグループ	86,500	1,588.50	137,405,250	
新日本空調	5,700	3,995.00	22,771,500	
九電工	19,100	6,110.00	116,701,000	
三機工業	19,100	2,180.00	41,638,000	
日揮ホールディングス	87,500	1,225.50	107,231,250	
中外炉工業	2,900	3,050.00	8,845,000	
ヤマト	2,500	1,061.00	2,652,500	
太平電業	5,500	5,310.00	29,205,000	
高砂熱学	23,700	6,050.00	143,385,000	
三晃金属	400	4,450.00	1,780,000	
NEC ネッツエスアイ	35,300	2,159.00	76,212,700	
朝日工業社	8,300	1,356.00	11,254,800	
明星工業	17,100	1,257.00	21,494,700	
大 氣 社	10,200	5,180.00	52,836,000	
ダイダン	11,600	3,045.00	35,322,000	
日比谷総合設備	6,400	3,215.00	20,576,000	貸付株式数　2,500株
ニップン	26,600	2,256.00	60,009,600	貸付株式数　10,200株
日清製粉Ｇ本社	82,100	1,790.00	146,959,000	
日東富士製粉	1,600	6,750.00	10,800,000	
昭和産業	8,600	3,155.00	27,133,000	
鳥越製粉	2,700	685.00	1,849,500	
中部飼料	12,400	1,527.00	18,934,800	
フィード・ワン	13,000	887.00	11,531,000	
東洋精糖	500	1,636.00	818,000	
日本甜菜糖	5,200	2,033.00	10,571,600	
DM 三井製糖ホールディ	8,800	3,220.00	28,336,000	
塩水港精糖	3,900	276.00	1,076,400	貸付株式数　1,400株
ウェルネオシュガー	4,400	2,339.00	10,291,600	
ＬＩＦＵＬＬ	22,400	167.00	3,740,800	貸付株式数　8,800株
ＭＩＸＩ	19,900	2,890.00	57,511,000	
ジェイエイシーリクルートメント	33,400	667.00	22,277,800	
日本 M&A センターホールデ	147,800	740.90	109,505,020	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
メンバーズ	3,200	852.00	2,726,400	貸付株式数 1,200株
中広	500	504.00	252,000	
ＵＴグループ	12,100	2,939.00	35,561,900	
アイティメディア	3,500	1,890.00	6,615,000	貸付株式数 100株
ケアネット	19,000	522.00	9,918,000	貸付株式数 3,600株
E・Ｊホールディングス	5,400	1,741.00	9,401,400	貸付株式数 1,800株
オープンアップグループ	27,900	1,966.00	54,851,400	
コシダカホールディングス	27,800	851.00	23,657,800	貸付株式数 10,800株
アルトナー	1,300	2,055.00	2,671,500	貸付株式数 400株
パソナグループ	11,200	2,169.00	24,292,800	
ＣＤＳ	800	1,826.00	1,460,800	
リンクアンドモチベーション	26,700	452.00	12,068,400	貸付株式数 7,900株
エス・エム・エス	32,500	1,975.50	64,203,750	
サニーサイドアップＧ	1,100	677.00	744,700	
パーソルホールディングス	944,000	225.00	212,400,000	
リニカル	1,900	395.00	750,500	
クックパッド	25,400	189.00	4,800,600	貸付株式数 9,500株
エスクリ	1,200	284.00	340,800	貸付株式数 400株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	1,500	774.00	1,161,000	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	37,500	2,525.50	94,706,250	
中 村 屋	2,200	3,235.00	7,117,000	貸付株式数 600株
江崎グリコ	25,400	4,158.00	105,613,200	
名糖産業	3,500	1,837.00	6,429,500	
井村屋グループ	5,300	2,546.00	13,493,800	
不 二 家	6,100	2,536.00	15,469,600	貸付株式数 2,300株
山崎製パン	59,400	3,470.00	206,118,000	
第一屋製パン	600	650.00	390,000	
モロゾフ	2,900	4,440.00	12,876,000	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	5,100	4,065.00	20,731,500	
寿スピリッツ	42,000	1,790.00	75,180,000	
カルビー	40,700	3,168.00	128,937,600	
森永乳業	31,000	3,200.00	99,200,000	
六甲バター	6,500	1,434.00	9,321,000	貸付株式数 2,500株
ヤクルト	126,900	2,894.50	367,312,050	
明治ホールディングス	108,900	3,556.00	387,248,400	
雪印メグミルク	21,500	2,505.00	53,857,500	
プリマハム	12,000	2,377.00	28,524,000	
日本ハム	38,200	4,823.00	184,238,600	
林兼産業	1,000	511.00	511,000	貸付株式数 300株
丸大食品	9,000	1,695.00	15,255,000	
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	9,800	2,890.00	28,322,000	
柿安本店	3,400	2,610.00	8,874,000	貸付株式数 1,200株
伊藤ハム米久HLDGS	13,600	4,180.00	56,848,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
学情	4,700	1,758.00	8,262,600	貸付株式数 200株
スタジオアリス	4,600	2,058.00	9,466,800	貸付株式数 1,800株 (800株)
クロスキャット	5,700	1,290.00	7,353,000	貸付株式数 1,800株
エプコ	800	821.00	656,800	
システナ	137,100	289.00	39,621,900	
ＮＪＳ	2,000	3,505.00	7,010,000	貸付株式数 700株
デジタルアーツ	5,700	3,620.00	20,634,000	
日鉄ソリューションズ	15,400	5,040.00	77,616,000	貸付株式数 5,900株
綜合警備保障	155,000	945.30	146,521,500	
キューブシステム	4,800	1,102.00	5,289,600	貸付株式数 600株
いちご	90,200	384.00	34,636,800	
日本駐車場開発	105,700	190.00	20,083,000	
コア	4,000	1,874.00	7,496,000	
カカクコム	60,200	1,938.00	116,667,600	
アイロムグループ	3,700	2,787.00	10,311,900	
セントケア・ホールディング	6,800	837.00	5,691,600	貸付株式数 2,000株
サイネックス	500	730.00	365,000	
ルネサンス	7,200	938.00	6,753,600	貸付株式数 2,700株
ディップ	14,200	2,672.00	37,942,400	
SBSホールディングス	8,000	2,541.00	20,328,000	貸付株式数 600株
デジタルホールディングス	4,800	1,070.00	5,136,000	
新日本科学	8,400	1,360.00	11,424,000	貸付株式数 3,200株
キャリアデザインセンター	600	1,727.00	1,036,200	貸付株式数 200株
エムスリー	183,300	1,655.00	303,361,500	
ツカダ・グローバルHOLD	1,900	479.00	910,100	貸付株式数 600株
ブラス	400	680.00	272,000	貸付株式数 100株
ウェルネット	2,700	628.00	1,695,600	貸付株式数 1,000株
ワールドホールディングス	4,200	2,152.00	9,038,400	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	32,900	1,530.00	50,337,000	
博報堂ＤＹHLDGS	118,300	1,159.00	137,109,700	
ぐるなび	17,200	314.00	5,400,800	貸付株式数 6,700株
タカミヤ	12,500	484.00	6,050,000	貸付株式数 3,100株
ファンコミュニケーションズ	12,800	410.00	5,248,000	
ライク	3,400	1,520.00	5,168,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	1,100	343.00	377,300	貸付株式数 400株
エスプール	26,700	322.00	8,597,400	貸付株式数 10,000株
WDBホールディングス	4,700	1,753.00	8,239,100	
手間いらず	1,500	2,979.00	4,468,500	貸付株式数 500株
ティア	2,000	460.00	920,000	貸付株式数 700株
ＣＤＧ	300	1,301.00	390,300	貸付株式数 100株
アドウェイズ	12,700	396.00	5,029,200	
バリューコマース	8,200	1,187.00	9,733,400	貸付株式数 1,900株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
インフォマート	96,300	323.00	31,104,900	
サッポロホールディングス	29,200	5,600.00	163,520,000	
アサヒグループホールディン	205,200	5,835.00	1,197,342,000	
キリンＨＤ	370,000	2,226.00	823,620,000	
宝ホールディングス	60,000	1,084.00	65,040,000	
オエノンホールディングス	26,600	367.00	9,762,200	貸付株式数 2,800 株
養 命 酒	2,900	2,214.00	6,420,600	
コカ・コーラボトラーズ JHD	69,600	1,916.50	133,388,400	
サントリー食品インター	62,500	5,631.00	351,937,500	
ダイドーグループ HD	10,100	2,650.00	26,765,000	貸付株式数 3,900 株
伊 藤 園	30,100	3,776.00	113,657,600	
キーコーヒー	9,900	2,044.00	20,235,600	貸付株式数 3,700 株
ユニカフェ	1,000	915.00	915,000	貸付株式数 300 株
ジャパンフーズ	500	1,991.00	995,500	貸付株式数 100 株
日清オイリオグループ	12,500	4,895.00	61,187,500	
不二製油グループ	20,700	2,505.00	51,853,500	
かどや製油	400	3,640.00	1,456,000	
Ｊ－オイルミルズ	10,200	1,928.00	19,665,600	
サンエー	7,300	4,885.00	35,660,500	貸付株式数 1,300 株
カワチ薬品	7,500	2,850.00	21,375,000	
エービーシー・マート	41,800	3,170.00	132,506,000	
ハードオフコーポレーション	3,800	1,997.00	7,588,600	
高千穂交易	3,400	3,720.00	12,648,000	貸付株式数 1,300 株
アスクル	23,000	2,196.00	50,508,000	貸付株式数 2,100 株
ゲオホールディングス	10,700	1,653.00	17,687,100	
アダストリア	11,500	3,705.00	42,607,500	
ジーフット	2,500	287.00	717,500	貸付株式数 1,000 株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	400	608.00	243,200	貸付株式数 100 株
オルバヘルスケア HLDGS	500	2,130.00	1,065,000	貸付株式数 200 株 (200 株)
伊藤忠食品	2,200	7,150.00	15,730,000	
くら寿司	11,200	4,705.00	52,696,000	
キャンドゥ	3,400	3,040.00	10,336,000	貸付株式数 1,200 株
エレマテック	8,500	1,992.00	16,932,000	
IK ホールディングス	1,100	390.00	429,000	貸付株式数 400 株
パルグループ HLDGS	18,700	1,831.00	34,239,700	
エディオン	37,800	1,581.00	59,761,800	
あらた	14,600	3,200.00	46,720,000	
サーラコーポレーション	20,100	803.00	16,140,300	
ワッツ	1,400	664.00	929,600	貸付株式数 500 株
トーメンデバイス	1,400	6,920.00	9,688,000	
ハローズ	4,300	4,250.00	18,275,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
JP ホールディングス	23,700	495.00	11,731,500	貸付株式数 1,200 株
フジオフードＧ本社	10,700	1,515.00	16,210,500	貸付株式数 4,200 株 (300 株)
あみやき亭	2,300	6,050.00	13,915,000	貸付株式数 800 株
東京エレクトロンデバイス	9,500	4,350.00	41,325,000	
ひらまつ	7,300	204.00	1,489,200	貸付株式数 2,900 株
円谷フィールズホールディ	16,400	1,539.00	25,239,600	貸付株式数 6,400 株
双日	106,200	3,941.00	418,534,200	
アルフレッサホールディングス	95,800	2,190.00	209,802,000	
大黒天物産	2,900	8,370.00	24,273,000	
ハニーズホールディングス	8,500	1,634.00	13,889,000	貸付株式数 3,300 株
ファーマライズ HD	700	634.00	443,800	貸付株式数 200 株
キッコーマン	294,300	1,846.50	543,424,950	
味 の 素	211,100	5,712.00	1,205,803,200	
ブルドツクソース	4,700	1,954.00	9,183,800	
キユーピー	47,700	3,117.00	148,680,900	
ハウス食品Ｇ本社	30,600	2,933.00	89,749,800	
カ ゴ メ	38,200	3,647.00	139,315,400	
アリアケジャパン	8,900	5,080.00	45,212,000	
ピエトロ	400	1,796.00	718,400	貸付株式数 100 株
エバラ食品工業	2,100	2,874.00	6,035,400	貸付株式数 200 株
やまみ	400	2,975.00	1,190,000	貸付株式数 100 株
ニチレイ	40,700	3,694.00	150,345,800	
横浜冷凍	24,000	1,011.00	24,264,000	
東洋水産	44,900	10,280.00	461,572,000	
イートアンド HLDGS	4,200	2,093.00	8,790,600	貸付株式数 1,300 株
大冷	400	1,915.00	766,000	
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,000	1,636.00	6,544,000	貸付株式数 1,400 株
日清食品ＨＤ	93,700	4,132.00	387,168,400	
永谷園ホールディングス	4,300	3,100.00	13,330,000	貸付株式数 1,600 株
一正蒲鉾	1,300	771.00	1,002,300	貸付株式数 400 株
フジッコ	9,100	1,852.00	16,853,200	貸付株式数 3,500 株
ロックフィールド	10,800	1,501.00	16,210,800	貸付株式数 4,200 株
日本たばこ産業	539,600	4,550.00	2,455,180,000	
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,810.00	11,041,000	
わらべや日洋 HD	5,900	2,354.00	13,888,600	貸付株式数 2,200 株
なとり	5,600	2,137.00	11,967,200	
イフジ産業	600	1,343.00	805,800	貸付株式数 200 株
ファーマフーズ	11,800	896.00	10,572,800	貸付株式数 4,600 株
北の達人コーポ	38,300	176.00	6,740,800	貸付株式数 14,900 株 (1,300 株)
ユーグレナ	55,400	535.00	29,639,000	貸付株式数 21,600 株
紀文食品	7,700	1,234.00	9,501,800	
ピックルスホールディングス	5,200	1,166.00	6,063,200	貸付株式数 1,900 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スター・マイカ・HLDGS	10,300	602.00	6,200,600	
SRE ホールディングス	3,800	4,400.00	16,720,000	貸付株式数 1,400 株
AD ワークスグループ	7,400	226.00	1,672,400	貸付株式数 100 株
片倉工業	8,300	2,100.00	17,430,000	
グ ン ゼ	6,400	5,430.00	34,752,000	
ヒューリック	207,300	1,497.00	310,328,100	
神 栄	500	1,893.00	946,500	貸付株式数 100 株
ラサ商事	4,300	1,718.00	7,387,400	貸付株式数 900 株
アルペン	7,900	2,050.00	16,195,000	貸付株式数 3,000 株
ハブ	1,000	883.00	883,000	貸付株式数 300 株
ラクーンホールディングス	6,700	621.00	4,160,700	
クオールホールディングス	13,100	1,496.00	19,597,600	
アルコニックス	12,600	1,435.00	18,081,000	
神戸物産	73,800	3,530.00	260,514,000	
ソリトンシステムズ	4,700	1,162.00	5,461,400	
ジンズホールディングス	7,300	3,705.00	27,046,500	貸付株式数 2,800 株
ビックカメラ	57,100	1,573.00	89,818,300	貸付株式数 19,600 株
DCM ホールディングス	49,400	1,534.00	75,779,600	
ペッパーフードサービス	24,100	130.00	3,133,000	貸付株式数 5,700 株
ハイパー	700	303.00	212,100	貸付株式数 200 株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	135,300	1,643.00	222,297,900	
東京一番フーズ	900	511.00	459,900	
ＤＤグループ	2,000	1,281.00	2,562,000	貸付株式数 800 株
あい ホールディングス	15,300	2,310.00	35,343,000	
ディーブイエックス	900	997.00	897,300	
きちりホールディングス	900	928.00	835,200	貸付株式数 300 株
J. フロント リテイリング	109,500	1,562.50	171,093,750	
ドトール・日レスＨＤ	16,900	2,162.00	36,537,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	173,600	2,207.00	383,135,200	
ブロンコビリー	5,600	4,075.00	22,820,000	貸付株式数 2,100 株
ＺＯＺＯ	60,800	3,791.00	230,492,800	
トレジャー・ファクトリー	5,900	1,696.00	10,006,400	
物語コーポレーション	15,900	3,515.00	55,888,500	貸付株式数 6,200 株
三越伊勢丹ＨＤ	158,000	3,134.00	495,172,000	
東洋紡	39,200	1,044.00	40,924,800	
ユニチカ	29,400	237.00	6,967,800	貸付株式数 11,100 株
富士紡ホールディングス	4,000	4,750.00	19,000,000	
日清紡ホールディングス	68,400	1,068.00	73,051,200	
倉敷紡績	6,400	4,385.00	28,064,000	
ダイワボウＨＤ	42,100	2,723.50	114,659,350	
シキボウ	5,800	1,083.00	6,281,400	貸付株式数 1,800 株
日東紡績	11,500	6,300.00	72,450,000	
トヨタ紡織	38,000	2,148.00	81,624,000	
マクニカホールディングス	22,600	6,676.00	150,877,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
Ｈａｍｅｅ	3,800	1,272.00	4,833,600	
マーケットエンタープライズ	300	821.00	246,300	
ラクト・ジャパン	3,700	2,850.00	10,545,000	貸付株式数 1,300株
ウエルシアＨＤ	49,500	2,134.50	105,657,750	
クリエイトＳＤＨ	13,500	3,370.00	45,495,000	貸付株式数 5,100株
グリムス	4,000	2,406.00	9,624,000	貸付株式数 1,500株
バイタルＫＳＫHD	14,400	1,287.00	18,532,800	
八洲電機	7,700	1,491.00	11,480,700	
メディアスホールディングス	5,500	949.00	5,219,500	貸付株式数 2,000株
レスター	8,100	3,020.00	24,462,000	
ジオリーブグループ	700	1,196.00	837,200	貸付株式数 200株
丸善CHI HD	3,900	337.00	1,314,300	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
大光	1,700	607.00	1,031,900	貸付株式数 600株
OCHIホールディングス	700	1,445.00	1,011,500	
TOKAIホールディングス	51,700	958.00	49,528,600	
黒谷	900	688.00	619,200	貸付株式数 300株 (300株)
ミサワ	700	625.00	437,500	
ティーライフ	400	1,410.00	564,000	貸付株式数 100株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	600	876.00	525,600	
エー・ピーホールディングス	800	950.00	760,000	貸付株式数 200株
三洋貿易	9,700	1,510.00	14,647,000	
チムニー	1,000	1,303.00	1,303,000	貸付株式数 300株
シュッピン	8,600	1,310.00	11,266,000	
ビューティガレージ	3,000	2,055.00	6,165,000	貸付株式数 100株
オイシックス・ラ・大地	12,800	1,262.00	16,153,600	貸付株式数 5,000株
ウイン・パートナーズ	6,100	1,172.00	7,149,200	貸付株式数 2,300株
ネクステージ	21,800	2,504.00	54,587,200	貸付株式数 7,600株 (300株)
ジョイフル本田	27,700	2,159.00	59,804,300	貸付株式数 10,600株
エターナルホスピタリティグル	3,500	3,735.00	13,072,500	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ホットランド	7,300	2,517.00	18,374,100	貸付株式数 2,500株
すかいらーくHD	130,500	2,252.00	293,886,000	貸付株式数 51,000株
SFPホールディングス	4,600	2,093.00	9,627,800	貸付株式数 1,600株
綿半ホールディングス	7,300	1,609.00	11,745,700	
日本毛織	23,200	1,340.00	31,088,000	
ダイトウボウ	4,700	103.00	484,100	貸付株式数 1,800株
トーア紡コーポレーション	1,100	433.00	476,300	貸付株式数 300株
ダイドーリミテツド	3,700	636.00	2,353,200	貸付株式数 1,400株
ヨシックスホールディングス	2,200	2,811.00	6,184,200	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ユナイテッド・スーパーマーケ	26,800	883.00	23,664,400	貸付株式数 10,400株
野村不動産HLDGS	49,500	4,204.00	208,098,000	
三重交通グループHD	18,900	577.00	10,905,300	貸付株式数 7,400株
地主	6,800	2,365.00	16,082,000	貸付株式数 200株
プレサンスコーポレーション	11,800	1,847.00	21,794,600	貸付株式数 4,500株
フィル・カンパニー	1,400	602.00	842,800	貸付株式数 500株
ハウスコム	500	982.00	491,000	貸付株式数 100株
ＪＰＭＣ	5,100	1,225.00	6,247,500	
サンセイランディック	900	1,008.00	907,200	貸付株式数 300株
エストラスト	300	702.00	210,600	
フージャースHD	13,700	1,121.00	15,357,700	
オープンハウスグループ	32,600	4,580.00	149,308,000	
東急不動産ＨＤ	267,100	1,132.00	302,357,200	
飯田ＧＨＤ	85,100	2,140.50	182,156,550	
イーグランド	400	1,543.00	617,200	貸付株式数 100株
帝国繊維	10,200	2,398.00	24,459,600	貸付株式数 3,900株
日本コークス工業	91,900	125.00	11,487,500	貸付株式数 17,800株
ゴルフダイジェスト・オン	4,300	529.00	2,274,700	貸付株式数 1,600株
ミタチ産業	900	1,112.00	1,000,800	貸付株式数 300株
ＢＥＥＮＯＳ	5,700	2,132.00	12,152,400	
あさひ	8,800	1,442.00	12,689,600	貸付株式数 1,800株
日本調剤	6,300	1,389.00	8,750,700	貸付株式数 2,300株
コスモス薬品	8,100	12,835.00	103,963,500	貸付株式数 3,100株 (100株)
シップヘルスケアHD	34,300	2,398.00	82,251,400	
トーエル	1,400	807.00	1,129,800	貸付株式数 100株
ソフトクリエイトHD	7,400	1,964.00	14,533,600	
セブン&アイ・HLDGS	977,000	2,059.50	2,012,131,500	
クリエイト・レストランツ・ホール	64,600	1,113.00	71,899,800	貸付株式数 25,200株
明治電機工業	3,500	1,624.00	5,684,000	
ツルハホールディングス	20,000	9,335.00	186,700,000	
デリカフーズHLDGS	1,400	571.00	799,400	
スターティアホールディングス	800	2,034.00	1,627,200	貸付株式数 300株
サンマルクホールディングス	7,700	2,157.00	16,608,900	
フェリシモ	800	926.00	740,800	貸付株式数 200株
トリドールホールディングス	26,700	3,665.00	97,855,500	貸付株式数 10,400株
帝 人	86,800	1,478.50	128,333,800	
東 レ	605,500	779.50	471,987,250	
ク ラ レ	131,600	1,810.00	238,196,000	
旭 化 成	611,300	1,014.50	620,163,850	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
TOKYO BASE	10,200	294.00	2,998,800	貸付株式数 3,800株
稲葉製作所	5,200	1,980.00	10,296,000	貸付株式数 2,000株
宮地エンジニアリングＧ	4,700	4,430.00	20,821,000	
トーカロ	26,800	1,884.00	50,491,200	
アルファCO	1,100	1,383.00	1,521,300	
ＳＵＭＣＯ	165,300	2,301.00	380,355,300	
川田テクノロジーズ	6,600	2,638.00	17,410,800	
RS TECHNOLOGIES	6,200	3,300.00	20,460,000	
ジェイテックコーポレーション	500	1,805.00	902,500	貸付株式数 200株
信和	2,000	737.00	1,474,000	貸付株式数 700株
ビーロット	2,000	890.00	1,780,000	貸付株式数 700株
ファーストブラザーズ	600	1,209.00	725,400	
AND DOホールディングス	5,300	1,168.00	6,190,400	貸付株式数 2,000株
シーアールイー	4,000	1,310.00	5,240,000	
ケイアイスター不動産	4,300	3,505.00	15,071,500	
アグレ都市デザイン	500	1,573.00	786,500	貸付株式数 200株
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,911.00	12,808,400	
ロードスターキャピタル	5,800	2,908.00	16,866,400	
テンポイノベーション	900	864.00	777,600	貸付株式数 300株
グロバルリンクマネジメント	600	2,131.00	1,278,600	貸付株式数 200株
フェイスネットワーク	800	1,620.00	1,296,000	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	3,600	16,430.00	59,148,000	貸付株式数 1,400株
住江織物	600	2,477.00	1,486,200	貸付株式数 200株 (200株)
日本フエルト	1,600	465.00	744,000	
イチカワ	400	1,758.00	703,200	
エコナックホールディングス	2,600	127.00	330,200	貸付株式数 1,000株
日東製網	300	1,481.00	444,300	貸付株式数 100株
芦森工業	600	2,425.00	1,455,000	
アツギ	2,100	635.00	1,333,500	
ウイルプラスHLDGS	600	1,051.00	630,600	貸付株式数 200株
JMホールディングス	7,200	2,844.00	20,476,800	
コメダホールディングス	23,400	2,673.00	62,548,200	
サツドラホールディングス	1,300	861.00	1,119,300	貸付株式数 500株
アレンザホールディングス	7,100	1,106.00	7,852,600	貸付株式数 2,600株
串カツ田中HLDGS	2,500	1,631.00	4,077,500	貸付株式数 900株
バロックジャパン	7,300	796.00	5,810,800	貸付株式数 2,900株
クスリのアオキHLDGS	28,700	3,188.00	91,495,600	
ダイニック	1,000	821.00	821,000	
共和レザー	1,800	770.00	1,386,000	
ピーバンドットコム	400	375.00	150,000	貸付株式数 100株
力の源HD	5,500	1,444.00	7,942,000	貸付株式数 2,100株
FOOD&LIFE COMPAN	50,900	2,729.50	138,931,550	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
アセンテック	3,700	567.00	2,097,900	
セーレン	17,400	2,440.00	42,456,000	貸付株式数 6,800株
ソトー	900	712.00	640,800	貸付株式数 300株
東海染工	300	841.00	252,300	
小松マテーレ	13,100	738.00	9,667,800	
ワコールホールディングス	18,500	3,910.00	72,335,000	
ホギメディカル	11,900	4,025.00	47,897,500	
クラウディアHLDGS	800	416.00	332,800	貸付株式数 300株
ＴＳＩホールディングス	27,100	951.00	25,772,100	貸付株式数 11,000株
マツオカコーポレーション	900	1,575.00	1,417,500	
ワールド	12,700	2,161.00	27,444,700	
ＴＩＳ	95,600	2,909.00	278,100,400	
テクミラホールディングス	1,300	390.00	507,000	貸付株式数 500株
グリー	30,200	520.00	15,704,000	
ＧＭＯペパボ	1,100	1,390.00	1,529,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモＨＤ	56,700	1,420.00	80,514,000	貸付株式数 22,100株
三菱総合研究所	4,400	4,660.00	20,504,000	
ボルテージ	800	254.00	203,200	貸付株式数 300株
電算	400	1,486.00	594,400	貸付株式数 100株
ＡＧＳ	1,200	1,000.00	1,200,000	貸付株式数 400株
ファインデックス	7,200	1,003.00	7,221,600	
ブレインパッド	7,500	1,070.00	8,025,000	貸付株式数 2,900株
ＫＬａｂ	16,600	212.00	3,519,200	貸付株式数 6,300株
ポールトゥウィンホールディン	15,400	457.00	7,037,800	
ネクソン	198,500	2,742.00	544,287,000	
アイスタイル	30,200	466.00	14,073,200	貸付株式数 11,800株
エムアップホールディングス	11,100	1,279.00	14,196,900	
エイチーム	5,900	691.00	4,076,900	貸付株式数 2,000株
エニグモ	11,600	339.00	3,932,400	
テクノスジャパン	2,700	627.00	1,692,900	
ｅｎｉｓｈ	3,200	251.00	803,200	貸付株式数 1,200株
コロプラ	30,700	580.00	17,806,000	貸付株式数 11,800株
オルトプラス	2,800	129.00	361,200	貸付株式数 1,100株
ブロードリーフ	42,900	518.00	22,222,200	貸付株式数 16,800株
クロス・マーケティングＧ	1,400	573.00	802,200	貸付株式数 500株
デジタルハーツHLDGS	5,600	1,043.00	5,840,800	貸付株式数 2,000株
メディアドゥ	4,100	1,446.00	5,928,600	貸付株式数 1,500株
じげん	26,400	619.00	16,341,600	
ブイキューブ	10,900	248.00	2,703,200	貸付株式数 4,000株
エンカレッジ・テクノロジ	700	621.00	434,700	貸付株式数 200株
サイバーリンクス	1,200	732.00	878,400	貸付株式数 400株
ディー・エル・イー	4,300	166.00	713,800	
フィックスターズ	9,100	1,770.00	16,107,000	貸付株式数 3,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
CARTA HOLDINGS	4,200	1,602.00	6,728,400	貸付株式数 1,600株
オプティム	9,300	694.00	6,454,200	貸付株式数 3,200株
セレス	3,700	1,936.00	7,163,200	貸付株式数 1,400株
ＳＨＩＦＴ	6,000	16,380.00	98,280,000	貸付株式数 100株
特種東海製紙	4,900	3,600.00	17,640,000	貸付株式数 1,700株
ティーガイア	9,500	1,917.00	18,211,500	
セック	1,200	4,210.00	5,052,000	
テクマトリックス	16,500	1,835.00	30,277,500	貸付株式数 6,400株
プロシップ	4,300	1,400.00	6,020,000	貸付株式数 700株
ガンホー・オンライン・エンター	23,500	2,825.50	66,399,250	
GMOペイメントゲートウェイ	20,700	7,382.00	152,807,400	
ザッパラス	700	430.00	301,000	貸付株式数 100株
システムリサーチ	6,200	1,554.00	9,634,800	貸付株式数 700株
インターネットイニシアティブ	43,300	2,255.00	97,641,500	
さくらインターネット	10,100	4,995.00	50,449,500	貸付株式数 3,900株
GMOグローバルサインHD	2,800	3,010.00	8,428,000	貸付株式数 1,000株
SRAホールディングス	4,600	4,025.00	18,515,000	
システムインテグレータ	900	366.00	329,400	
朝日ネット	9,700	649.00	6,295,300	
ｅＢＡＳＥ	12,800	675.00	8,640,000	貸付株式数 4,800株
アバントグループ	11,500	1,301.00	14,961,500	
アドソル日進	3,800	1,712.00	6,505,600	
ODKソリューションズ	600	602.00	361,200	貸付株式数 200株
フリービット	3,900	1,388.00	5,413,200	貸付株式数 100株
コムチュア	13,100	1,812.00	23,737,200	
アステリア	7,100	547.00	3,883,700	貸付株式数 2,700株
アイル	5,100	2,550.00	13,005,000	
王子ホールディングス	376,500	642.20	241,788,300	
日本製紙	51,000	965.00	49,215,000	
三菱製紙	4,100	722.00	2,960,200	貸付株式数 1,500株
北越コーポレーション	44,400	1,146.00	50,882,400	貸付株式数 17,300株
中越パルプ	1,200	1,532.00	1,838,400	貸付株式数 400株
巴川コーポレーション	800	993.00	794,400	貸付株式数 300株
大王製紙	40,000	851.50	34,060,000	
阿波製紙	800	529.00	423,200	貸付株式数 300株
マークラインズ	4,900	3,010.00	14,749,000	
メディカル・データ・ビジ	10,800	522.00	5,637,600	貸付株式数 4,200株
ｇｕｍｉ	14,700	360.00	5,292,000	貸付株式数 5,700株
ショーケース	700	301.00	210,700	貸付株式数 200株
モバイルファクトリー	600	671.00	402,600	貸付株式数 200株
テラスカイ	3,900	1,904.00	7,425,600	貸付株式数 1,500株
デジタル・インフォメーション	4,700	1,724.00	8,102,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
PCI ホールディングス	1,200	949.00	1,138,800	貸付株式数 200 株
アイビーシー	500	460.00	230,000	
ネオジャパン	3,000	1,482.00	4,446,000	
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	1,800	1,727.00	3,108,600	貸付株式数 700 株
ラクス	42,800	1,835.50	78,559,400	
ランドコンピュータ	1,400	810.00	1,134,000	
ダブルスタンダード	2,800	1,731.00	4,846,800	貸付株式数 1,000 株
オープンドア	5,300	613.00	3,248,900	貸付株式数 2,000 株
マイネット	900	340.00	306,000	貸付株式数 300 株
アカツキ	4,400	2,086.00	9,178,400	
ベネフィットジャパン	200	1,173.00	234,600	
UBICOM ホールディングス	2,800	1,227.00	3,435,600	貸付株式数 1,100 株
カナミックネットワーク	11,300	534.00	6,034,200	
ノムラシステムコーポレーション	3,200	129.00	412,800	貸付株式数 1,200 株
レンゴー	82,300	1,012.00	83,287,600	
トーモク	5,200	2,716.00	14,123,200	
ザ・パック	6,700	3,650.00	24,455,000	貸付株式数 2,600 株
チェンジホールディングス	19,700	1,275.00	25,117,500	
シンクロ・フード	1,900	555.00	1,054,500	
オークネット	3,300	2,367.00	7,811,100	貸付株式数 1,200 株
キャピタル・アセット・プラン	600	835.00	501,000	
セグエグループ	2,700	598.00	1,614,600	貸付株式数 1,000 株
エイトレッド	400	1,544.00	617,600	
マクロミル	17,800	865.00	15,397,000	
ビーグリー	600	1,089.00	653,400	
オロ	3,300	2,547.00	8,405,100	貸付株式数 1,200 株
ユーザーローカル	3,800	2,055.00	7,809,000	貸付株式数 1,400 株
テモナ	700	213.00	149,100	貸付株式数 200 株
ニーズウェル	3,200	365.00	1,168,000	
マネーフォワード	20,200	5,183.00	104,696,600	貸付株式数 5,900 株
サインポスト	1,200	661.00	793,200	貸付株式数 400 株
レゾナック・ホールディング	87,300	3,361.00	293,415,300	
住友化学	670,800	321.20	215,460,960	
住友精化	4,300	5,110.00	21,973,000	
日産化学	42,100	4,668.00	196,522,800	
ラサ工業	3,500	2,900.00	10,150,000	
クレハ	19,800	2,800.00	55,440,000	
多木化学	3,500	4,000.00	14,000,000	貸付株式数 1,300 株
テイカ	7,400	1,601.00	11,847,400	貸付株式数 2,100 株
石原産業	15,000	1,599.00	23,985,000	
片倉コープアグリ	700	1,136.00	795,200	貸付株式数 200 株
日本曹達	10,700	5,120.00	54,784,000	
東ソー	120,600	1,993.50	240,416,100	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
トクヤマ	29,200	2,917.50	85,191,000	
セントラル硝子	9,600	3,560.00	34,176,000	
東亜合成	43,500	1,502.50	65,358,750	
大阪ソーダ	6,300	9,390.00	59,157,000	貸付株式数 1,600株
関東電化	17,500	891.00	15,592,500	
SUN ASTERISK	6,400	836.00	5,350,400	貸付株式数 2,500株
デンカ	32,900	2,183.00	71,820,700	
イビデン	47,500	6,416.00	304,760,000	
信越化学	810,300	5,946.00	4,818,043,800	
日本カーバイド	4,300	1,878.00	8,075,400	
電算システムＨＤ	4,000	2,548.00	10,192,000	貸付株式数 1,500株
堺 化 学	6,900	2,694.00	18,588,600	
第一稀元素化学工	9,900	847.00	8,385,300	貸付株式数 3,800株
エア・ウォーター	85,300	2,166.50	184,802,450	
日本酸素HLDGS	87,700	4,465.00	391,580,500	
日本化学工業	3,300	2,310.00	7,623,000	
東邦アセチレン	3,200	360.00	1,152,000	
日本パーカライジング	40,300	1,207.00	48,642,100	
高圧ガス	13,300	916.00	12,182,800	貸付株式数 3,500株
チタン工業	400	1,010.00	404,000	貸付株式数 100株
四国化成ホールディンク	10,200	2,026.00	20,665,200	
戸田工業	2,100	1,923.00	4,038,300	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	4,900	4,115.00	20,163,500	
保土谷化学	2,800	5,030.00	14,084,000	
日本触媒	52,600	1,578.00	83,002,800	
大日精化	6,300	3,175.00	20,002,500	
カネカ	22,300	4,115.00	91,764,500	
協和キリン	109,300	2,704.00	295,547,200	
APPIER GROUP	31,000	1,285.00	39,835,000	
三菱瓦斯化学	66,000	2,842.00	187,572,000	
三井化学	74,500	4,726.00	352,087,000	
東京応化工業	43,100	3,925.00	169,167,500	
大阪有機化学	7,600	3,340.00	25,384,000	貸付株式数 2,900株
三菱ケミカルグループ	660,600	833.30	550,477,980	
ＫＨネオケム	13,800	2,256.00	31,132,800	
ビジョナル	10,600	7,820.00	82,892,000	貸付株式数 4,100株
ダイセル	116,200	1,548.00	179,877,600	
住友ベークライト	25,300	4,298.00	108,739,400	
積水化学	181,500	2,237.50	406,106,250	
日本ゼオン	61,900	1,422.50	88,052,750	
アイカ工業	22,800	3,372.00	76,881,600	
ＵＢＥ	43,000	2,777.50	119,432,500	
積水樹脂	13,500	2,418.00	32,643,000	
タキロンシーアイ	23,000	698.00	16,054,000	
旭有機材	6,000	4,700.00	28,200,000	貸付株式数 2,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ニチバン	4,900	1,802.00	8,829,800	
リケンテクノス	16,900	992.00	16,764,800	
大倉工業	4,200	2,986.00	12,541,200	
積水化成品	12,800	452.00	5,785,600	
群栄化学	2,100	3,155.00	6,625,500	
タイガース ポリマー	1,300	829.00	1,077,700	
ミライアル	1,000	1,487.00	1,487,000	貸付株式数 300株
ダイキアクシス	1,200	726.00	871,200	貸付株式数 400株
ダイキョーニシカワ	20,100	685.00	13,768,500	
竹本容器	1,100	863.00	949,300	
森六ホールディングス	4,700	2,741.00	12,882,700	
恵和	6,500	1,553.00	10,094,500	
日本化薬	69,100	1,239.00	85,614,900	
カーリットホールディングス	9,700	1,177.00	11,416,900	
ソルクシーズ	2,300	312.00	717,600	貸付株式数 900株
CLホールディングス	2,200	1,340.00	2,948,000	貸付株式数 800株
プレステージ・インター	43,400	650.00	28,210,000	貸付株式数 12,900株
フェイス	800	435.00	348,000	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	9,900	1,357.00	13,434,300	
ハイマックス	2,800	1,348.00	3,774,400	
アミューズ	5,700	1,603.00	9,137,100	
野村総合研究所	195,900	4,151.00	813,180,900	
ドリームインキュベータ	3,200	2,186.00	6,995,200	貸付株式数 1,200株
クイック	6,400	2,121.00	13,574,400	
ＴＡＣ	1,500	179.00	268,500	貸付株式数 500株
ＣＥホールディングス	1,400	592.00	828,800	
日本システム技術	7,500	1,570.00	11,775,000	
電通グループ	91,100	4,134.00	376,607,400	
インテージホールディングス	10,200	1,417.00	14,453,400	
テイクアンドギヴニーズ	4,000	912.00	3,648,000	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	3,800	1,404.00	5,335,200	
ぴあ	3,100	3,040.00	9,424,000	貸付株式数 500株
イオンファンタジー	3,300	2,288.00	7,550,400	貸付株式数 1,300株
ソースネクスト	41,400	199.00	8,238,600	貸付株式数 16,100株
シーティーエス	11,500	768.00	8,832,000	
NEXYZ.GROUP	1,000	605.00	605,000	貸付株式数 300株
インフォコム	11,700	5,350.00	62,595,000	
メディカルシステムネットワーク	10,300	619.00	6,375,700	
日本精化	6,000	2,634.00	15,804,000	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	9,600	3,805.00	36,528,000	
トリケミカル	10,900	3,825.00	41,692,500	
シンプレクスＨＤ	13,700	2,811.00	38,510,700	
ＨＥＲＯＺ	3,600	1,295.00	4,662,000	貸付株式数 1,400株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ラクスル	21,900	913.00	19,994,700	貸付株式数 8,000株
メルカリ	44,100	2,098.00	92,521,800	
ＩＰＳ	2,600	2,140.00	5,564,000	
ＦＩＧ	3,400	333.00	1,132,200	貸付株式数 1,300株
システムサポート	3,500	1,802.00	6,307,000	
ＡＤＥＫＡ	31,500	3,291.00	103,666,500	
日油	81,800	2,059.50	168,467,100	
ミヨシ油脂	1,100	1,365.00	1,501,500	
新日本理化	4,400	179.00	787,600	貸付株式数 1,600株
ハリマ化成グループ	6,200	871.00	5,400,200	
イーソル	6,500	858.00	5,577,000	貸付株式数 2,500株
東海ソフト	500	1,277.00	638,500	貸付株式数 200株
ウイングアーク1ST	9,400	2,779.00	26,122,600	
ヒト・コミュニケーションズHD	3,000	917.00	2,751,000	貸付株式数 1,100株
サーバーワークス	1,900	2,987.00	5,675,300	貸付株式数 300株
東名	300	2,466.00	739,800	貸付株式数 100株
ヴィッツ	300	794.00	238,200	貸付株式数 100株
トビラシステムズ	900	772.00	694,800	貸付株式数 100株
Ｓａｎｓａｎ	29,700	1,635.00	48,559,500	
LINK-Uグループ	600	649.00	389,400	
ギフティ	7,900	1,046.00	8,263,400	貸付株式数 3,100株
花 王	204,300	6,960.00	1,421,928,000	
第一工業製薬	3,600	3,900.00	14,040,000	
石原ケミカル	4,000	1,873.00	7,492,000	
日華化学	1,200	1,082.00	1,298,400	貸付株式数 400株
ニイタカ	600	1,891.00	1,134,600	貸付株式数 200株
三洋化成	5,600	3,965.00	22,204,000	
メドレー	12,200	3,525.00	43,005,000	貸付株式数 2,700株
ベース	3,200	2,878.00	9,209,600	貸付株式数 1,000株
ＪＭＤＣ	15,400	3,030.00	46,662,000	貸付株式数 6,000株
武田薬品	800,700	4,215.00	3,374,950,500	
アステラス製薬	793,500	1,594.50	1,265,235,750	
住友ファーマ	67,200	349.00	23,452,800	貸付株式数 26,200株
塩野義製薬	110,000	7,208.00	792,880,000	
わかもと製薬	3,200	251.00	803,200	
日本新薬	23,700	3,083.00	73,067,100	
中外製薬	283,200	4,814.00	1,363,324,800	
科研製薬	15,500	3,855.00	59,752,500	
エーザイ	110,100	7,080.00	779,508,000	
理研ビタミン	7,700	2,634.00	20,281,800	
ロート製薬	87,600	2,980.50	261,091,800	
小野薬品	185,100	2,240.00	414,624,000	
久光製薬	20,100	3,786.00	76,098,600	
有機合成薬品	2,300	304.00	699,200	貸付株式数 600株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
持田製薬	10,100	3,075.00	31,057,500	貸付株式数　2,100株
参天製薬	159,600	1,641.00	261,903,600	
扶桑薬品	3,200	2,288.00	7,321,600	
日本ケミファ	400	1,565.00	626,000	
ツムラ	28,500	4,027.00	114,769,500	
テ ル モ	502,900	2,683.00	1,349,280,700	
ＨＵグループＨＤ	27,200	2,468.50	67,143,200	
キッセイ薬品工業	15,000	3,160.00	47,400,000	
生化学工業	15,400	819.00	12,612,600	
栄研化学	15,600	2,006.00	31,293,600	
鳥居薬品	4,900	3,765.00	18,448,500	
ＪＣＲファーマ	30,700	567.00	17,406,900	
東和薬品	13,900	2,908.00	40,421,200	
富士製薬工業	6,700	1,481.00	9,922,700	
ゼリア新薬工業	12,500	2,044.00	25,550,000	
ネクセラファーマ	39,600	1,496.00	59,241,600	
第一三共	788,200	5,575.00	4,394,215,000	
杏林製薬	19,600	1,674.00	32,810,400	
大幸薬品	18,800	375.00	7,050,000	貸付株式数　6,800株
ダイト	6,900	2,234.00	15,414,600	
大塚ホールディングス	188,200	6,567.00	1,235,909,400	
ペプチドリーム	43,900	2,082.50	91,421,750	
大日本塗料	10,000	1,204.00	12,040,000	
日本ペイントHOLD	479,800	1,102.50	528,979,500	
関西ペイント	78,100	2,634.50	205,754,450	
神東塗料	3,000	126.00	378,000	貸付株式数　900株
中国塗料	18,500	1,979.00	36,611,500	
日本特殊塗料	2,200	1,272.00	2,798,400	
藤倉化成	10,400	527.00	5,480,800	
太陽ホールディングス	15,700	3,090.00	48,513,000	
ＤＩＣ	35,300	3,220.00	113,666,000	
サカタインクス	20,100	1,769.00	35,556,900	
ARTIENCE	19,600	3,280.00	64,288,000	
アルプス技研	8,800	2,578.00	22,686,400	貸付株式数　1,100株
サニックス	14,800	279.00	4,129,200	
日本空調サービス	10,000	996.00	9,960,000	
オリエンタルランド	490,700	4,578.00	2,246,424,600	
フォーカスシステムズ	6,000	1,101.00	6,606,000	
ダスキン	20,200	3,708.00	74,901,600	
パーク２４	57,700	1,624.50	93,733,650	
明光ネットワークジャパン	11,200	723.00	8,097,600	貸付株式数　4,400株
ファルコホールディングス	4,100	2,294.00	9,405,400	
クレスコ	7,400	2,350.00	17,390,000	
フジ・メディア・HD	86,900	1,835.50	159,504,950	
秀英予備校	700	303.00	212,100	貸付株式数　200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
田谷	500	388.00	194,000	
ラウンドワン	87,400	755.00	65,987,000	
リゾートトラスト	40,300	2,419.50	97,505,850	
オービック	30,200	20,130.00	607,926,000	
ジャストシステム	13,000	2,863.00	37,219,000	
ＴＤＣソフト	16,900	1,026.00	17,339,400	
ＬＩＮＥヤフー	1,288,200	380.60	490,288,920	
ビー・エム・エル	11,400	2,755.00	31,407,000	
トレンドマイクロ	42,800	7,007.00	299,899,600	
ID ホールディングス	6,100	1,432.00	8,735,200	
リソー教育	47,300	244.00	11,541,200	
日本オラクル	17,300	11,355.00	196,441,500	
早稲田アカデミー	5,100	1,557.00	7,940,700	貸付株式数 2,000 株 (200 株)
アルファシステムズ	2,400	2,834.00	6,801,600	
フューチャー	19,300	1,500.00	28,950,000	
CAC HOLDINGS	4,800	1,928.00	9,254,400	
ＳＢテクノロジー	3,700	2,947.00	10,903,900	
トーセ	800	689.00	551,200	貸付株式数 100 株
ユー・エス・エス	208,100	1,268.50	263,974,850	
オービックビジネスＣ	12,700	6,344.00	80,568,800	
アイティフォー	11,600	1,379.00	15,996,400	
東京個別指導学院	11,000	411.00	4,521,000	貸付株式数 4,200 株
東計電算	2,500	3,755.00	9,387,500	
サイバーエージェント	205,000	967.20	198,276,000	
楽天グループ	795,900	829.20	659,960,280	貸付株式数 311,000 株
エックスネット	400	1,489.00	595,600	貸付株式数 100 株
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,719.00	8,079,300	
SBI グローバルアセット	18,100	677.00	12,253,700	
テー・オー・ダブリュー	18,100	359.00	6,497,900	
大塚商会	89,700	2,878.00	258,156,600	
サイボウズ	12,500	1,811.00	22,637,500	貸付株式数 4,800 株
山田コンサルティング GP	4,000	1,912.00	7,648,000	
セントラルスポーツ	3,500	2,506.00	8,771,000	貸付株式数 1,100 株
パラカ	2,800	1,993.00	5,580,400	
電通総研	11,000	5,300.00	58,300,000	
ＡＣＣＥＳＳ	9,400	1,488.00	13,987,200	貸付株式数 3,600 株
デジタルガレージ	14,500	2,419.00	35,075,500	
イーエムシステムズ	15,100	640.00	9,664,000	貸付株式数 5,700 株
ウェザーニューズ	2,800	4,575.00	12,810,000	貸付株式数 1,000 株
ＣＩＪ	22,500	449.00	10,102,500	
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,330.00	6,327,000	
日本エンタープライズ	3,000	131.00	393,000	貸付株式数 1,100 株
ＷＯＷＯＷ	6,900	1,072.00	7,396,800	貸付株式数 2,500 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スカラ	8,200	711.00	5,830,200	
インテリジェント ウェイブ	1,600	1,050.00	1,680,000	
フルキャストホールディングス	8,900	1,494.00	13,296,600	
エン・ジャパン	15,100	2,561.00	38,671,100	
セルソース	3,300	1,274.00	4,204,200	貸付株式数 1,300株
あすか製薬ＨＤ	9,300	2,295.00	21,343,500	
サワイグループHD	20,700	5,958.00	123,330,600	
富士フイルムHLDGS	503,500	3,607.00	1,816,124,500	
コニカミノルタ	203,400	474.60	96,533,640	
資 生 堂	188,900	5,148.00	972,457,200	
ライオン	115,100	1,275.00	146,752,500	
高砂香料	6,800	3,665.00	24,922,000	
マンダム	19,500	1,220.00	23,790,000	
ミルボン	12,300	3,379.00	41,561,700	
ファンケル	39,600	1,981.00	78,447,600	
コーセー	18,400	10,640.00	195,776,000	
コタ	9,100	1,455.00	13,240,500	
シーボン	400	1,401.00	560,400	
ポーラ・オルビスHD	46,400	1,374.00	63,753,600	貸付株式数 18,100株
ノエビアホールディングス	8,100	5,510.00	44,631,000	
アジュバンホールディング	700	868.00	607,600	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,200	1,661.00	8,637,200	
アクシージア	5,900	986.00	5,817,400	貸付株式数 2,300株
エステー	7,000	1,550.00	10,850,000	
アグロカネショウ	3,600	1,204.00	4,334,400	貸付株式数 1,000株
コ ニ シ	26,200	1,193.00	31,256,600	貸付株式数 5,600株
長谷川香料	17,300	3,045.00	52,678,500	貸付株式数 6,600株
小林製薬	26,300	5,559.00	146,201,700	貸付株式数 10,200株
荒川化学工業	7,800	1,111.00	8,665,800	
メック	7,400	4,170.00	30,858,000	貸付株式数 100株
日本高純度化学	2,000	3,180.00	6,360,000	
タカラバイオ	24,400	1,002.00	24,448,800	
ＪＣＵ	10,000	3,585.00	35,850,000	
新田ゼラチン	2,000	793.00	1,586,000	貸付株式数 700株
ＯＡＴアグリオ	3,300	1,511.00	4,986,300	貸付株式数 1,300株
デクセリアルズ	22,300	6,651.00	148,317,300	
アース製薬	8,200	4,705.00	38,581,000	貸付株式数 3,200株
北興化学	9,100	1,509.00	13,731,900	
大成ラミック	2,600	2,810.00	7,306,000	
クミアイ化学	35,800	771.00	27,601,800	
日本農薬	16,600	751.00	12,466,600	
富士興産	900	1,673.00	1,505,700	
ニチレキ	11,700	2,370.00	27,729,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ユシロ化学	4,700	1,724.00	8,102,800	
ビーピー・カストロール	1,100	979.00	1,076,900	
富士石油	26,300	494.00	12,992,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,100	1,356.00	1,491,600	貸付株式数 400株 (400株)
出光興産	469,800	1,039.50	488,357,100	
ENEOSホールディングス	1,432,400	777.20	1,113,261,280	
コスモエネルギーHLDGS	26,800	7,514.00	201,375,200	
テスホールディングス	19,100	418.00	7,983,800	貸付株式数 6,700株
インフロニアＨＤ	102,000	1,333.50	136,017,000	
横浜ゴム	45,700	3,742.00	171,009,400	
TOYO TIRE	51,900	2,753.50	142,906,650	
ブリヂストン	264,800	6,675.00	1,767,540,000	
住友ゴム	88,700	1,731.00	153,539,700	
藤倉コンポジット	7,800	1,382.00	10,779,600	
オカモト	4,300	4,760.00	20,468,000	
アキレス	5,700	1,611.00	9,182,700	
フ コ ク	4,700	2,178.00	10,236,600	
ニッタ	9,200	4,005.00	36,846,000	
クリエートメディック	1,000	980.00	980,000	
住友理工	14,000	1,268.00	17,752,000	
三ツ星ベルト	10,400	4,315.00	44,876,000	貸付株式数 100株
バンドー化学	13,400	1,804.00	24,173,600	
ＡＧＣ	80,700	5,401.00	435,860,700	
日本板硝子	43,200	456.00	19,699,200	貸付株式数 16,800株
石塚硝子	500	2,878.00	1,439,000	貸付株式数 100株
有沢製作所	15,800	1,502.00	23,731,600	
日本山村硝子	1,100	1,721.00	1,893,100	貸付株式数 400株
日本電気硝子	36,900	3,726.00	137,489,400	
オハラ	4,300	1,375.00	5,912,500	貸付株式数 100株
住友大阪セメント	15,100	3,810.00	57,531,000	
太平洋セメント	53,500	3,911.00	209,238,500	
リソルホールディングス	300	4,865.00	1,459,500	貸付株式数 100株
日本ヒューム	7,900	1,080.00	8,532,000	貸付株式数 2,900株
日本コンクリート	17,500	356.00	6,230,000	
三谷セキサン	3,800	5,470.00	20,786,000	
アジアパイルＨＤ	12,800	965.00	12,352,000	
東海カーボン	83,500	974.50	81,370,750	
日本カーボン	4,800	5,420.00	26,016,000	
東洋炭素	6,400	6,600.00	42,240,000	
ノリタケ	10,000	3,930.00	39,300,000	
ＴＯＴＯ	59,700	3,921.00	234,083,700	
日本碍子	105,200	2,047.50	215,397,000	
日本特殊陶業	75,800	4,708.00	356,866,400	
ダントーホールディングス	2,000	830.00	1,660,000	貸付株式数 700株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ＭＡＲＵＷＡ	3,300	34,250.00	113,025,000	
品川リフラクトリーズ	11,100	1,952.00	21,667,200	
黒崎播磨	7,400	3,015.00	22,311,000	貸付株式数　2,100株
ヨータイ	5,300	1,760.00	9,328,000	
東京窯業	3,200	432.00	1,382,400	
ニッカトー	1,400	564.00	789,600	
フジミインコーポレーテッド	24,300	3,025.00	73,507,500	
クニミネ工業	900	1,144.00	1,029,600	貸付株式数　300株
エーアンドエーマテリアル	600	1,370.00	822,000	
ニチアス	22,900	4,510.00	103,279,000	
日本製鉄	417,200	3,343.00	1,394,699,600	
神戸製鋼所	187,200	1,965.50	367,941,600	
中山製鋼所	21,300	930.00	19,809,000	貸付株式数　8,300株
合同製鐵	5,200	5,120.00	26,624,000	
ＪＦＥホールディングス	258,900	2,275.00	588,997,500	
東京製鐵	26,200	1,639.00	42,941,800	
共英製鋼	10,600	2,119.00	22,461,400	
大和工業	17,500	8,064.00	141,120,000	
東京鐵鋼	4,100	5,200.00	21,320,000	
大阪製鐵	4,300	2,435.00	10,470,500	貸付株式数　800株
淀川製鋼所	10,600	5,510.00	58,406,000	
中部鋼鈑	6,100	2,737.00	16,695,700	
丸一鋼管	28,300	3,780.00	106,974,000	
モリ工業	2,100	5,090.00	10,689,000	
大同特殊鋼	58,600	1,554.50	91,093,700	
日本高周波	1,200	444.00	532,800	貸付株式数　400株
日本冶金工	6,800	4,770.00	32,436,000	
山陽特殊製鋼	9,200	2,164.00	19,908,800	
愛知製鋼	5,400	3,630.00	19,602,000	
日本金属	800	743.00	594,400	貸付株式数　300株
ミガロホールディングス	400	3,420.00	1,368,000	貸付株式数　100株
大平洋金属	7,900	1,260.00	9,954,000	貸付株式数　2,200株
新日本電工	46,300	281.00	13,010,300	
栗本鉄工所	4,300	4,870.00	20,941,000	
虹　技	400	1,180.00	472,000	
日本鋳鉄管	300	1,440.00	432,000	貸付株式数　100株
日本製鋼所	25,100	4,492.00	112,749,200	
三菱製鋼	6,900	1,480.00	10,212,000	
日亜鋼業	3,300	312.00	1,029,600	
日本精線	7,300	1,252.00	9,139,600	貸付株式数　500株
エンビプロＨＤ	8,200	512.00	4,198,400	貸付株式数　3,100株
大紀アルミニウム	11,800	1,286.00	15,174,800	
日本軽金属ＨＤ	27,200	1,818.00	49,449,600	
三井金属	27,100	4,843.00	131,245,300	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東邦亜鉛	5,900	818.00	4,826,200	貸付株式数　2,200株
三菱マテリアル	66,500	2,923.00	194,379,500	
住友鉱山	107,900	4,766.00	514,251,400	
DOWAホールディングス	23,000	5,628.00	129,444,000	
古河機金	12,300	1,883.00	23,160,900	
エス・サイエンス	17,900	23.00	411,700	貸付株式数　7,100株
大阪チタニウム	16,100	2,978.00	47,945,800	貸付株式数　6,000株
東邦チタニウム	19,200	1,256.00	24,115,200	貸付株式数　7,500株
ＵＡＣＪ	13,000	4,285.00	55,705,000	
ＣＫサンエツ	2,300	3,785.00	8,705,500	貸付株式数　600株
古河電工	31,000	4,097.00	127,007,000	
住友電工	348,200	2,488.00	866,321,600	
フジクラ	109,800	3,046.00	334,450,800	
ＳＷＣＣ	10,400	4,325.00	44,980,000	
タツタ電線	16,400	715.00	11,726,000	貸付株式数　900株
カナレ電気	500	1,550.00	775,000	
平河ヒューテック	5,900	1,415.00	8,348,500	貸付株式数　1,500株
いよぎんホールディンク	105,700	1,407.00	148,719,900	
しずおかフィナンシャルク	197,400	1,550.00	305,970,000	
ちゅうぎんフィナンシャ	74,800	1,605.00	120,054,000	
楽天銀行	41,200	2,675.00	110,210,000	
京都フィナンシャルＧ	111,800	2,723.00	304,431,400	
リョービ	9,900	2,381.00	23,571,900	
アーレステイ	3,400	691.00	2,349,400	貸付株式数　1,200株
AREホールディングス	35,000	2,043.00	71,505,000	
東洋製罐グループHD	53,400	2,538.50	135,555,900	
ホッカンホールディングス	4,600	1,640.00	7,544,000	
コロナ	5,200	917.00	4,768,400	
横河ブリッジHLDGS	14,600	2,754.00	40,208,400	
駒井ハルテック	600	1,794.00	1,076,400	
高田機工	200	3,620.00	724,000	
三和ホールディングス	92,700	2,817.00	261,135,900	
文化シヤツター	24,300	1,787.00	43,424,100	貸付株式数　400株
三協立山	11,700	802.00	9,383,400	貸付株式数　3,500株
アルインコ	7,000	1,087.00	7,609,000	貸付株式数　1,100株
東洋シヤツター	700	949.00	664,300	貸付株式数　200株
ＬＩＸＩＬ	145,300	1,713.00	248,898,900	
日本フイルコン	2,000	522.00	1,044,000	貸付株式数　700株
ノーリツ	14,700	1,750.00	25,725,000	貸付株式数　900株
長府製作所	9,300	2,147.00	19,967,100	
リンナイ	44,500	3,674.00	163,493,000	
ユニプレス	16,200	1,391.00	22,534,200	
ダイニチ工業	1,600	674.00	1,078,400	貸付株式数　500株
日東精工	13,400	577.00	7,731,800	
三洋工業	300	3,255.00	976,500	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
岡 部	16,500	775.00	12,787,500	
ジーテクト	11,800	1,858.00	21,924,400	
東 プ レ	16,400	2,176.00	35,686,400	
高周波熱錬	13,700	1,077.00	14,754,900	貸付株式数 2,600 株
東京製綱	6,000	1,290.00	7,740,000	
サンコール	9,400	439.00	4,126,600	
モリテックスチル	2,800	234.00	655,200	貸付株式数 1,000 株
パイオラックス	11,500	2,201.00	25,311,500	
エイチワン	9,600	850.00	8,160,000	貸付株式数 3,600 株
日本発条	82,400	1,680.50	138,473,200	
中央発條	6,900	1,154.00	7,962,600	
アドバネクス	400	1,058.00	423,200	貸付株式数 100 株
三浦工業	38,100	3,192.00	121,615,200	
タ ク マ	30,800	1,631.00	50,234,800	
テクノプロ・ホールディング	54,300	2,687.50	145,931,250	
アトラグループ	900	161.00	144,900	貸付株式数 100 株
アイ・アールジャパン HD	4,800	1,231.00	5,908,800	貸付株式数 1,800 株
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,700	4,000.00	22,800,000	貸付株式数 2,200 株
ファーストロジック	900	505.00	454,500	
三機サービス	500	1,152.00	576,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	7,300	724.00	5,285,200	貸付株式数 2,800 株
デザインワン・ジャパン	1,000	145.00	145,000	貸付株式数 400 株
イー・ガーディアン	4,400	1,945.00	8,558,000	
リブセンス	1,400	222.00	310,800	貸付株式数 500 株
ジャパンマテリアル	28,400	1,895.00	53,818,000	
ベクトル	11,100	1,313.00	14,574,300	貸付株式数 4,200 株
ウチヤマホールディングス	1,300	341.00	443,300	貸付株式数 500 株 (400 株)
チャームケアコーポレーション	7,700	1,550.00	11,935,000	
キャリアリンク	3,400	2,355.00	8,007,000	
ＩＢＪ	7,100	606.00	4,302,600	貸付株式数 2,600 株
アサンテ	4,500	1,699.00	7,645,500	貸付株式数 1,700 株
バリューＨＲ	8,100	1,496.00	12,117,600	貸付株式数 3,000 株
M&A キャピタルパートナー	7,500	2,274.00	17,055,000	
ライドオンエクスプレス HD	3,700	1,048.00	3,877,600	
ERI ホールディングス	900	2,277.00	2,049,300	貸付株式数 300 株
アビスト	500	3,320.00	1,660,000	貸付株式数 100 株
シグマクシス・ホールディンク	12,200	1,432.00	17,470,400	
ウィルグループ	7,600	958.00	7,280,800	
エスクローＡＪ	3,600	140.00	504,000	
メドピア	7,400	589.00	4,358,600	貸付株式数 2,800 株
レアジョブ	600	450.00	270,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
リクルートホールディングス	667,900	7,857.00	5,247,690,300	
エラン	12,300	856.00	10,528,800	
ツ ガ ミ	20,200	1,414.00	28,562,800	
オークマ	8,000	6,563.00	52,504,000	
芝浦機械	9,100	3,475.00	31,622,500	
アマダ	138,100	1,747.50	241,329,750	
アイダエンジニア	21,000	877.00	18,417,000	
ＦＵＪＩ	42,900	2,453.50	105,255,150	
牧野フライス	10,100	6,610.00	66,761,000	
オーエスジー	40,100	1,907.50	76,490,750	
ダイジェット	300	832.00	249,600	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	21,000	879.00	18,459,000	
DMG森精機	62,200	4,321.00	268,766,200	
ソディツク	22,000	709.00	15,598,000	
ディスコ	43,900	57,230.00	2,512,397,000	
日東工器	4,400	2,366.00	10,410,400	
日進工具	8,500	964.00	8,194,000	貸付株式数 600株
パンチ工業	2,900	465.00	1,348,500	貸付株式数 1,100株
冨士ダイス	6,100	775.00	4,727,500	貸付株式数 100株
土木管理総合試験	1,400	323.00	452,200	
日本郵政	969,400	1,488.50	1,442,951,900	
ベルシステム24HLDGS	10,000	1,543.00	15,430,000	
鎌倉新書	7,900	544.00	4,297,600	貸付株式数 3,000株 (1,300株)
ＳＭＮ	600	312.00	187,200	
一蔵	400	577.00	230,800	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	600	666.00	399,600	
エアトリ	6,800	1,305.00	8,874,000	貸付株式数 2,600株
アトラエ	7,000	674.00	4,718,000	
ストライク	4,600	4,340.00	19,964,000	
ソラスト	25,700	479.00	12,310,300	貸付株式数 9,800株
セラク	2,900	1,126.00	3,265,400	貸付株式数 1,000株
インソース	20,100	937.00	18,833,700	貸付株式数 4,800株
豊田自動織機	76,900	14,255.00	1,096,209,500	
豊和工業	1,600	804.00	1,286,400	貸付株式数 600株
石川製作所	800	1,550.00	1,240,000	貸付株式数 300株
リケンＮＰＲ	9,900	2,665.00	26,383,500	
東洋機械金属	2,500	709.00	1,772,500	
津田駒工業	500	410.00	205,000	貸付株式数 200株
エンシュウ	700	724.00	506,800	
島精機製作所	14,500	1,511.00	21,909,500	貸付株式数 5,500株
オプトラン	14,900	2,004.00	29,859,600	
NCホールディングス	700	2,119.00	1,483,300	
イワキポンプ	6,100	2,545.00	15,524,500	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
フリュー	8,600	1,058.00	9,098,800	
ヤマシンフィルタ	21,700	353.00	7,660,100	貸付株式数 8,300株
日阪製作所	9,900	1,012.00	10,018,800	
やまびこ	14,800	2,041.00	30,206,800	
野村マイクロ・サイエンス	12,300	4,440.00	54,612,000	貸付株式数 4,800株
平田機工	4,400	6,630.00	29,172,000	貸付株式数 500株
ＰＥＧＡＳＵＳ	10,000	530.00	5,300,000	
マルマエ	4,000	2,090.00	8,360,000	貸付株式数 1,500株
タツモ	5,500	3,550.00	19,525,000	貸付株式数 2,100株
ナブテスコ	57,200	2,582.50	147,719,000	
三井海洋開発	11,500	2,642.00	30,383,000	貸付株式数 3,000株
レオン自動機	10,500	1,544.00	16,212,000	
ＳＭＣ	27,300	77,100.00	2,104,830,000	
ホソカワミクロン	6,300	4,300.00	27,090,000	
ユニオンツール	4,000	5,580.00	22,320,000	
瑞 光	6,500	1,029.00	6,688,500	貸付株式数 2,500株
オイレス工業	12,300	2,249.00	27,662,700	
日精エーエスビー	3,100	4,975.00	15,422,500	
サトーホールディングス	13,000	2,138.00	27,794,000	
技研製作所	8,600	1,852.00	15,927,200	貸付株式数 3,300株
日本エアーテック	4,200	1,181.00	4,960,200	
カ ワ タ	900	897.00	807,300	
日精樹脂工業	6,600	1,015.00	6,699,000	
オカダアイヨン	1,000	2,423.00	2,423,000	
ワイエイシイホールディングス	3,800	2,349.00	8,926,200	貸付株式数 1,500株
小松製作所	427,100	4,539.00	1,938,606,900	
住友重機械	53,900	4,074.00	219,588,600	
日立建機	36,300	4,123.00	149,664,900	
日 工	13,600	723.00	9,832,800	
巴工業	3,500	4,390.00	15,365,000	貸付株式数 1,300株
井関農機	8,500	1,015.00	8,627,500	貸付株式数 3,300株
ＴＯＷＡ	10,100	10,710.00	108,171,000	
丸山製作所	500	2,316.00	1,158,000	
北川鉄工所	3,600	1,393.00	5,014,800	
シンニッタン	3,900	234.00	912,600	
ローツェ	4,800	28,550.00	137,040,000	
タカキタ	1,000	464.00	464,000	貸付株式数 100株
クボタ	476,300	2,149.00	1,023,568,700	
荏原実業	4,800	3,420.00	16,416,000	
東洋エンジニア	13,000	893.00	11,609,000	
三菱化工機	3,200	3,980.00	12,736,000	
月島ホールディングス	12,300	1,366.00	16,801,800	
帝国電機製作所	6,200	2,344.00	14,532,800	
東京機械	800	405.00	324,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
新東工業	18,400	1,059.00	19,485,600	
渋谷工業	8,500	3,655.00	31,067,500	
アイチ コーポレーション	12,600	1,141.00	14,376,600	
小森コーポレーション	22,400	1,266.00	28,358,400	
鶴見製作所	7,000	4,230.00	29,610,000	
日本ギア工業	1,100	540.00	594,000	貸付株式数 400株
酒井重工業	1,600	5,830.00	9,328,000	
荏原製作所	37,400	11,190.00	418,506,000	
石井鉄工所	300	2,780.00	834,000	
酉島製作所	7,800	3,295.00	25,701,000	
北越工業	9,200	2,165.00	19,918,000	貸付株式数 3,500株
ダイキン工業	108,800	23,165.00	2,520,352,000	
オルガノ	10,900	8,130.00	88,617,000	
トーヨーカネツ	3,100	3,815.00	11,826,500	
栗田工業	51,000	6,522.00	332,622,000	
椿本チエイン	12,500	5,720.00	71,500,000	
大同工業	1,300	823.00	1,069,900	
日 機 装	21,000	1,170.00	24,570,000	
木村化工機	6,900	678.00	4,678,200	
レイズネクスト	12,800	1,808.00	23,142,400	
アネスト岩田	14,000	1,405.00	19,670,000	
ダイフク	153,800	2,836.50	436,253,700	
サムコ	2,200	4,235.00	9,317,000	貸付株式数 800株
加藤製作所	1,600	1,259.00	2,014,400	
油研工業	500	2,364.00	1,182,000	
タダノ	52,400	1,093.50	57,299,400	
フジテック	21,300	4,071.00	86,712,300	
ＣＫＤ	25,200	3,045.00	76,734,000	
平和	27,000	2,039.00	55,053,000	
理想科学工業	7,300	3,215.00	23,469,500	貸付株式数 900株
ＳＡＮＫＹＯ	87,700	1,554.00	136,285,800	
日本金銭機械	11,000	1,229.00	13,519,000	貸付株式数 4,300株
マースグループ HLDGS	4,500	3,790.00	17,055,000	
フクシマガリレイ	6,000	6,080.00	36,480,000	
オーイズミ	1,100	354.00	389,400	貸付株式数 400株
ダイコク電機	4,500	3,975.00	17,887,500	貸付株式数 1,700株
竹内製作所	16,500	5,720.00	94,380,000	
ア マ ノ	25,900	3,890.00	100,751,000	
ＪＵＫＩ	14,000	489.00	6,846,000	貸付株式数 5,500株
サンデン	4,300	166.00	713,800	貸付株式数 1,700株
ジャノメ	9,200	680.00	6,256,000	
ブラザー工業	121,700	3,025.00	368,142,500	
マックス	12,800	3,695.00	47,296,000	
モリタホールディングス	15,800	1,810.00	28,598,000	
グローリー	21,900	2,725.50	59,688,450	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
新晃工業	9,200	3,705.00	34,086,000	
大和冷機工業	14,000	1,505.00	21,070,000	
セガサミーホールディングス	81,400	2,292.50	186,609,500	
ＴＰＲ	11,600	2,349.00	27,248,400	貸付株式数 1,000株
ツバキ・ナカシマ	18,200	780.00	14,196,000	
ホシザキ	53,800	5,784.00	311,179,200	
大豊工業	8,000	796.00	6,368,000	
日本精工	168,700	749.70	126,474,390	
Ｎ Ｔ Ｎ	197,500	317.40	62,686,500	
ジェイテクト	81,100	1,104.00	89,534,400	
不 二 越	6,700	3,425.00	22,947,500	貸付株式数 2,500株
ミネベアミツミ	158,500	3,149.00	499,116,500	
日本トムソン	24,700	590.00	14,573,000	
Ｔ Ｈ Ｋ	52,600	2,997.50	157,668,500	
ユーシン精機	7,100	710.00	5,041,000	
前澤給装工業	6,500	1,336.00	8,684,000	
イーグル工業	10,100	1,843.00	18,614,300	
前澤工業	1,900	1,337.00	2,540,300	
日本ピラー工業	8,400	5,110.00	42,924,000	
キッツ	30,500	1,111.00	33,885,500	
日 立	437,900	15,960.00	6,988,884,000	
三菱電機	1,014,100	2,671.00	2,708,661,100	
富士電機	55,400	9,092.00	503,696,800	
東洋電機製造	1,100	1,054.00	1,159,400	
安川電機	99,000	6,143.00	608,157,000	
シンフォニア テクノロジー	10,000	3,335.00	33,350,000	
明 電 舎	16,900	3,855.00	65,149,500	
オリジン	700	1,309.00	916,300	
山洋電気	3,900	6,990.00	27,261,000	
デンヨー	6,900	2,686.00	18,533,400	
PHCホールディングス	17,000	1,154.00	19,618,000	貸付株式数 6,600株
KOKUSAI ELECTRIC	47,300	4,230.00	200,079,000	貸付株式数 18,400株
ソシオネクスト	66,400	4,205.00	279,212,000	貸付株式数 25,900株
ベイカレントコンサルティング	68,200	3,222.00	219,740,400	
ORCHESTRA HLDGS	2,000	1,336.00	2,672,000	貸付株式数 700株
アイモバイル	11,700	472.00	5,522,400	
キャリアインデックス	1,000	174.00	174,000	貸付株式数 400株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,800	1,041.00	3,955,800	貸付株式数 1,200株
船場	600	1,232.00	739,200	
ジャパンエレベーターSHD	30,000	2,802.00	84,060,000	
フルテック	400	1,132.00	452,800	貸付株式数 100株
グリーンズ	1,100	1,983.00	2,181,300	貸付株式数 400株
ツナググループHLDGS	900	648.00	583,200	貸付株式数 100株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
GAMEWITH	1,200	262.00	314,400	貸付株式数 400株
MS&CONSULTING	400	601.00	240,400	
エル・ティー・エス	1,100	2,098.00	2,307,800	
ミダックホールディングス	5,600	1,541.00	8,629,600	貸付株式数 2,100株
キュービーネットHLDGS	5,300	1,111.00	5,888,300	貸付株式数 2,000株
オープングループ	12,700	264.00	3,352,800	貸付株式数 4,900株
三桜工業	13,800	958.00	13,220,400	
マキタ	103,900	4,551.00	472,848,900	
東芝テック	11,700	3,240.00	37,908,000	
芝浦メカトロニクス	5,200	7,220.00	37,544,000	貸付株式数 1,200株
マブチモーター	44,800	2,412.50	108,080,000	
ニデック	201,100	7,348.00	1,477,682,800	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,800	380.00	2,204,000	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,700	1,851.00	8,699,700	貸付株式数 1,400株
東光高岳	5,500	2,009.00	11,049,500	
ダブル・スコープ	26,000	470.00	12,220,000	貸付株式数 10,200株
宮越ホールディングス	4,000	1,585.00	6,340,000	貸付株式数 1,500株
ダイヘン	8,600	8,340.00	71,724,000	
ヤーマン	17,700	943.00	16,691,100	貸付株式数 6,800株 (200株)
ＪＶＣケンウッド	71,900	882.00	63,415,800	
ミマキエンジニアリング	8,500	1,782.00	15,147,000	
Ｉ－ＰＥＸ	6,300	2,002.00	12,612,600	
大崎電気	20,000	642.00	12,840,000	
オムロン	69,600	5,346.00	372,081,600	
日東工業	12,300	3,360.00	41,328,000	
ＩＤＥＣ	13,400	2,908.00	38,967,200	
正興電機製作所	1,000	1,507.00	1,507,000	
不二電機工業	600	1,126.00	675,600	貸付株式数 200株
ジーエス・ユアサ コーポ	35,600	3,209.00	114,240,400	
サクサホールディングス	700	2,660.00	1,862,000	
メルコホールディングス	2,800	3,350.00	9,380,000	
テクノメディカ	2,200	1,750.00	3,850,000	
ダイヤモンドエレクトリクHD	3,400	693.00	2,356,200	貸付株式数 1,100株
日本電気	119,600	11,615.00	1,389,154,000	
富 士 通	838,400	2,360.50	1,979,043,200	
沖 電 気	40,500	1,040.00	42,120,000	
岩崎通信機	1,400	1,317.00	1,843,800	
電気興業	3,600	2,083.00	7,498,800	
サンケン電気	8,500	5,946.00	50,541,000	
ナカヨ	500	1,190.00	595,000	
アイホン	4,900	2,956.00	14,484,400	
ルネサスエレクトロニクス	567,900	2,922.50	1,659,687,750	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
セイコーエプソン	116,900	2,464.00	288,041,600	
ワコム	66,300	727.00	48,200,100	
アルバック	20,000	10,830.00	216,600,000	
アクセル	4,100	1,335.00	5,473,500	
ＥＩＺＯ	6,600	4,755.00	31,383,000	貸付株式数　400株
ジャパンディスプレイ	61,700	15.00	925,500	
日本信号	20,800	1,010.00	21,008,000	
京三製作所	19,000	610.00	11,590,000	
能美防災	12,300	2,324.00	28,585,200	
ホーチキ	6,800	2,216.00	15,068,800	
星和電機	1,300	550.00	715,000	
エレコム	21,300	1,574.00	33,526,200	
パナソニック ホールディンク	1,076,300	1,360.50	1,464,306,150	
シャープ	153,600	967.00	148,531,200	貸付株式数　60,000株
アンリツ	64,200	1,132.00	72,674,400	
富士通ゼネラル	25,800	2,137.00	55,134,600	
ソニーグループ	631,700	13,435.00	8,486,889,500	※
ＴＤＫ	144,300	8,237.00	1,188,599,100	
帝国通信工業	3,900	1,984.00	7,737,600	
タムラ製作所	36,300	704.00	25,555,200	
アルプスアルパイン	81,400	1,549.00	126,088,600	
池上通信機	900	778.00	700,200	
日本電波工業	10,900	1,098.00	11,968,200	貸付株式数　200株
鈴木	4,800	1,429.00	6,859,200	
メイコー	9,000	6,580.00	59,220,000	
日本トリム	2,100	3,105.00	6,520,500	
ローランド ディー.ジー.	4,700	5,340.00	25,098,000	
フオスター電機	6,700	1,678.00	11,242,600	
ＳＭＫ	2,400	2,450.00	5,880,000	
ヨコオ	8,000	2,056.00	16,448,000	
ティアック	4,800	95.00	456,000	
ホシデン	20,700	2,014.00	41,689,800	
ヒロセ電機	13,400	17,825.00	238,855,000	
日本航空電子	21,800	2,465.00	53,737,000	
ＴＯＡ	10,300	1,068.00	11,000,400	
マクセル	20,200	1,818.00	36,723,600	
古野電気	11,700	2,066.00	24,172,200	
スミダコーポレーション	12,200	1,173.00	14,310,600	
アイコム	3,400	3,060.00	10,404,000	貸付株式数　400株
リオン	3,700	2,962.00	10,959,400	
横河電機	99,700	4,019.00	400,694,300	
新電元工業	3,500	3,005.00	10,517,500	
アズビル	62,100	4,082.00	253,492,200	
東亜ディーケーケー	1,400	850.00	1,190,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本光電工業	38,700	4,835.00	187,114,500	
チ ノ ー	3,700	2,550.00	9,435,000	貸付株式数 1,300株
共和電業	2,700	434.00	1,171,800	
日本電子材料	5,500	3,270.00	17,985,000	
堀場製作所	17,200	12,160.00	209,152,000	
アドバンテスト	258,400	5,247.00	1,355,824,800	
小野測器	1,200	688.00	825,600	
エスペック	7,200	3,180.00	22,896,000	
キーエンス	90,200	70,030.00	6,316,706,000	
日置電機	4,200	6,790.00	28,518,000	貸付株式数 1,600株
シスメックス	233,500	2,639.00	616,206,500	
日本マイクロニクス	16,200	5,630.00	91,206,000	
メガチップス	7,100	4,095.00	29,074,500	
OBARA GROUP	5,600	4,155.00	23,268,000	貸付株式数 2,200株
IMAGICA GROUP	8,800	530.00	4,664,000	貸付株式数 3,500株
澤藤電機	300	1,230.00	369,000	
デンソー	744,300	2,470.00	1,838,421,000	
原田工業	1,300	583.00	757,900	貸付株式数 500株
コーセル	9,600	1,337.00	12,835,200	
イリソ電子工業	8,200	2,949.00	24,181,800	
オプテックスグループ	16,500	1,712.00	28,248,000	
千代田インテグレ	3,500	3,000.00	10,500,000	貸付株式数 800株
レーザーテック	41,300	35,560.00	1,468,628,000	
スタンレー電気	57,800	2,862.50	165,452,500	
ウシオ電機	39,800	2,065.50	82,206,900	
岡谷電機	2,200	249.00	547,800	貸付株式数 800株
ヘリオステクノＨ	2,900	866.00	2,511,400	貸付株式数 1,100株
エノモト	800	1,452.00	1,161,600	
日本セラミック	7,300	2,549.00	18,607,700	
遠藤照明	1,300	1,546.00	2,009,800	
古河電池	6,700	1,188.00	7,959,600	貸付株式数 2,400株
双信電機	1,500	478.00	717,000	
山一電機	8,100	3,345.00	27,094,500	
図 研	7,400	3,995.00	29,563,000	
日本電子	22,600	6,658.00	150,470,800	
カ シ オ	65,100	1,171.50	76,264,650	
ファナック	439,900	4,353.00	1,914,884,700	
日本シイエムケイ	21,200	578.00	12,253,600	
エンプラス	2,600	7,630.00	19,838,000	貸付株式数 1,000株 (100株)
大真空	13,400	681.00	9,125,400	貸付株式数 5,200株
ロ ー ム	166,800	2,021.50	337,186,200	貸付株式数 63,600株
浜松ホトニクス	72,400	4,864.00	352,153,600	
三井ハイテック	8,000	6,959.00	55,672,000	貸付株式数 3,100株
新光電気工業	31,900	5,629.00	179,565,100	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
京 セ ラ	560,500	1,848.00	1,035,804,000	
協栄産業	300	2,848.00	854,400	貸付株式数 100株
太陽誘電	43,900	3,476.00	152,596,400	
村田製作所	820,800	3,018.00	2,477,174,400	
双葉電子工業	17,400	525.00	9,135,000	
日東電工	58,100	11,685.00	678,898,500	
北陸電気工業	1,100	1,399.00	1,538,900	
東海理化電機	25,400	2,114.00	53,695,600	
ニチコン	23,700	1,127.00	26,709,900	
日本ケミコン	9,600	1,639.00	15,734,400	
Ｋ Ｏ Ａ	13,600	1,496.00	20,345,600	貸付株式数 3,800株
三井Ｅ＆Ｓ	45,200	1,424.00	64,364,800	貸付株式数 17,600株
日立造船	80,400	1,070.00	86,028,000	
三菱重工業	1,593,200	1,377.50	2,194,633,000	
川崎重工業	73,600	5,603.00	412,380,800	
ＩＨＩ	67,800	3,864.00	261,979,200	
名村造船所	25,300	2,030.00	51,359,000	貸付株式数 9,800株
サノヤスホールディングス	4,300	180.00	774,000	貸付株式数 1,700株
スプリックス	900	781.00	702,900	
マネジメントソリューションズ	4,000	1,828.00	7,312,000	貸付株式数 1,500株
プロレド・パートナーズ	2,300	621.00	1,428,300	貸付株式数 800株
AND FACTORY	900	325.00	292,500	貸付株式数 300株
テノ.ホールディングス	400	419.00	167,600	貸付株式数 100株
フロンティア・マネジメント	2,300	1,242.00	2,856,600	
ピアラ	600	270.00	162,000	
コプロ・ホールディングス	1,000	1,430.00	1,430,000	
ギークス	400	467.00	186,800	
アンビスホールディングス	19,800	2,220.00	43,956,000	
カーブスホールディングス	25,400	751.00	19,075,400	
フォーラムエンジニアリング	12,600	862.00	10,861,200	
FAST FITNESS JAP	3,200	1,297.00	4,150,400	
日本車輌	3,000	2,293.00	6,879,000	貸付株式数 300株
三菱ロジスネクスト	14,400	1,423.00	20,491,200	
近畿車輌	400	1,903.00	761,200	
一家ホールディングス	800	683.00	546,400	貸付株式数 300株
フルサト・マルカ HD	8,500	2,148.00	18,258,000	貸付株式数 3,000株
ヤマエグループ HD	8,400	2,314.00	19,437,600	貸付株式数 2,800株
ジャパンクラフトホールディ	2,700	153.00	413,100	貸付株式数 900株
ＦＰＧ	33,000	2,065.00	68,145,000	
島根銀行	800	562.00	449,600	貸付株式数 300株
じもとホールディングス	2,600	397.00	1,032,200	貸付株式数 1,000株
全国保証	23,200	5,570.00	129,224,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
めぶきフィナンシャルＧ	411,600	593.30	244,202,280	
ジャパンインベストメントＡ	14,400	1,398.00	20,131,200	貸付株式数　5,500株
東京きらぼしFG	11,400	4,715.00	53,751,000	
九州フィナンシャルＧ	171,900	982.20	168,840,180	
かんぽ生命保険	90,500	2,875.00	260,187,500	
ゆうちょ銀行	976,300	1,533.00	1,496,667,900	
あんしん保証	1,200	220.00	264,000	貸付株式数　100株
富山第一銀行	28,200	1,154.00	32,542,800	
コンコルディア・フィナンシャル	472,600	906.60	428,459,160	
ジェイリース	5,900	1,195.00	7,050,500	
西日本フィナンシャルHD	49,700	1,996.00	99,201,200	
イントラスト	1,100	800.00	880,000	
日本モーゲージサービス	1,600	417.00	667,200	貸付株式数　600株
Ｃａｓａ	1,100	871.00	958,100	貸付株式数　400株
ＳＢＩアルヒ	8,600	847.00	7,284,200	
プレミアグループ	15,000	2,069.00	31,035,000	
日産自動車	1,187,000	540.10	641,098,700	
いすゞ自動車	253,300	2,000.00	506,600,000	
トヨタ自動車	4,953,200	3,218.00	15,939,397,600	※
日野自動車	135,800	439.60	59,697,680	
三菱自動車工業	352,000	435.10	153,155,200	
エフテック	2,100	628.00	1,318,800	貸付株式数　800株
レシップホールディングス	1,300	568.00	738,400	
ＧＭＢ	600	1,332.00	799,200	貸付株式数　200株
ファルテック	500	555.00	277,500	
武蔵精密工業	22,000	1,684.00	37,048,000	
日産車体	9,200	950.00	8,740,000	
新明和工業	26,000	1,388.00	36,088,000	
極東開発工業	14,900	2,470.00	36,803,000	
トピー工業	7,300	2,416.00	17,636,800	
ティラド	2,000	3,555.00	7,110,000	
タチエス	16,700	1,913.00	31,947,100	
ＮＯＫ	35,000	2,160.50	75,617,500	
フタバ産業	24,200	855.00	20,691,000	
カヤバ	8,500	5,300.00	45,050,000	
市光工業	16,300	554.00	9,030,200	
大同メタル工業	17,800	591.00	10,519,800	
プレス工業	35,800	658.00	23,556,400	
ミクニ	3,700	399.00	1,476,300	
太平洋工業	20,800	1,517.00	31,553,600	
河西工業	4,600	194.00	892,400	貸付株式数　1,800株
アイシン	69,600	5,574.00	387,950,400	
マツダ	298,400	1,554.00	463,713,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
今仙電機製作所	1,900	620.00	1,178,000	
本田技研	2,137,400	1,668.00	3,565,183,200	
スズキ	662,700	1,859.00	1,231,959,300	
SUBARU	279,700	3,362.00	940,351,400	
安永	1,300	603.00	783,900	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	389,800	1,482.00	577,683,600	
小糸製作所	93,500	2,218.50	207,429,750	
ＴＢＫ	3,100	303.00	939,300	貸付株式数 1,200株
エクセディ	14,800	2,626.00	38,864,800	貸付株式数 5,700株
ミツバ	16,900	1,049.00	17,728,100	
豊田合成	25,900	2,882.00	74,643,800	
愛三工業	15,000	1,343.00	20,145,000	
盟和産業	400	1,004.00	401,600	貸付株式数 100株
日本プラスト	2,500	431.00	1,077,500	
ヨ ロ ズ	8,400	1,074.00	9,021,600	貸付株式数 3,200株
エフ・シー・シー	16,000	2,234.00	35,744,000	
新家工業	700	5,190.00	3,633,000	
シマノ	36,400	26,395.00	960,778,000	
テイ・エス テック	32,100	1,836.50	58,951,650	
３３ＦＧ	7,900	2,098.00	16,574,200	
第四北越フィナンシャルＧ	13,900	4,790.00	66,581,000	
ひろぎんHLDGS	126,400	1,215.50	153,639,200	
マーキュリアホールディングス	1,500	871.00	1,306,500	貸付株式数 100株
おきなわＦＧ	7,600	2,590.00	19,684,000	
ダイレクトマケティングミクス	9,600	241.00	2,313,600	
ポピンズ	1,400	1,219.00	1,706,600	
LITALICO	7,200	1,657.00	11,930,400	貸付株式数 2,700株
コンフィデンス・インターワーク	300	1,816.00	544,800	貸付株式数 100株
十六ＦＧ	11,500	4,580.00	52,670,000	
北國ＦＨＤ	9,400	5,090.00	47,846,000	
ネットプロＨＤ	29,600	169.00	5,002,400	
プロクレアホールディングス	10,200	1,817.00	18,533,400	貸付株式数 3,000株
あいちフィナンシャルグル	18,200	2,655.00	48,321,000	
ジャムコ	4,900	1,448.00	7,095,200	貸付株式数 1,900株
小 野 建	9,600	1,590.00	15,264,000	
はるやまHLDGS	1,500	591.00	886,500	貸付株式数 300株
南 陽	1,300	1,123.00	1,459,900	
ノ ジ マ	27,700	1,726.00	47,810,200	
佐鳥電機	5,900	1,992.00	11,752,800	貸付株式数 2,300株
カッパ・クリエイト	15,000	1,662.00	24,930,000	貸付株式数 5,800株 (300株)
エコートレーディング	600	1,263.00	757,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
伯東	5,500	5,070.00	27,885,000	貸付株式数 2,100株
コンドーテック	7,300	1,345.00	9,818,500	貸付株式数 2,000株
中山福	1,800	367.00	660,600	
ライトオン	2,300	391.00	899,300	貸付株式数 900株
ナガイレーベン	12,100	2,398.00	29,015,800	貸付株式数 4,100株
三菱食品	8,800	5,190.00	45,672,000	
良品計画	113,600	2,598.50	295,189,600	
パリミキホールディングス	4,000	386.00	1,544,000	
松田産業	7,300	2,786.00	20,337,800	貸付株式数 1,400株
第一興商	37,000	1,660.50	61,438,500	
メディパルHD	97,000	2,307.50	223,827,500	
アドヴァングループ	8,100	986.00	7,986,600	
ＳＰＫ	4,200	2,194.00	9,214,800	
萩原電気HLDGS	4,100	3,965.00	16,256,500	
アルビス	3,100	2,627.00	8,143,700	
アズワン	29,600	2,537.00	75,095,200	
スズデン	3,300	1,860.00	6,138,000	貸付株式数 1,300株
尾家産業	800	1,918.00	1,534,400	貸付株式数 100株
シモジマ	6,400	1,275.00	8,160,000	貸付株式数 2,000株
ドウシシャ	8,900	2,230.00	19,847,000	
小津産業	700	1,622.00	1,135,400	貸付株式数 200株
コナカ	3,700	288.00	1,065,600	
高速	5,700	2,257.00	12,864,900	
ハウス ローゼ	400	1,589.00	635,600	貸付株式数 100株
G-7ホールディングス	10,400	1,613.00	16,775,200	
たけびし	3,600	2,156.00	7,761,600	貸付株式数 800株
イオン北海道	28,300	922.00	26,092,600	
コ ジ マ	18,400	874.00	16,081,600	貸付株式数 7,000株 (1,700株)
ヒマラヤ	1,100	910.00	1,001,000	貸付株式数 400株
コーナン商事	11,700	4,175.00	48,847,500	
ネットワンシステムズ	35,100	2,886.00	101,298,600	
エコス	3,500	2,272.00	7,952,000	
ワタミ	10,000	899.00	8,990,000	貸付株式数 3,800株
マルシェ	1,100	245.00	269,500	貸付株式数 400株
リックス	2,200	3,000.00	6,600,000	
システムソフト	31,400	62.00	1,946,800	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	192,800	3,921.00	755,968,800	
丸文	8,500	1,210.00	10,285,000	
西松屋チェーン	18,800	2,335.00	43,898,000	貸付株式数 7,300株
ゼンショーホールディングス	48,600	6,012.00	292,183,200	貸付株式数 18,600株
ハピネット	8,100	3,575.00	28,957,500	
幸楽苑ホールディングス	7,000	1,295.00	9,065,000	貸付株式数 2,700株
ハークスレイ	1,000	814.00	814,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
橋本総業HLDGS	3,800	1,346.00	5,114,800	貸付株式数 1,400株
日本ライフライン	25,600	1,112.00	28,467,200	
サイゼリヤ	14,100	5,420.00	76,422,000	
タカショー	8,300	500.00	4,150,000	貸付株式数 3,100株
ＶＴホールディングス	37,200	492.00	18,302,400	
アルゴグラフィックス	8,200	4,290.00	35,178,000	
魚力	3,300	2,401.00	7,923,300	貸付株式数 700株
ＩＤＯＭ	25,200	1,310.00	33,012,000	
日本エム・ディ・エム	7,200	629.00	4,528,800	
ポプラ	800	246.00	196,800	貸付株式数 300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,500	1,789.00	8,050,500	
ユナイテッドアローズ	11,200	1,874.00	20,988,800	
進和	5,800	2,651.00	15,375,800	
エスケイジャパン	800	846.00	676,800	
ダイトロン	3,800	3,055.00	11,609,000	
ハイデイ日高	14,100	3,045.00	42,934,500	貸付株式数 5,500株
シークス	13,600	1,326.00	18,033,600	
YU-WA CREATION H	2,000	129.00	258,000	貸付株式数 600株
コロワイド	41,000	1,994.00	81,754,000	貸付株式数 16,000株
田中商事	900	809.00	728,100	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	5,000	1,660.00	8,300,000	貸付株式数 1,400株
壱番屋	37,700	1,132.00	42,676,400	貸付株式数 7,800株
白銅	2,600	2,768.00	7,196,800	貸付株式数 1,000株
トップカルチャー	1,500	156.00	234,000	貸付株式数 400株
ＰＬＡＮＴ	700	1,555.00	1,088,500	
スギホールディングス	57,700	2,496.50	144,048,050	
ダイコー通産	300	1,174.00	352,200	貸付株式数 100株
薬王堂ホールディングス	4,700	2,797.00	13,145,900	
島津製作所	119,900	4,084.00	489,671,600	
Ｊ Ｍ Ｓ	8,400	519.00	4,359,600	
クボテック	800	214.00	171,200	貸付株式数 300株
長野計器	6,500	2,982.00	19,383,000	
ブイ・テクノロジー	4,700	2,972.00	13,968,400	
スター精密	16,600	2,050.00	34,030,000	
東京計器	6,900	2,876.00	19,844,400	
愛知時計	3,900	2,102.00	8,197,800	
インターアクション	5,400	1,436.00	7,754,400	貸付株式数 1,200株
オーバル	2,600	463.00	1,203,800	
東京精密	18,500	10,355.00	191,567,500	
マニー	36,000	1,903.50	68,526,000	
ニコン	130,400	1,575.00	205,380,000	
トプコン	43,800	1,706.50	74,744,700	
オリンパス	516,400	2,575.00	1,329,730,000	
理研計器	12,800	3,830.00	49,024,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
SCREEN ホールディングス	30,800	14,705.00	452,914,000	
キヤノン電子	10,000	2,273.00	22,730,000	貸付株式数 3,800 株
タムロン	5,500	8,660.00	47,630,000	
ＨＯＹＡ	177,600	18,925.00	3,361,080,000	
シ ー ド	1,800	564.00	1,015,200	貸付株式数 600 株
ノーリツ鋼機	8,500	4,135.00	35,147,500	
A&D ホロンホールディングス	13,100	2,740.00	35,894,000	
朝日インテック	109,900	2,334.50	256,561,550	
キヤノン	449,900	4,501.00	2,024,999,900	
リ コ ー	226,200	1,446.00	327,085,200	
シチズン時計	83,000	1,043.00	86,569,000	
リズム	700	3,745.00	2,621,500	貸付株式数 200 株
大研医器	2,500	531.00	1,327,500	
メニコン	31,000	1,307.00	40,517,000	
シンシア	300	463.00	138,900	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	4,300	164.00	705,200	
中本パックス	1,000	1,612.00	1,612,000	
パラマウントベッド HD	18,700	2,811.00	52,565,700	
トランザクション	6,000	1,910.00	11,460,000	
粧美堂	800	564.00	451,200	
ニホンフラッシュ	8,500	893.00	7,590,500	
前田工繊	8,000	3,210.00	25,680,000	
永大産業	3,400	240.00	816,000	
アートネイチャー	8,000	819.00	6,552,000	
フルヤ金属	2,900	12,790.00	37,091,000	貸付株式数 200 株
バンダイナムコ HLDGS	247,100	2,980.00	736,358,000	
アイフィスジャパン	800	588.00	470,400	
ＳＨＯＥＩ	25,300	2,023.00	51,181,900	
フランスベッド HLDGS	11,700	1,176.00	13,759,200	貸付株式数 4,500 株
マーベラス	14,600	621.00	9,066,600	
パイロットコーポレーション	12,700	4,379.00	55,613,300	
萩原工業	6,000	1,545.00	9,270,000	貸付株式数 2,300 株
エイベックス	15,400	1,197.00	18,433,800	
フジシールインターナショナル	18,300	2,321.00	42,474,300	
タカラトミー	41,000	2,909.00	119,269,000	
広済堂ホールディングス	26,200	604.00	15,824,800	貸付株式数 8,800 株
エステールホールディングス	700	648.00	453,600	
レック	11,600	1,284.00	14,894,400	貸付株式数 4,300 株
タカノ	1,100	930.00	1,023,000	
三光合成	11,300	675.00	7,627,500	
プロネクサス	9,400	1,235.00	11,609,000	
ホクシン	2,200	116.00	255,200	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ウッドワン	1,100	926.00	1,018,600	貸付株式数 300株
き も と	5,100	212.00	1,081,200	
TOPPANホールディングス	110,900	4,097.00	454,357,300	
大日本印刷	93,500	4,902.00	458,337,000	
共同印刷	2,600	3,605.00	9,373,000	
ＮＩＳＳＨＡ	15,400	1,928.00	29,691,200	
光村印刷	200	1,574.00	314,800	
藤森工業	7,200	4,245.00	30,564,000	
ヴィア・ホールディングス	4,700	113.00	531,100	貸付株式数 1,800株
TAKARA & COMPANY	5,300	2,777.00	14,718,100	
前澤化成工業	5,800	1,863.00	10,805,400	貸付株式数 2,200株
未来工業	3,200	4,040.00	12,928,000	貸付株式数 1,200株
アシックス	76,900	8,883.00	683,102,700	
ツ ツ ミ	2,100	2,090.00	4,389,000	
ウェーブロックHLDGS	1,100	633.00	696,300	
ジェイ エス ピー	6,300	2,162.00	13,620,600	貸付株式数 2,300株
ニ チ ハ	11,300	3,480.00	39,324,000	貸付株式数 4,300株
ローランド	6,600	4,195.00	27,687,000	貸付株式数 2,400株
エフピコ	17,100	2,390.50	40,877,550	貸付株式数 3,400株
小松ウオール工業	3,700	3,190.00	11,803,000	
ヤマハ	56,900	3,717.00	211,497,300	
河合楽器	2,700	3,140.00	8,478,000	
クリナップ	8,700	710.00	6,177,000	
ピジョン	57,400	1,534.00	88,051,600	
天馬	6,600	2,581.00	17,034,600	
キングジム	8,000	898.00	7,184,000	貸付株式数 3,000株 (200株)
象印マホービン	24,500	1,475.00	36,137,500	
リンテック	18,100	3,200.00	57,920,000	
信越ポリマー	19,500	1,460.00	28,470,000	
東 リ	6,500	390.00	2,535,000	
イトーキ	17,200	1,541.00	26,505,200	
任 天 堂	569,500	8,752.00	4,984,264,000	
三菱鉛筆	12,800	2,388.00	30,566,400	
松 風	4,100	3,830.00	15,703,000	
タカラスタンダード	18,400	1,693.00	31,151,200	
コ ク ヨ	36,900	2,623.00	96,788,700	
ナカバヤシ	9,800	540.00	5,292,000	
ニ フ コ	27,100	3,711.00	100,568,100	
立川ブラインド	4,200	1,366.00	5,737,200	
グローブライド	8,100	2,108.00	17,074,800	貸付株式数 3,000株
オカムラ	27,200	2,225.00	60,520,000	
バルカー	7,600	3,585.00	27,246,000	
MUTOHホールディングス	400	2,455.00	982,000	
伊 藤 忠	641,600	7,291.00	4,677,905,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
丸 紅	791,600	2,936.00	2,324,137,600	
スクロール	14,300	1,079.00	15,429,700	
高 島	2,100	1,046.00	2,196,600	貸付株式数 800株
ヨンドシーホールディングス	9,000	1,895.00	17,055,000	貸付株式数 3,400株
三陽商会	3,800	2,563.00	9,739,400	
長瀬産業	43,700	3,011.00	131,580,700	
ナイガイ	1,000	262.00	262,000	貸付株式数 300株
蝶 理	6,000	3,485.00	20,910,000	貸付株式数 1,700株
豊田通商	83,600	9,098.00	760,592,800	
オンワードホールディングス	53,300	656.00	34,964,800	
三共生興	13,200	736.00	9,715,200	
兼 松	39,900	2,685.00	107,131,500	
美 津 濃	9,000	8,110.00	72,990,000	
ツカモトコーポレーション	500	1,203.00	601,500	
ルックホールディングス	2,800	2,752.00	7,705,600	
三井物産	714,900	7,689.00	5,496,866,100	
日本紙パルプ	4,500	6,100.00	27,450,000	
東京エレクトロン	190,900	33,540.00	6,402,786,000	
カメイ	10,200	2,046.00	20,869,200	
東都水産	200	6,470.00	1,294,000	
OUGホールディングス	500	2,681.00	1,340,500	
スターゼン	6,600	2,768.00	18,268,800	
セイコーグループ	12,600	4,450.00	56,070,000	
山 善	28,900	1,366.00	39,477,400	
椿本興業	5,900	2,170.00	12,803,000	
住友商事	577,600	3,991.00	2,305,201,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	29,600	4,241.00	125,533,600	
内田洋行	3,900	7,080.00	27,612,000	
三菱商事	1,832,600	3,243.00	5,943,121,800	
第一実業	9,000	2,327.00	20,943,000	
キヤノンマーケティングJPN	22,100	4,419.00	97,659,900	
西華産業	3,700	3,935.00	14,559,500	
佐藤商事	6,600	1,631.00	10,764,600	
東京産業	8,700	647.00	5,628,900	貸付株式数 3,200株
ユアサ商事	7,500	5,490.00	41,175,000	
神鋼商事	2,400	6,970.00	16,728,000	
トルク	2,300	234.00	538,200	
阪和興業	17,100	6,110.00	104,481,000	
正栄食品	6,400	4,545.00	29,088,000	貸付株式数 2,400株
カナデン	7,200	1,552.00	11,174,400	
ＲＹＯＤＥＮ	7,700	2,561.00	19,719,700	
ニプロ	75,200	1,252.00	94,150,400	
岩谷産業	21,700	9,220.00	200,074,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ナイス	2,500	1,877.00	4,692,500	
ニチモウ	1,000	2,082.00	2,082,000	
極東貿易	5,700	1,699.00	9,684,300	貸付株式数 2,100株
アステナホールディングス	18,000	487.00	8,766,000	
三愛オブリ	22,300	2,076.00	46,294,800	
稲畑産業	18,800	3,355.00	63,074,000	
ＧＳＩクレオス	5,100	2,189.00	11,163,900	貸付株式数 1,000株
明和産業	11,200	710.00	7,952,000	
クワザワホールディングス	1,100	864.00	950,400	貸付株式数 400株
ゴールドウイン	16,000	8,600.00	137,600,000	
ユニ・チヤーム	188,500	5,238.00	987,363,000	
デサント	15,600	3,465.00	54,054,000	
キ ン グ	1,200	679.00	814,800	
ワ キ タ	15,800	1,644.00	25,975,200	
ヤマトインターナシヨナル	2,300	347.00	798,100	
東邦ホールディングス	25,800	3,860.00	99,588,000	貸付株式数 9,800株
サンゲツ	22,000	2,981.00	65,582,000	
ミツウロコグループ	12,200	1,434.00	17,494,800	貸付株式数 4,700株
シナネンホールディングス	2,600	4,670.00	12,142,000	
伊藤忠エネクス	23,700	1,522.00	36,071,400	
サンリオ	77,500	2,539.00	196,772,500	
サンワ テクノス	4,900	2,230.00	10,927,000	
新光商事	12,800	937.00	11,993,600	貸付株式数 4,800株
トーホー	3,700	3,125.00	11,562,500	
三信電気	3,900	2,104.00	8,205,600	
東陽テクニカ	8,800	1,596.00	14,044,800	
モスフード サービス	14,000	3,470.00	48,580,000	
加賀電子	8,700	5,580.00	48,546,000	
三益半導体	8,400	3,700.00	31,080,000	
都築電気	4,700	2,241.00	10,532,700	貸付株式数 1,500株
ソーダニツカ	9,100	1,048.00	9,536,800	
立花エレテック	6,300	2,940.00	18,522,000	
木曽路	14,400	2,519.00	36,273,600	貸付株式数 5,500株
SRS ホールディングス	15,700	1,202.00	18,871,400	貸付株式数 6,000株
千 趣 会	17,700	333.00	5,894,100	貸付株式数 6,000株
タカキユー	2,100	90.00	189,000	貸付株式数 800株
リテールパートナーズ	14,200	1,695.00	24,069,000	貸付株式数 5,500株
上新電機	9,500	2,549.00	24,215,500	
日本瓦斯	50,600	2,378.00	120,326,800	
ロイヤルホールディングス	16,800	2,635.00	44,268,000	貸付株式数 6,400株
東 天 紅	300	909.00	272,700	
いなげや	9,300	1,243.00	11,559,900	
チヨダ	9,300	905.00	8,416,500	
ライフコーポレーション	10,000	4,085.00	40,850,000	
リンガーハツト	12,300	2,345.00	28,843,500	貸付株式数 4,800株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ＭｒＭａｘＨＤ	12,100	664.00	8,034,400	
テンアライド	4,300	296.00	1,272,800	貸付株式数 1,600 株
AOKI ホールディングス	20,500	1,269.00	26,014,500	
オークワ	13,800	930.00	12,834,000	貸付株式数 4,900 株
コメリ	14,700	3,610.00	53,067,000	
青山商事	20,400	1,519.00	30,987,600	
しまむら	22,400	7,410.00	165,984,000	
はせがわ	1,500	346.00	519,000	
高 島 屋	60,800	2,614.50	158,961,600	
松 屋	16,200	999.00	16,183,800	貸付株式数 6,300 株
エイチ・ツー・オーリテイリング	42,200	2,416.00	101,955,200	貸付株式数 16,500 株
近鉄百貨店	4,100	2,255.00	9,245,500	貸付株式数 1,500 株
丸井グループ	63,300	2,307.50	146,064,750	
クレディセゾン	56,300	3,227.00	181,680,100	
アクシアル リテイリング	26,000	1,009.00	26,234,000	
井 筒 屋	1,500	447.00	670,500	貸付株式数 500 株
イオン	323,500	3,510.00	1,135,485,000	
イ ズ ミ	16,900	3,313.00	55,989,700	
フオーバル	3,700	1,355.00	5,013,500	貸付株式数 1,000 株
平 和 堂	15,900	2,313.00	36,776,700	貸付株式数 5,800 株
フ ジ	14,600	1,974.00	28,820,400	貸付株式数 5,400 株
ヤオコー	11,300	9,080.00	102,604,000	貸付株式数 3,800 株
ゼビオホールディングス	13,000	1,157.00	15,041,000	
ケーズホールディングス	64,100	1,442.50	92,464,250	
ＰＡＬＴＡＣ	12,900	4,128.00	53,251,200	
三谷産業	16,800	355.00	5,964,000	
OLYMPIC グループ	1,500	527.00	790,500	貸付株式数 500 株
日産東京販売ＨＤ	4,700	516.00	2,425,200	
あおぞら銀行	63,800	2,376.00	151,588,800	貸付株式数 24,900 株
三菱 UFJ フィナンシャル G	5,410,400	1,643.00	8,889,287,200	貸付株式数 2,115,200 株
りそなホールディングス	1,027,500	1,018.50	1,046,508,750	
三井住友トラスト HD	319,300	3,560.00	1,136,708,000	
三井住友フィナンシャル G	622,200	10,090.00	6,277,998,000	※
千葉銀行	247,600	1,396.50	345,773,400	
群馬銀行	172,300	1,000.50	172,386,150	
武蔵野銀行	12,400	3,200.00	39,680,000	
千葉興業銀行	18,900	1,004.00	18,975,600	
筑波銀行	39,000	308.00	12,012,000	
七十七銀行	25,800	4,445.00	114,681,000	
秋田銀行	5,900	2,549.00	15,039,100	
山形銀行	9,900	1,123.00	11,117,700	
岩手銀行	5,600	2,814.00	15,758,400	
東邦銀行	70,300	320.00	22,496,000	
東北銀行	1,400	1,191.00	1,667,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ふくおかフィナンシャルＧ	77,400	4,299.00	332,742,600	
スルガ銀行	63,000	1,074.00	67,662,000	
八十二銀行	190,600	1,018.50	194,126,100	
山梨中央銀行	10,000	1,972.00	19,720,000	
大垣共立銀行	16,900	2,195.00	37,095,500	
福井銀行	8,000	2,010.00	16,080,000	貸付株式数　3,000 株
清水銀行	3,600	1,622.00	5,839,200	
富山銀行	500	1,757.00	878,500	貸付株式数　200 株
滋賀銀行	14,800	4,355.00	64,454,000	
南都銀行	13,400	3,315.00	44,421,000	
百五銀行	83,500	665.00	55,527,500	
紀陽銀行	31,800	1,847.00	58,734,600	
ほくほくフィナンシャルＧ	55,000	2,107.50	115,912,500	
山陰合同銀行	55,600	1,390.00	77,284,000	
鳥取銀行	1,000	1,383.00	1,383,000	
百十四銀行	8,800	3,305.00	29,084,000	
四国銀行	13,100	1,138.00	14,907,800	
阿波銀行	12,500	2,715.00	33,937,500	
大分銀行	5,300	3,345.00	17,728,500	
宮崎銀行	5,300	3,375.00	17,887,500	
佐賀銀行	5,200	2,597.00	13,504,400	
琉球銀行	18,900	1,226.00	23,171,400	
セブン銀行	278,500	267.50	74,498,750	
みずほフィナンシャルＧ	1,199,200	3,125.00	3,747,500,000	
高知銀行	1,000	923.00	923,000	
山口フィナンシャルＧ	87,100	1,788.50	155,778,350	
芙蓉総合リース	8,200	12,415.00	101,803,000	
みずほリース	74,400	1,087.00	80,872,800	
東京センチュリー	66,500	1,477.50	98,253,750	
SBI ホールディングス	142,600	4,085.00	582,521,000	
日本証券金融	32,700	1,635.00	53,464,500	
アイフル	130,800	391.00	51,142,800	
日本アジア投資	2,100	232.00	487,200	貸付株式数　800 株
名古屋銀行	5,600	7,120.00	39,872,000	
北洋銀行	134,600	557.00	74,972,200	
大光銀行	1,000	1,681.00	1,681,000	貸付株式数　300 株
愛媛銀行	12,000	1,243.00	14,916,000	
トマト銀行	1,100	1,229.00	1,351,900	
京葉銀行	36,600	863.00	31,585,800	
栃木銀行	44,400	367.00	16,294,800	
北日本銀行	2,900	2,644.00	7,667,600	
東和銀行	16,400	692.00	11,348,800	
福島銀行	3,100	272.00	843,200	貸付株式数　1,200 株
大東銀行	1,300	748.00	972,400	貸付株式数　500 株
リコーリース	8,400	5,060.00	42,504,000	貸付株式数　3,200 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
イオンフィナンシャルサービス	51,000	1,303.50	66,478,500	
ア コ ム	158,800	386.80	61,423,840	
ジャックス	9,400	4,785.00	44,979,000	
オ リ コ	29,100	1,024.00	29,798,400	
オリックス	532,800	3,427.00	1,825,905,600	
三菱HCキャピタル	396,000	1,032.00	408,672,000	
ジャフコ グループ	26,500	1,866.00	49,449,000	
九州 リースサービス	1,200	1,085.00	1,302,000	貸付株式数 400株
トモニホールディングス	84,100	405.00	34,060,500	
大和証券Ｇ本社	688,300	1,287.00	885,842,100	
野村ホールディングス	1,494,200	961.70	1,436,972,140	
岡三証券グループ	78,000	803.00	62,634,000	貸付株式数 7,200株
丸三証券	29,500	1,020.00	30,090,000	
東洋証券	23,600	396.00	9,345,600	
東海東京ＨＤ	105,500	595.00	62,772,500	
光世証券	700	623.00	436,100	貸付株式数 200株
水戸証券	26,200	539.00	14,121,800	
いちよし証券	16,600	832.00	13,811,200	
松井証券	43,700	809.00	35,353,300	
SOMPOホールディングス	400,900	3,195.00	1,280,875,500	
日本取引所グループ	229,100	3,827.00	876,765,700	
マネックスＧ	87,000	772.00	67,164,000	
極東証券	12,100	1,467.00	17,750,700	貸付株式数 4,600株
岩井コスモホールディング	10,100	2,223.00	22,452,300	
アイザワ証券グループ	12,800	1,853.00	23,718,400	
フィデアホール	9,200	1,609.00	14,802,800	
池田泉州ＨＤ	123,100	402.00	49,486,200	
アニコム ホールディングス	30,100	640.00	19,264,000	
ＭＳ＆ＡＤ	596,800	3,142.00	1,875,145,600	
マネーパートナーズGP	3,000	252.00	756,000	
スパークス・グループ	9,900	1,701.00	16,839,900	
小林洋行	1,200	291.00	349,200	貸付株式数 400株
第一生命HLDGS	417,700	3,974.00	1,659,939,800	
東京海上ＨＤ	867,400	5,361.00	4,650,131,400	
アドバンテッジリスクマネ	1,600	477.00	763,200	
イー・ギャランティ	14,500	1,344.00	19,488,000	
アサックス	1,300	830.00	1,079,000	貸付株式数 500株
NECキャピタルソリューション	4,300	3,860.00	16,598,000	
T&Dホールディングス	238,600	2,665.50	635,988,300	
アドバンスクリエイト	6,900	1,011.00	6,975,900	貸付株式数 200株
三井不動産	1,232,500	1,520.50	1,874,016,250	
三菱地所	580,800	2,645.50	1,536,506,400	
平和不動産	14,400	3,845.00	55,368,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東京建物	77,600	2,582.00	200,363,200	
京阪神ビルディング	16,600	1,542.00	25,597,200	
住友不動産	128,500	4,981.00	640,058,500	
太平洋興発	1,200	789.00	946,800	貸付株式数 400株
テーオーシー	15,800	683.00	10,791,400	
スターツコーポレーション	12,800	3,355.00	42,944,000	
フジ住宅	11,200	745.00	8,344,000	
空港施設	12,500	597.00	7,462,500	
明和地所	5,700	906.00	5,164,200	貸付株式数 1,800株
ゴールドクレスト	7,300	2,604.00	19,009,200	貸付株式数 1,500株
リログループ	46,500	1,585.50	73,725,750	
エスリード	4,200	4,045.00	16,989,000	貸付株式数 1,500株
日神グループHLDGS	14,200	524.00	7,440,800	貸付株式数 5,200株
日本エスコン	16,600	1,046.00	17,363,600	
MIRARTHホールディング	40,800	477.00	19,461,600	
ＡＶＡＮＴＩＡ	1,600	841.00	1,345,600	貸付株式数 600株
イオンモール	46,000	1,931.00	88,826,000	貸付株式数 18,000株
毎日コムネット	1,100	753.00	828,300	貸付株式数 100株
ファースト住建	1,200	1,053.00	1,263,600	貸付株式数 400株
ランド	491,400	7.00	3,439,800	貸付株式数 192,800株
カチタス	23,900	1,634.00	39,052,600	
東祥	6,500	719.00	4,673,500	貸付株式数 2,400株
トーセイ	14,800	2,362.00	34,957,600	
穴吹興産	700	2,233.00	1,563,100	貸付株式数 200株
サンフロンティア不動産	13,200	1,960.00	25,872,000	
インテリックス	700	555.00	388,500	
ランドビジネス	1,000	245.00	245,000	貸付株式数 400株
サンネクスタグループ	1,000	1,037.00	1,037,000	貸付株式数 300株
グランディハウス	7,400	578.00	4,277,200	貸付株式数 300株
東武鉄道	99,100	2,743.50	271,880,850	
相鉄ホールディングス	32,300	2,417.00	78,069,100	
東急	253,000	1,833.00	463,749,000	
京浜急行	111,700	1,153.00	128,790,100	
小田急電鉄	149,200	1,593.50	237,750,200	
京王電鉄	43,400	3,738.00	162,229,200	
京成電鉄	58,200	5,728.00	333,369,600	
富士急行	11,100	3,055.00	33,910,500	
東日本旅客鉄道	497,200	2,775.00	1,379,730,000	
西日本旅客鉄道	214,000	3,144.00	672,816,000	
東海旅客鉄道	347,500	3,490.00	1,212,775,000	
西武ホールディングス	109,100	2,297.00	250,602,700	
鴻池運輸	15,400	2,290.00	35,266,000	
西日本鉄道	24,100	2,507.00	60,418,700	
ハマキョウレックス	7,700	4,085.00	31,454,500	
サカイ引越センター	10,000	2,357.00	23,570,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
近鉄グループ HLDGS	90,000	3,236.00	291,240,000	
阪急阪神 HLDGS	120,100	4,128.00	495,772,800	
南海電鉄	40,200	2,622.00	105,404,400	
京阪ホールディングス	49,600	2,889.50	143,319,200	
神戸電鉄	2,400	2,734.00	6,561,600	貸付株式数 900 株
名古屋鉄道	92,900	1,729.00	160,624,100	
山陽電鉄	6,700	2,074.00	13,895,800	貸付株式数 1,200 株
アルプス物流	7,200	5,680.00	40,896,000	貸付株式数 800 株
トランコム	2,600	6,170.00	16,042,000	
ヤマトホールディングス	109,500	1,773.00	194,143,500	
山 九	21,700	5,708.00	123,863,600	
日 新	6,800	4,455.00	30,294,000	
丸 運	1,700	379.00	644,300	貸付株式数 600 株
丸全昭和運輸	5,600	5,170.00	28,952,000	
センコーグループ HLDGS	47,800	1,121.00	53,583,800	
トナミホールディングス	2,000	5,460.00	10,920,000	
ニッコンホールディングス	27,700	2,968.00	82,213,600	
日石輸送	300	3,030.00	909,000	
福山通運	10,300	3,805.00	39,191,500	貸付株式数 4,000 株
セイノーホールディングス	50,600	2,066.00	104,539,600	
エスライングループ本社	800	1,488.00	1,190,400	貸付株式数 300 株
神奈川中央交通	2,600	3,005.00	7,813,000	
AZ-COM 丸和ホールディ	23,100	1,197.00	27,650,700	
C&F ロジホールディングス	8,300	6,000.00	49,800,000	
日本郵船	233,300	4,891.00	1,141,070,300	
商船三井	195,600	5,017.00	981,325,200	
川崎汽船	217,000	2,365.00	513,205,000	貸付株式数 84,800 株
NS ユナイテッド海運	4,800	4,885.00	23,448,000	貸付株式数 1,800 株
明海グループ	3,300	713.00	2,352,900	貸付株式数 1,200 株
飯野海運	33,000	1,262.00	41,646,000	
共栄タンカー	600	1,217.00	730,200	貸付株式数 200 株
九州旅客鉄道	63,700	3,473.00	221,230,100	
SG ホールディングス	151,300	1,530.50	231,564,650	
NIPPON EXPRESS	30,600	7,551.00	231,060,600	
ID&E ホールディングス	5,600	4,130.00	23,128,000	
日本航空	221,100	2,650.50	586,025,550	
ANA ホールディングス	245,000	2,975.50	728,997,500	
ビーウィズ	1,900	1,826.00	3,469,400	
パスコ	600	1,805.00	1,083,000	
TRE ホールディングス	17,700	1,182.00	20,921,400	貸付株式数 3,400 株
人・夢・技術グループ	3,800	1,705.00	6,479,000	
西本 WISMETTAC HD	2,400	4,265.00	10,236,000	貸付株式数 600 株
シルバーライフ	2,600	905.00	2,353,000	
ヤマシタヘルスケア HLDGS	200	2,645.00	529,000	
GENKY DRUGSTORES	4,200	5,580.00	23,436,000	貸付株式数 1,600 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
コーア商事HLDGS	6,700	707.00	4,736,900	貸付株式数 2,400株
KPPグループホールディン	24,700	806.00	19,908,200	
ナルミヤ・インターナショナル	500	1,308.00	654,000	貸付株式数 100株
ブックオフＧＨＤ	6,200	1,607.00	9,963,400	貸付株式数 900株 (400株)
ギフトホールディングス	4,000	2,947.00	11,788,000	貸付株式数 1,500株
三菱倉庫	21,500	5,198.00	111,757,000	
三井倉庫HOLD	8,400	4,375.00	36,750,000	
住友倉庫	24,000	2,582.00	61,968,000	
渋沢倉庫	4,100	3,035.00	12,443,500	
ヤマタネ	4,200	2,768.00	11,625,600	
東陽倉庫	800	1,494.00	1,195,200	
乾汽船	10,500	1,093.00	11,476,500	貸付株式数 4,100株
日本トランスシティ	18,200	879.00	15,997,800	
ケイヒン	500	2,122.00	1,061,000	
中央倉庫	4,800	1,168.00	5,606,400	貸付株式数 1,400株
川西倉庫	600	1,156.00	693,600	貸付株式数 200株
安田倉庫	6,200	1,473.00	9,132,600	貸付株式数 2,200株
ファイズホールディングス	400	1,028.00	411,200	貸付株式数 100株
ＮＩＳＳＯＨＤ	8,000	846.00	6,768,000	貸付株式数 2,900株
大栄環境	16,800	2,510.00	42,168,000	
日本管財ホールディンク	9,700	2,583.00	25,055,100	
東洋埠頭	900	1,370.00	1,233,000	
上 組	41,600	3,316.00	137,945,600	
サンリツ	700	907.00	634,900	貸付株式数 200株
キムラユニティー	1,400	1,700.00	2,380,000	
キユーソー流通システム	4,600	1,323.00	6,085,800	貸付株式数 1,200株
東海運	1,700	294.00	499,800	貸付株式数 600株
エーアイテイー	5,600	1,795.00	10,052,000	貸付株式数 2,100株
内外トランスライン	3,600	2,656.00	9,561,600	貸付株式数 1,300株
ショーエイコーポ	1,000	587.00	587,000	貸付株式数 300株
日本コンセプト	3,200	1,895.00	6,064,000	
TBSホールディングス	45,500	3,890.00	176,995,000	貸付株式数 17,000株
日本テレビHLDS	80,100	2,161.50	173,136,150	貸付株式数 17,900株
朝日放送グループHD	8,500	662.00	5,627,000	貸付株式数 3,200株
テレビ朝日ＨＤ	22,000	2,078.00	45,716,000	
スカパーJSATHD	70,300	913.00	64,183,900	
テレビ東京ＨＤ	6,500	3,120.00	20,280,000	貸付株式数 2,300株
日本ＢＳ放送	1,100	896.00	985,600	貸付株式数 400株
ビジョン	13,500	1,238.00	16,713,000	
スマートバリュー	800	395.00	316,000	貸付株式数 300株
U-NEXT HOLDINGS	10,100	4,705.00	47,520,500	
ワイヤレスゲート	1,300	234.00	304,200	貸付株式数 500株
日本通信	88,800	183.00	16,250,400	貸付株式数 33,900株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
クロップス	400	1,138.00	455,200	
日本電信電話	26,911,600	152.50	4,104,019,000	
ＫＤＤＩ	699,100	4,284.00	2,994,944,400	
ソフトバンク	1,444,500	1,937.50	2,798,718,750	
光通信	9,100	27,710.00	252,161,000	
エムティーアイ	6,200	844.00	5,232,800	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	33,200	2,505.50	83,182,600	
ファイバーゲート	4,900	1,205.00	5,904,500	貸付株式数 1,200株
アイドママーケティングコミュ	800	231.00	184,800	貸付株式数 300株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	47,800	3,330.00	159,174,000	
学研ホールディングス	16,600	966.00	16,035,600	
ゼンリン	15,400	892.00	13,736,800	
昭文社ホールディングス	1,200	355.00	426,000	
インプレスホールディングス	2,900	158.00	458,200	貸付株式数 1,100株
東京電力ＨＤ	813,100	921.90	749,596,890	貸付株式数 255,600株
中部電力	332,400	2,036.50	676,932,600	
関西電力	348,300	2,813.00	979,767,900	
中国電力	156,700	1,110.00	173,937,000	
北陸電力	92,200	1,096.50	101,097,300	
東北電力	237,500	1,492.50	354,468,750	
四国電力	84,000	1,472.50	123,690,000	
九州電力	207,900	1,781.50	370,373,850	
北海道電力	87,100	1,464.00	127,514,400	
沖縄電力	23,100	1,105.00	25,525,500	
電源開発	74,100	2,535.50	187,880,550	
エフオン	6,700	405.00	2,713,500	
イーレックス	16,100	663.00	10,674,300	貸付株式数 6,200株
レノバ	24,100	1,033.00	24,895,300	貸付株式数 9,400株
東京瓦斯	175,600	3,521.00	618,287,600	
大阪瓦斯	179,800	3,508.00	630,738,400	
東邦瓦斯	39,100	3,911.00	152,920,100	
北海道瓦斯	5,400	3,445.00	18,603,000	貸付株式数 1,000株
広島ガス	19,100	379.00	7,238,900	
西部ガスHLDGS	9,400	1,959.00	18,414,600	貸付株式数 3,600株
静岡ガス	18,000	949.00	17,082,000	貸付株式数 600株
メタウォーター	10,800	1,915.00	20,682,000	
アイネット	5,500	2,265.00	12,457,500	
松竹	4,700	9,730.00	45,731,000	貸付株式数 1,800株
東宝	50,300	5,112.00	257,133,600	
エイチ・アイ・エス	27,000	1,724.00	46,548,000	貸付株式数 10,500株
東映	14,900	3,850.00	57,365,000	
ラックランド	4,200	1,782.00	7,484,400	貸付株式数 1,500株
NTTデータグループ	236,500	2,369.50	560,386,750	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
共立メンテナンス	29,100	3,086.00	89,802,600	貸付株式数 2,800株
イチネンホールディングス	9,800	1,626.00	15,934,800	
建設技術研究所	4,800	4,875.00	23,400,000	
スペース	6,100	1,058.00	6,453,800	
アインホールディングス	13,100	5,852.00	76,661,200	貸付株式数 800株
燦ホールディングス	8,600	1,174.00	10,096,400	
ピー・シー・エー	5,200	2,105.00	10,946,000	
スバル興業	3,200	2,700.00	8,640,000	
東京テアトル	1,100	1,103.00	1,213,300	
タナベコンサルティンググル	3,600	1,042.00	3,751,200	
ビジネスＢ太田昭和	3,500	2,109.00	7,381,500	
ナ ガ ワ	2,900	7,700.00	22,330,000	貸付株式数 1,100株
東京都競馬	7,800	4,170.00	32,526,000	貸付株式数 2,700株
常磐興産	1,100	1,206.00	1,326,600	貸付株式数 400株
カナモト	14,400	2,567.00	36,964,800	
ＤＴＳ	19,000	4,245.00	80,655,000	
スクウェア・エニックス・HD	41,300	4,838.00	199,809,400	
シーイーシー	11,400	1,740.00	19,836,000	
カプコン	161,800	3,060.00	495,108,000	
ニシオホールディングス	7,700	3,865.00	29,760,500	
アイ・エス・ビー	4,600	1,401.00	6,444,600	貸付株式数 1,200株
アゴーラ ホスピタリティーG	19,200	45.00	864,000	貸付株式数 7,600株
日本空港ビルデング	31,400	5,491.00	172,417,400	
トランス・コスモス	11,500	3,475.00	39,962,500	貸付株式数 1,400株
乃村工藝社	40,500	815.00	33,007,500	
ジャステック	5,200	1,934.00	10,056,800	
ＳＣＳＫ	63,300	3,044.00	192,685,200	
藤田観光	3,700	6,110.00	22,607,000	貸付株式数 1,400株
KNT-CTホールディングス	5,600	1,328.00	7,436,800	貸付株式数 1,700株
トーカイ	8,200	2,134.00	17,498,800	
白 洋 舎	500	2,438.00	1,219,000	貸付株式数 100株
セコム	94,400	9,769.00	922,193,600	
ＮＳＷ	4,000	3,045.00	12,180,000	
セントラル警備保障	5,000	2,966.00	14,830,000	
アイネス	7,100	1,690.00	11,999,000	
丹青社	18,000	852.00	15,336,000	
メイテックグループホールデ	31,600	3,083.00	97,422,800	
ＴＫＣ	16,200	3,240.00	52,488,000	
富士ソフト	18,200	6,230.00	113,386,000	貸付株式数 5,900株
応用地質	8,600	2,544.00	21,878,400	
船井総研ホールディン	18,600	2,232.00	41,515,200	貸付株式数 1,900株
ＮＳＤ	31,900	2,900.00	92,510,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
進学会ホールディングス	800	237.00	189,600	貸付株式数 300株 (300株)
丸紅建材リース	200	3,050.00	610,000	
オ オ バ	2,000	1,002.00	2,004,000	貸付株式数 800株 (800株)
コナミグループ	33,900	11,190.00	379,341,000	
いであ	800	2,384.00	1,907,200	
学 究 社	3,700	2,083.00	7,707,100	
イオンディライト	10,000	3,825.00	38,250,000	
ナック	7,800	532.00	4,149,600	貸付株式数 2,400株
福井コンピュータHLDS	5,600	2,405.00	13,468,000	
ダイセキ	18,900	3,255.00	61,519,500	
ステップ	3,400	1,917.00	6,517,800	
泉州電業	5,900	5,100.00	30,090,000	貸付株式数 700株
元気寿司	5,400	3,190.00	17,226,000	貸付株式数 1,900株
トラスコ中山	20,100	2,418.00	48,601,800	
ヤマダホールディングス	293,900	433.90	127,523,210	
オートバックスセブン	33,200	1,524.50	50,613,400	貸付株式数 13,000株
モリト	6,800	1,435.00	9,758,000	
アークランズ	28,400	1,942.00	55,152,800	
ニトリホールディングス	34,700	17,610.00	611,067,000	
グルメ杵屋	7,700	1,104.00	8,500,800	貸付株式数 3,000株
愛 眼	2,500	184.00	460,000	貸付株式数 900株
ケーユーホールディングス	4,500	1,239.00	5,575,500	
吉野家ホールディングス	35,200	2,934.00	103,276,800	貸付株式数 13,700株
加藤産業	11,800	4,125.00	48,675,000	
北恵	800	861.00	688,800	
イノテック	6,000	1,686.00	10,116,000	
イエローハット	15,100	2,096.00	31,649,600	
松屋フーズHLDGS	4,500	5,470.00	24,615,000	
JBCCホールディングス	6,000	3,025.00	18,150,000	
JKホールディングス	7,300	1,017.00	7,424,100	
サガミホールディングス	14,300	1,552.00	22,193,600	貸付株式数 300株
日 伝	6,300	3,230.00	20,349,000	
関西フードマーケット	6,500	2,482.00	16,133,000	
ミロク情報サービス	8,200	1,752.00	14,366,400	
北沢産業	1,900	367.00	697,300	貸付株式数 700株
杉本商事	4,600	2,448.00	11,260,800	
因幡電機産業	24,800	3,800.00	94,240,000	
王将フードサービス	7,100	8,550.00	60,705,000	
ミニストップ	6,900	1,628.00	11,233,200	貸付株式数 2,700株 (500株)
アークス	17,500	2,948.00	51,590,000	
バローホールディングス	18,200	2,357.00	42,897,400	
東 テ ク	9,500	2,505.00	23,797,500	
ミスミグループ本社	144,200	2,640.50	380,760,100	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
アルテック	1,600	276.00	441,600	
ベ ル ク	4,700	7,360.00	34,592,000	
大 庄	5,100	1,220.00	6,222,000	貸付株式数 2,000株 (500株)
タキヒヨー	800	1,113.00	890,400	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	53,700	40,740.00	2,187,738,000	
ソフトバンクグループ	446,300	9,420.00	4,204,146,000	
蔵王産業	600	2,549.00	1,529,400	
スズケン	34,100	4,728.00	161,224,800	
サンドラッグ	32,200	3,950.00	127,190,000	
サックスバーホールディング	8,100	778.00	6,301,800	貸付株式数 3,000株
ジェコス	5,700	983.00	5,603,100	
ヤマザワ	700	1,270.00	889,000	貸付株式数 200株
や ま や	700	3,080.00	2,156,000	貸付株式数 200株
ベルーナ	23,000	726.00	16,698,000	
合計			349,141,127,490	

（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 60,000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

	2023年6月5日現在 金　額（円）	2024年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	784,015,541	2,017,192,359
コール・ローン	5,690,886,574	10,083,776,658
株式	327,359,557,109	530,134,605,136
投資証券	7,257,163,279	10,450,150,346
派生商品評価勘定	625,902,486	192,509,225
未収入金	193,360,845	170,512,961
未収配当金	502,849,758	721,053,905
差入委託証拠金	6,119,865,130	11,702,933,022
流動資産合計	348,533,600,722	565,472,733,612
資産合計	348,533,600,722	565,472,733,612
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,405,787	239,530,120
未払金	170,226,669	255,565,063
未払解約金	238,776,100	512,987,500
流動負債合計	420,408,556	1,008,082,683
負債合計	420,408,556	1,008,082,683
純資産の部		
元本等		
元本　※1	73,305,284,321	87,479,090,223
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	274,807,907,845	476,985,560,706
元本等合計	348,113,192,166	564,464,650,929
純資産合計	348,113,192,166	564,464,650,929
負債純資産合計	348,533,600,722	565,472,733,612

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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。

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 日
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 6 月 5 日現在	2024 年 6 月 5 日現在
1.　※1　期首	2022 年 6 月 7 日	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	65,219,352,126 円	73,305,284,321 円
期中追加設定元本額	13,276,965,835 円	19,614,413,968 円
期中一部解約元本額	5,191,033,640 円	5,440,608,066 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	294,614,706 円	231,936,141 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,700,422 円	1,404,824 円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	33,702,693 円	18,155,186 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	5,352,543 円	3,622,837 円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	150,034,208 円	105,788,926 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）	87,595,091 円	104,499,374 円
ダイワバランスファンド 2023-01（適格機関投資家専用）	105,598,925 円	81,610,632 円
外国株式インデックスファンド VA（適格機関投資家専用）	-円	3,603,803,431 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）	628,464,988 円	763,469,634 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）	3,545,008,347 円	5,126,154,738 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）	598,060,561 円	564,172,689 円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国株式インデックス	18,214,545円	16,373,983円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	49,601,005円	48,058,214円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	6,838,207,767円	8,558,889,201円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,473,361,115円	1,462,261,186円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	285,687,220円	334,607,922円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	160,733円	14,772,586円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	45,285,958,135円	49,943,452,503円
ダイワ・ライフ・バランス３０	530,080,997円	478,833,626円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,054,132,356円	1,041,222,730円
ダイワ・ライフ・バランス７０	921,363,577円	1,023,844,885円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,948,055,233円	1,366,688,095円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,522,141円	9,967,772円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,720,324円	11,386,436円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,735,073,784円	2,471,584,963円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,074,276円	1,895,870円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,254,312円	2,491,246円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,627,914円	5,489,995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）	5,028,864円	14,807,459円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	66,467,884円	43,911,825円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	40,358,122円	29,814,954円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,086,845,160円	757,743,173円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	58,861,714円	43,613,830円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	160,746,206円	127,189,928円
スタイル９（4資産分散・保守型）	－円	124,453円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	－円	1,014,951円
スタイル９（4資産分散・積極型）	－円	1,440,142円
スタイル９（6資産分散・保守型）	－円	76,460円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
スタイル９（6資産分散・バランス型）	-円	1,801,643円
スタイル９（6資産分散・積極型）	-円	2,269,705円
スタイル９（8資産分散・保守型）	-円	92,986円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	-円	1,345,037円
スタイル９（8資産分散・積極型）	-円	3,991,541円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,270,278,248円	1,293,913,568円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	419,653,362円	421,965,105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）	1,544,600,019円	3,870,699,940円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,938,348,326円	3,166,373,432円
ダイワライフスタイル２５	10,050,870円	7,301,752円
ダイワライフスタイル５０	43,338,052円	34,877,865円
ダイワライフスタイル７５	34,479,576円	29,822,878円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	81,305,208円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	-円	78,711,436円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	-円	68,441,327円
計	73,305,284,321円	87,479,090,223円
2. 期末日における受益権の総数	73,305,284,321口	87,479,090,223口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月6日 至2024年6月5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。

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 日
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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024 年 6 月 5 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	2023 年 6 月 5 日現在	2024 年 6 月 5 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	21,845,872,690	63,301,081,448
投資証券	△267,067,608	397,731,996
合計	21,578,805,082	63,698,813,444

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

（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	2023年6月5日現在				2024年6月5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	13,027,055,445	－	13,587,168,704	560,113,259	23,734,820,629	－	23,787,857,974	53,037,345
合計	13,027,055,445	－	13,587,168,704	560,113,259	23,734,820,629	－	23,787,857,974	53,037,345

（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	2023年6月5日現在				2024年6月5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	5,725,440,370	－	5,779,823,810	54,383,440	9,709,805,240	－	9,609,747,000	△100,058,240
アメリカ・ドル	3,006,153,860	－	3,026,854,880	20,701,020	4,873,583,360	－	4,823,208,000	△50,375,360
イギリス・ポンド	345,030,080	－	346,964,200	1,934,120	518,736,540	－	513,500,000	△5,236,540
オーストラリア・ドル	441,188,160	－	451,376,240	10,188,080	646,630,210	－	638,104,000	△8,526,210
カナダ・ドル	643,298,790	－	654,772,230	11,473,440	1,437,128,840	－	1,413,625,000	△23,503,840
スイス・フラン	518,741,400	－	522,870,700	4,129,300	958,226,880	－	957,935,000	△291,880
ユーロ	771,028,080	－	776,985,560	5,957,480	1,275,499,410	－	1,263,375,000	△12,124,410
合計	5,725,440,370	－	5,779,823,810	54,383,440	9,709,805,240	－	9,609,747,000	△100,058,240

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.7488円 (47,488円)	6.4526円 (64,526円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	6,800	199.980	1,359,864.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	18,500	290.090	5,366,665.000	
	FIRST SOLAR INC	5,900	266.170	1,570,403.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	10,000	135.840	1,358,400.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,500	151.880	1,139,100.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	23,300	42.520	990,716.000	
	ABBOTT LABORATORIES	99,166	103.430	10,256,739.380	
	HOWMET AEROSPACE INC	22,183	82.290	1,825,439.070	
	VERISK ANALYTICS INC	8,200	258.250	2,117,650.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	21,300	43.570	928,041.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	34,400	130.050	4,473,720.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,800	726.560	2,034,368.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	32,900	76.070	2,502,703.000	
	QORVO INC	5,420	97.700	529,534.000	
	AFLAC INC	31,300	88.040	2,755,652.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	6,900	149.810	1,033,689.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	9,200	93.520	860,384.000	
	ADOBE INC	25,620	448.370	11,487,239.400	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,800	80.510	869,508.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	6,600	306.780	2,024,748.000	
	GARMIN LTD	8,800	163.030	1,434,664.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,800	270.300	3,459,840.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,300	207.230	7,729,679.000	
	WR BERKLEY CORP	11,742	80.340	943,352.280	
	AUTOZONE INC	1,020	2,790.980	2,846,799.600	
	DOLLAR TREE INC	11,871	120.300	1,428,081.300	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	67,900	16.630	1,129,177.000	
	CELANESE CORP	6,450	145.250	936,862.500	
	DR HORTON INC	17,116	143.870	2,462,478.920	
	AUTODESK INC	12,300	212.000	2,607,600.000	
	MOODY'S CORP	9,400	406.500	3,821,100.000	
	DEVON ENERGY CORP	36,300	46.650	1,693,395.000	
	ALBEMARLE CORP	6,800	118.310	804,508.000	
	ATMOS ENERGY CORP	8,700	115.890	1,008,243.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	14,700	51.780	761,166.000	
	CITIGROUP INC	109,573	61.030	6,687,240.190	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	23,500	245.670	5,773,245.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	30,100	90.380	2,720,438.000	
	DOMINO'S PIZZA INC	2,030	520.980	1,057,589.400	
	HESS CORP	15,800	148.040	2,339,032.000	
	DAVITA INC	3,150	143.310	451,426.500	
	DANAHER CORP	40,250	263.330	10,599,032.500	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FORTIVE CORP	20,100	72.780	1,462,878.000	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	32,800	134.760	4,420,128.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	29,600	61.820	1,829,872.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	17,695	148.190	2,622,222.050	
	APPLE INC	838,200	194.350	162,904,170.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,400	121.100	1,743,840.000	
	BOEING CO/THE	33,200	188.620	6,262,184.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,015	114.840	1,035,282.600	
	BECTON DICKINSON AND CO	16,599	238.500	3,958,861.500	
	LEIDOS HOLDINGS INC	7,400	144.520	1,069,448.000	
	NISOURCE INC	25,600	29.110	745,216.000	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,700	85.990	576,133.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	43,171	58.870	2,541,476.770	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	240,304	41.560	9,987,034.240	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,950	409.530	30,694,273.500	
	ANSYS INC	5,000	317.100	1,585,500.000	
	TRUIST FINANCIAL CORP	76,317	36.650	2,797,018.050	
	BLACKSTONE GROUP INC/THE	40,900	119.080	4,870,372.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	115,800	41.750	4,834,650.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	164,070	199.160	32,676,181.200	
	T ROWE PRICE GROUP INC	12,800	116.570	1,492,096.000	
	LKQ CORP	15,300	42.080	643,824.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	17,012	45.740	778,128.880	
	CADENCE DESIGN SYS INC	15,600	287.130	4,479,228.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,800	424.550	2,462,390.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	12,600	134.510	1,694,826.000	
	SERVICENOW INC	11,800	672.000	7,929,600.000	
	CATERPILLAR INC	28,600	327.570	9,368,502.000	
	BROWN & BROWN INC	13,900	89.900	1,249,610.000	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	14,900	38.010	566,349.000	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	3,000	210.230	630,690.000	
	CMS ENERGY CORP	17,100	62.880	1,075,248.000	
	MOSAIC CO/THE	18,200	29.750	541,450.000	
	DELTA AIR LINES INC	9,300	49.860	463,698.000	
	CORNING INC	46,400	37.010	1,717,264.000	
	CISCO SYSTEMS INC	231,350	47.420	10,970,617.000	
	MORGAN STANLEY	70,152	96.580	6,775,280.160	
	DECKERS OUTDOOR CORP	1,500	1,066.830	1,600,245.000	
	MSCI INC	4,600	493.190	2,268,674.000	
	FAIR ISAAC CORP	1,500	1,302.740	1,954,110.000	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	1,900	487.190	925,661.000	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,600	214.480	772,128.000	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,800	62.300	797,440.000	
	BROADCOM INC	25,212	1,330.820	33,552,633.840	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	2,600	273.190	710,294.000	
	CNH INDUSTRIAL NV	55,600	10.250	569,900.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,400	220.570	749,938.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,300	149.760	1,093,248.000	
	DTE ENERGY COMPANY	11,900	116.530	1,386,707.000	
	CENTENE CORP	30,607	70.140	2,146,774.980	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,100	175.720	1,071,892.000	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,900	34.170	885,003.000	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,400	255.220	3,164,728.000	
	GARTNER INC	4,450	428.120	1,905,134.000	
	DOMINION ENERGY INC	47,941	53.280	2,554,296.480	
	MONSTER BEVERAGE CORP	44,600	52.190	2,327,674.000	
	SMITH (A.O.) CORP	7,000	81.250	568,750.000	
	DEERE & CO	15,200	369.370	5,614,424.000	
	QUANTA SERVICES INC	8,400	270.020	2,268,168.000	
	POOL CORP	2,200	354.090	778,998.000	
	GLOBAL PAYMENTS INC	14,784	97.540	1,442,031.360	
	BURLINGTON STORES INC	3,700	228.980	847,226.000	
	NASDAQ INC	23,300	59.430	1,384,719.000	
	TARGA RESOURCES CORP	12,100	116.730	1,412,433.000	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,100	127.940	524,554.000	
	WESTLAKE CORP	2,300	154.230	354,729.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	19,800	93.720	1,855,656.000	
	TELEFLEX INC	2,700	215.050	580,635.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,800	158.510	760,848.000	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,200	318.420	1,337,364.000	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,200	288.420	346,104.000	
	CATALENT INC	10,400	54.960	571,584.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,800	178.920	1,574,496.000	
	MOLINA HEALTHCARE INC	3,400	307.710	1,046,214.000	
	CARLISLE COS INC	2,800	402.690	1,127,532.000	
	IDEX CORP	4,400	206.100	906,840.000	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	44,700	93.810	4,193,307.000	
	ROLLINS INC	16,607	47.300	785,511.100	
	AECOM	7,800	85.090	663,702.000	
	WATSCO INC	2,000	459.900	919,800.000	
	GRACO INC	9,700	78.110	757,667.000	
	AMETEK INC	13,300	166.870	2,219,371.000	
	TORO CO	6,000	79.310	475,860.000	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	14,000	108.110	1,513,540.000	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	9,050	47.550	430,327.500	
	HEICO CORP	2,600	228.600	594,360.000	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,200	396.150	871,530.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,900	94.430	1,407,007.000	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	2,500	479.100	1,197,750.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	25,360	827.390	20,982,610.400	
	EPAM SYSTEMS INC	3,400	174.510	593,334.000	
	RPM INTERNATIONAL INC	7,400	110.430	817,182.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	RELIANCE INC	3,300	288.150	950,895.000	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,600	3,079.040	4,926,464.000	
	CUMMINS INC	7,900	273.110	2,157,569.000	
	CDW CORP/DE	7,700	221.910	1,708,707.000	
	COSTAR GROUP INC	23,400	78.620	1,839,708.000	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,200	172.140	1,927,968.000	
	MERCADOLIBRE INC	2,690	1,630.650	4,386,448.500	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,200	161.700	679,140.000	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,416	200.440	2,889,543.040	
	DEXCOM INC	22,100	116.710	2,579,291.000	
	NORDSON CORP	3,190	228.050	727,479.500	
	COPART INC	49,500	52.990	2,623,005.000	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,700	189.220	1,835,434.000	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,100	248.910	1,020,531.000	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,300	282.990	1,216,857.000	
	TRANSDIGM GROUP INC	3,190	1,340.830	4,277,247.700	
	BIO-TECHNE CORP	9,020	76.900	693,638.000	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,700	133.480	760,836.000	
	KINDER MORGAN INC	114,181	19.660	2,244,798.460	
	HCA HEALTHCARE INC	11,400	332.000	3,784,800.000	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,200	199.500	438,900.000	
	COTERRA ENERGY INC	43,000	27.480	1,181,640.000	
	T-MOBILE US INC	30,627	177.910	5,448,849.570	
	ZILLOW GROUP INC - C	9,050	41.920	379,376.000	
	EMCOR GROUP INC	2,900	368.890	1,069,781.000	
	COCA-COLA CO/THE	234,050	63.940	14,965,157.000	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,200	73.870	901,214.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	8,150	122.340	997,071.000	
	FRANKLIN RESOURCES INC	16,500	23.450	386,925.000	
	CSX CORP	111,900	32.770	3,666,963.000	
	EXPEDIA GROUP INC	7,425	114.490	850,088.250	
	AMAZON.COM INC	535,200	179.340	95,982,768.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,400	87.410	3,006,904.000	
	EXXON MOBIL CORP	256,209	112.670	28,867,068.030	
	AES CORP	40,800	20.490	835,992.000	
	EVEREST GROUP LTD	2,500	384.710	961,775.000	
	EOG RESOURCES INC	33,200	119.800	3,977,360.000	
	EQT CORP	24,100	40.620	978,942.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,700	91.060	792,222.000	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	600	1,669.720	1,001,832.000	
	CENCORA INC	10,300	230.670	2,375,901.000	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,800	130.850	2,198,280.000	
	FORD MOTOR CO	222,923	12.030	2,681,763.690	
	EXACT SCIENCES CORP	10,400	43.450	451,880.000	
	ENTEGRIS INC	8,700	126.390	1,099,593.000	
	MICROSTRATEGY INC-CL A	1,000	1,638.770	1,638,770.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AERCAP HOLDINGS NV	11,900	92.120	1,096,228.000	
	FORTINET INC	37,100	58.640	2,175,544.000	
	MARKEL CORP	730	1,604.940	1,171,606.200	
	NEXTERA ENERGY INC	117,380	77.150	9,055,867.000	
	FREEPORT-MCMORAN INC	82,008	49.700	4,075,797.600	
	INSULET CORP	4,100	181.810	745,421.000	
	US BANCORP	89,100	38.960	3,471,336.000	
	UNITED RENTALS INC	3,900	631.200	2,461,680.000	
	F5 NETWORKS INC	3,400	167.810	570,554.000	
	SUPER MICRO COMPUTER INC	3,100	771.610	2,391,991.000	
	FASTENAL CO	32,800	64.340	2,110,352.000	
	FISERV INC	33,733	147.990	4,992,146.670	
	GENERAL ELECTRIC CO	62,506	161.380	10,087,218.280	
	AXON ENTERPRISE INC	4,100	276.220	1,132,502.000	
	PAYLOCITY HOLDING CORP	2,600	139.800	363,480.000	
	GENERAL MOTORS CO	76,100	45.260	3,444,286.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	13,400	297.320	3,984,088.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,550	455.300	8,445,815.000	
	ALPHABET INC-CL A	336,700	173.790	58,515,093.000	
	ALPHABET INC-CL C	291,540	175.130	51,057,400.200	
	OWENS CORNING	5,000	175.460	877,300.000	
	GENERAL MILLS INC	32,300	68.140	2,200,922.000	
	FIRSTENERGY CORP	31,218	40.210	1,255,275.780	
	GENUINE PARTS CO	8,050	144.770	1,165,398.500	
	FIFTH THIRD BANCORP	39,100	36.170	1,414,247.000	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,950	226.690	2,482,255.500	
	HALLIBURTON CO	50,900	33.870	1,723,983.000	
	REPLIGEN CORP	3,100	147.750	458,025.000	
	HOME DEPOT INC	56,650	328.260	18,595,929.000	
	ASSURANT INC	3,050	171.800	523,990.000	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	83,300	13.480	1,122,884.000	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,310	250.460	578,562.600	
	HERSHEY CO/THE	8,600	200.070	1,720,602.000	
	HUMANA INC	6,900	360.870	2,490,003.000	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,700	266.300	3,914,610.000	
	HENRY SCHEIN INC	7,400	69.640	515,336.000	
	HP INC	56,100	35.350	1,983,135.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	74,300	17.600	1,307,680.000	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,500	100.860	2,168,490.000	
	KRAFT HEINZ CO/THE	52,203	35.630	1,859,992.890	
	ENPHASE ENERGY INC	7,800	129.770	1,012,206.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	52,400	165.810	8,688,444.000	
	HUBBELL INC	3,100	371.770	1,152,487.000	
	INTERNATIONAL PAPER CO	18,900	44.220	835,758.000	
	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,300	66.620	486,326.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ZOETIS INC	26,200	171.880	4,503,256.000	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,999	319.530	4,153,570.470	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	7,900	61.550	486,245.000	
	CHENIERE ENERGY INC	13,200	160.870	2,123,484.000	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	2,600	143.840	373,984.000	
	ALLEGION PLC	4,950	117.640	582,318.000	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,000	146.520	1,025,640.000	
	WASTE CONNECTIONS INC	14,737	166.320	2,451,057.840	
	JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.240	595,556.000	
	JM SMUCKER CO/THE	6,100	111.700	681,370.000	
	JOHNSON & JOHNSON	137,800	147.800	20,366,840.000	
	ABBVIE INC	101,272	162.140	16,420,242.080	
	HOLOGIC INC	13,300	74.650	992,845.000	
	KIMBERLY-CLARK CORP	19,300	137.390	2,651,627.000	
	KROGER CO	39,200	52.040	2,039,968.000	
	KLA CORP	7,800	750.560	5,854,368.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	12,400	468.890	5,814,236.000	
	CORPAY INC	4,000	257.920	1,031,680.000	
	BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	12,300	45.170	555,591.000	
	LOWE'S COS INC	32,700	216.530	7,080,531.000	
	ELI LILLY & CO	46,185	832.590	38,453,169.150	
	LAM RESEARCH CORP	7,580	922.730	6,994,293.400	
	LOEWS CORP	10,800	75.550	815,940.000	
	MCDONALD'S CORP	41,250	262.720	10,837,200.000	
	3M CO	31,590	98.610	3,115,089.900	
	META PLATFORMS INC CLASS A	125,200	476.990	59,719,148.000	
	S&P GLOBAL INC	18,339	431.840	7,919,513.760	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,600	555.800	2,000,880.000	
	PHILLIPS 66	24,500	136.990	3,356,255.000	
	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	9,100	157.940	1,437,254.000	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	39.440	601,460.000	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,400	68.870	991,728.000	
	METLIFE INC	35,000	70.310	2,460,850.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	49,500	66.380	3,285,810.000	
	ARISTA NETWORKS INC	15,200	293.180	4,456,336.000	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,598	369.220	3,543,773.560	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,300	1,406.830	1,828,879.000	
	BAKER HUGHES CO	57,223	31.630	1,809,963.490	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	6,600	254.990	1,682,934.000	
	MERCK & CO. INC.	144,721	128.710	18,627,039.910	
	DUPONT DE NEMOURS INC	23,851	80.340	1,916,189.340	
	MASCO CORP	12,500	67.240	840,500.000	
	M & T BANK CORP	9,599	146.510	1,406,349.490	
	MARSH & MCLENNAN COS	28,170	208.490	5,873,163.300	
	HEICO CORP-CLASS A	4,320	180.640	780,364.800	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	14,102	230.510	3,250,652.020	
	WORKDAY INC-CLASS A	12,100	211.120	2,554,552.000	
	BLOCK INC CLASS A	31,812	64.250	2,043,921.000	
	TRANSUNION	11,100	71.990	799,089.000	
	VISTRA CORP	20,000	89.550	1,791,000.000	
	NETAPP INC	11,800	119.000	1,404,200.000	
	NIKE INC -CL B	69,300	94.740	6,565,482.000	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	13,000	221.710	2,882,230.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30,900	94.000	2,904,600.000	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,405	118.970	1,356,852.850	
	ALLY FINANCIAL INC	15,700	37.940	595,658.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	8,100	448.390	3,631,959.000	
	APTIV PLC	15,700	83.790	1,315,503.000	
	NEWMONT CORP	65,911	40.530	2,671,372.830	
	MCKESSON CORP	7,600	573.730	4,360,348.000	
	XYLEM INC	13,900	137.100	1,905,690.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	88,800	103.790	9,216,552.000	
	NUCOR CORP	13,800	161.180	2,224,284.000	
	GODADDY INC - CLASS A	7,800	138.800	1,082,640.000	
	EVERGY INC	13,150	54.580	717,727.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,024	59.890	2,277,257.360	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,450	361.140	523,653.000	
	OKTA INC	9,200	86.620	796,904.000	
	WIX.COM LTD	3,210	164.670	528,590.700	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	18,800	40.180	755,384.000	
	KKR & CO INC	35,600	101.310	3,606,636.000	
	PAYCHEX INC	18,600	121.570	2,261,202.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,400	970.300	3,299,020.000	
	ALTRIA GROUP INC	98,300	46.830	4,603,389.000	
	P G & E CORP	115,900	18.320	2,123,288.000	
	PFIZER INC	322,713	29.490	9,516,806.370	
	CIGNA CORP	16,300	337.060	5,494,078.000	
	DELL TECHNOLOGIES -C	15,101	135.760	2,050,111.760	
	XCEL ENERGY INC	31,800	56.030	1,781,754.000	
	STERIS PLC	5,700	228.500	1,302,450.000	
	SEA LTD-ADR	22,200	70.080	1,555,776.000	
	FOX CORP - CLASS B	8,133	32.170	261,638.610	
	FOX CORP - CLASS A	13,699	34.520	472,889.480	
	STRYKER CORP	19,580	342.000	6,696,360.000	
	DOW INC	40,218	55.150	2,218,022.700	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,700	107.940	723,198.000	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	14,200	61.530	873,726.000	
	PARKER HANNIFIN CORP	7,400	512.450	3,792,130.000	
	UBER TECHNOLOGIES INC	107,200	64.550	6,919,760.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	134,467	167.010	22,457,333.670	
	EXELON CORP	57,222	37.360	2,137,813.920	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	INGERSOLL-RAND INC	23,108	87.960	2,032,579.680	
	NVR INC	180	7,543.180	1,357,772.400	
	CONOCOPHILLIPS	67,202	112.270	7,544,768.540	
	TWILIO INC - A	9,900	56.740	561,726.000	
	DOCUSIGN INC	11,800	53.200	627,760.000	
	PAYCOM SOFTWARE INC	3,000	146.630	439,890.000	
	DAYFORCE INC	8,500	49.770	423,045.000	
	PURE STORAGE INC - CLASS A	18,700	60.440	1,130,228.000	
	PEPSICO INC	78,600	173.890	13,667,754.000	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,620	229.290	600,739.800	
	MONGODB INC	4,200	232.150	975,030.000	
	SNAP INC - A	59,900	14.890	891,911.000	
	CORTEVA INC	39,968	53.700	2,146,281.600	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,600	117.980	2,430,388.000	
	AMCOR PLC	82,600	10.180	840,868.000	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,200	305.580	4,033,656.000	
	ROKU INC	7,300	57.780	421,794.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,200	132.820	1,487,584.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	36,000	288.060	10,370,160.000	
	PENTAIR PLC	9,475	78.950	748,051.250	
	QUALCOMM INC	63,800	204.370	13,038,806.000	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,500	79.760	1,076,760.000	
	DATADOG INC - CLASS A	15,800	108.840	1,719,672.000	
	PINTEREST INC- CLASS A	34,100	40.680	1,387,188.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	6,200	993.290	6,158,398.000	
	REPUBLIC SERVICES INC	12,700	187.360	2,379,472.000	
	BOOKING HOLDINGS INC	2,000	3,801.360	7,602,720.000	
	ROSS STORES INC	19,200	140.940	2,706,048.000	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	5,130	182.030	933,813.900	
	RESMED INC	8,500	211.180	1,795,030.000	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	6,330	141.570	896,138.100	
	MODERNA INC	18,700	145.340	2,717,858.000	
	HUBSPOT INC	2,780	608.930	1,692,825.400	
	REVVITY INC	7,100	108.530	770,563.000	
	CARRIER GLOBAL CORP	46,387	61.270	2,842,131.490	
	OTIS WORLDWIDE CORP	23,238	99.210	2,305,441.980	
	AVANTOR INC	38,900	24.180	940,602.000	
	CARLYLE GROUP INC/THE	13,500	42.180	569,430.000	
	DYNATRACE INC	15,200	45.880	697,376.000	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	25,500	94.480	2,409,240.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	52,485	18.660	979,370.100	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	21,700	27.020	586,334.000	
	MATCH GROUP INC	15,100	31.080	469,308.000	
	CHEVRON CORP	100,218	156.130	15,647,036.340	
	ZSCALER INC	5,200	169.140	879,528.000	
	EDISON INTERNATIONAL	22,000	76.520	1,683,440.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ETSY INC	6,700	64.910	434,897.000	
	TESLA INC	163,850	174.770	28,636,064.500	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,300	137.000	2,370,100.000	
	GEN DIGITAL INC	32,800	24.820	814,096.000	
	UNITY SOFTWARE INC	15,600	17.950	280,020.000	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	8,802	83.020	730,742.040	
	SYNOPSYS INC	8,800	561.730	4,943,224.000	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,100	68.020	1,163,142.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,405	280.600	1,516,643.000	
	VIATRIS INC	66,721	10.530	702,572.130	
	DOORDASH INC - A	16,250	111.300	1,808,625.000	
	ROBLOX CORP -CLASS A	27,200	35.000	952,000.000	
	AIRBNB INC-CLASS A	25,300	147.080	3,721,124.000	
	CBRE GROUP INC - A	17,500	85.640	1,498,700.000	
	SOUTHERN CO/THE	62,400	80.710	5,036,304.000	
	SYSCO CORP	28,500	72.700	2,071,950.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	13,103	209.640	2,746,912.920	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,400	74.330	252,722.000	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	6,400	66.970	428,608.000	
	STEEL DYNAMICS INC	8,650	127.240	1,100,626.000	
	SCHLUMBERGER LTD	81,352	43.410	3,531,490.320	
	AT&T INC	408,791	18.350	7,501,314.850	
	APA CORP	21,000	28.960	608,160.000	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	8,650	27.800	240,470.000	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	24,500	71.520	1,752,240.000	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,400	35.510	440,324.000	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,800	305.840	4,220,592.000	
	SEMPRA ENERGY	36,200	77.180	2,793,916.000	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,900	49.590	590,121.000	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	108,800	22.100	2,404,480.000	
	UIPATH INC - CLASS A	25,300	11.750	297,275.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,450	91.850	1,051,682.500	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,700	244.200	2,612,940.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	52,100	193.300	10,070,930.000	
	SALESFORCE.COM INC	55,466	234.860	13,026,744.760	
	WESTROCK CO	14,700	54.010	793,947.000	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	22,809	113.880	2,597,488.920	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,034	71.080	2,774,536.720	
	TERADYNE INC	8,800	139.620	1,228,656.000	
	UNION PACIFIC CORP	34,880	227.620	7,939,385.600	
	MARATHON OIL CORP	33,000	27.890	920,370.000	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,088	175.260	3,695,882.880	
	RTX CORP	79,879	107.900	8,618,944.100	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	41,700	135.630	5,655,771.000	
	IQVIA HOLDINGS INC	10,404	217.180	2,259,540.720	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AMEREN CORPORATION	15,300	73.710	1,127,763.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	52,766	505.490	26,672,685.340	
	APPLOVIN CORP CLASS A	10,300	81.640	840,892.000	
	TOAST INC CLASS A	20,100	22.430	450,843.000	
	VERISIGN INC	5,200	178.790	929,708.000	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	41,800	11.220	468,996.000	
	ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	30,500	20.780	633,790.000	
	VALERO ENERGY CORP	18,942	155.380	2,943,207.960	
	ULTA BEAUTY INC	2,800	389.410	1,090,348.000	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	14,888	51.040	759,883.520	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,430	184.640	633,315.200	
	ELEVANCE HEALTH INC	13,300	540.430	7,187,719.000	
	WALT DISNEY CO/THE	104,862	103.330	10,835,390.460	
	WELLS FARGO & CO	201,822	58.700	11,846,951.400	
	WASTE MANAGEMENT INC	23,000	203.630	4,683,490.000	
	WILLIAMS COS INC	69,700	41.320	2,880,004.000	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,200	269.710	1,672,202.000	
	WALMART INC	253,300	66.600	16,869,780.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,800	113.440	1,338,592.000	
	WYNN RESORTS LTD	5,700	92.920	529,644.000	
	GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	127,300	3.660	465,918.000	
	CELSIUS HOLDINGS INC	8,700	71.420	621,354.000	
	WABTEC CORP	10,111	164.790	1,666,191.690	
	TJX COMPANIES INC	64,800	105.870	6,860,376.000	
	WATERS CORP	3,400	307.260	1,044,684.000	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,000	302.770	908,310.000	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	42,000	16.110	676,620.000	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,863	255.180	1,496,120.340	
	WILLIAMS-SONOMA INC	3,500	282.750	989,625.000	
	WESTERN DIGITAL CORP	18,700	73.940	1,382,678.000	
	WEC ENERGY GROUP INC	18,100	82.140	1,486,734.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	28,500	74.340	2,118,690.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	90,450	272.420	24,640,389.000	
	PPL CORP	42,200	29.320	1,237,304.000	
	CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	18,024	203.140	3,661,395.360	
	PULTEGROUP INC	12,050	112.890	1,360,324.500	
	WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	132,453	8.240	1,091,412.720	
	PPG INDUSTRIES INC	13,500	131.680	1,777,680.000	
	NORTHERN TRUST CORP	11,700	83.430	976,131.000	
	FERGUSON PLC	11,600	196.960	2,284,736.000	
	NVIDIA CORP	142,980	1,164.370	166,481,622.600	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,813	154.160	3,516,852.080	
	DRAFTKINGS INC CLASS A	24,500	35.520	870,240.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,700	205.520	349,384.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	16,400	56.740	930,536.000	
	NETFLIX INC	24,790	631.620	15,657,859.800	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,800	569.670	12,418,806.000	
	NRG ENERGY INC	12,550	77.830	976,766.500	
	TEXTRON INC	10,900	87.010	948,409.000	
	NEWS CORP - CLASS A	21,187	27.230	576,922.010	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,150	584.480	672,152.000	
	OMNICOM GROUP	11,200	91.220	1,021,664.000	
	JACOBS SOLUTIONS INC	7,220	138.620	1,000,836.400	
	ORACLE CORP	94,233	120.070	11,314,556.310	
	MASTERCARD INC - A	47,600	444.770	21,171,052.000	
	ONEOK INC	33,400	79.040	2,639,936.000	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	6,200	543.400	3,369,080.000	
	U HAUL NON VOTING SERIES N	5,600	61.590	344,904.000	
	ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	10,400	135.190	1,405,976.000	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	6,400	88.560	566,784.000	
	HF SINCLAIR CORP	9,400	53.780	505,532.000	
	OVINTIV INC	15,500	47.510	736,405.000	
	YUM! BRANDS INC	16,100	141.540	2,278,794.000	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,400	165.960	1,560,024.000	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	10,500	52.950	555,975.000	
	BANK OF AMERICA CORP	405,801	39.680	16,102,183.680	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,800	395.400	1,107,120.000	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,900	79.090	862,081.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	32,900	237.250	7,805,525.000	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	24,835	77.520	1,925,209.200	
	LINDE PLC	27,546	431.140	11,876,182.440	
	ANALOG DEVICES INC	28,391	230.630	6,547,816.330	
	ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	19,800	20.370	403,326.000	
	MONDAYCOM LTD	2,300	213.880	491,924.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	92,427	159.990	14,787,395.730	
	COREBRIDGE FINANCIAL INC	14,200	28.860	409,812.000	
	LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	11,400	74.520	849,528.000	
	CONFLUENT INC CLASS A	11,700	25.700	300,690.000	
	KENVUE INC	98,500	19.150	1,886,275.000	
	GLOBAL E ONLINE LTD	6,100	30.215	184,311.500	
	VERALTO CORP	14,216	100.440	1,427,855.040	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,972	76.650	2,987,203.800	
	BUNGE GLOBAL LTD	8,100	106.800	865,080.000	
	VERTIV HOLDINGS CLASS A	20,800	92.090	1,915,472.000	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,200	90.680	834,256.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,000	155.160	2,172,240.000	
	AVERY DENNISON CORP	4,630	227.470	1,053,186.100	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,500	65.350	1,862,475.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	32,700	106.870	3,494,649.000	
	AON PLC-CLASS A	11,400	284.500	3,243,300.000	
	AMGEN INC	30,700	307.370	9,436,259.000	
	SAMSARA INC CLASS A	11,700	33.450	391,365.000	
	EATON CORP PLC	22,936	316.170	7,251,675.120	
	COOPER INC	11,400	94.560	1,077,984.000	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,500	250.340	2,378,230.000	
	APPLIED MATERIALS INC	47,500	212.220	10,080,450.000	
	CME GROUP INC	20,600	203.780	4,197,868.000	
	ECOLAB INC	14,800	235.520	3,485,696.000	
	EQUIFAX INC	7,100	234.620	1,665,802.000	
	GILEAD SCIENCES INC	71,300	64.160	4,574,608.000	
	KEURIG DR PEPPER INC	61,900	34.820	2,155,358.000	
	HORMEL FOODS CORP	17,300	30.740	531,802.000	
	CHORD ENERGY CORP	3,600	173.030	622,908.000	
	STATE STREET CORP	17,213	74.650	1,284,950.450	
	SOLVENTUM CORP	8,472	55.610	471,127.920	
	GE VERNOVA	15,726	163.040	2,563,967.040	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	86,240	71.990	6,208,417.600	
	CRH PUBLIC LIMITED PLC	41,600	76.920	3,199,872.000	
	LABCORP HOLDINGS	4,900	196.680	963,732.000	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	29,100	33.300	969,030.000	
	CAMPBELL SOUP CO	11,100	44.180	490,398.000	
	CROWN HOLDINGS INC	6,980	82.370	574,942.600	
	CARDINAL HEALTH INC	13,900	98.320	1,366,648.000	
	FEDEX CORP	13,400	245.950	3,295,730.000	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,854	134.480	2,938,925.920	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	14,613	96.310	1,407,378.030	
	INTEL CORP	243,400	30.030	7,309,302.000	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	21,300	31.010	660,513.000	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	17,050	100.580	1,714,889.000	
	ILLINOIS TOOL WORKS	17,100	240.670	4,115,457.000	
	ILLUMINA INC	9,100	102.060	928,746.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	20,300	406.610	8,254,183.000	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,550	151.030	838,216.500	
	SNAP-ON INC	3,100	267.020	827,762.000	
	CARMAX INC	9,000	70.980	638,820.000	
	DUKE ENERGY CORP	44,128	104.600	4,615,788.800	
	TARGET CORP	26,400	150.550	3,974,520.000	
	DOVER CORP	7,900	179.440	1,417,576.000	
	WW GRAINGER INC	2,600	887.120	2,306,512.000	
	JABIL INC	7,100	114.210	810,891.000	
	CINTAS CORP	5,300	682.480	3,617,144.000	
	CONAGRA BRANDS INC	27,400	30.000	822,000.000	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,300	86.230	715,709.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CLOROX COMPANY	7,100	132.450	940,395.000	
	ENTERGY CORP	12,200	111.590	1,361,398.000	
	MICROSOFT CORP	403,400	416.070	167,842,638.000	
	INCYTE CORP	11,000	58.570	644,270.000	
	CVS HEALTH CORP	71,869	60.260	4,330,825.940	
	MEDTRONIC PLC	75,898	83.270	6,320,026.460	
	MICRON TECHNOLOGY INC	63,300	126.640	8,016,312.000	
	BLACKROCK INC	8,600	785.290	6,753,494.000	
	CENTERPOINT ENERGY INC	36,200	30.840	1,116,408.000	
	KELLOGG CO	15,700	60.480	949,536.000	
	KEYCORP	53,000	13.870	735,110.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	76,911	68.090	5,236,869.990	
	CHUBB LTD	23,199	264.810	6,143,327.190	
	ALLSTATE CORP	15,100	163.420	2,467,642.000	
	EBAY INC	29,600	53.750	1,591,000.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	56,950	63.330	3,606,643.500	
	EASTMAN CHEMICAL CO	6,800	97.500	663,000.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	13,400	123.540	1,655,436.000	
	TRIMBLE INC	13,800	54.000	745,200.000	
	LENNAR CORP-A	14,000	157.710	2,207,940.000	
	PROGRESSIVE CORP	33,500	211.970	7,100,995.000	
	PACCAR INC	29,955	105.940	3,173,432.700	
	BIOGEN INC	8,400	234.130	1,966,692.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	4,800	491.060	2,357,088.000	
	STARBUCKS CORP	64,700	82.790	5,356,513.000	
	PTC INC	6,900	171.470	1,183,143.000	
	EVERSOURCE ENERGY	20,000	60.820	1,216,400.000	
	INTUIT INC	16,080	572.060	9,198,724.800	
	BEST BUY CO INC	11,150	87.850	979,527.500	
	BALL CORP	18,004	69.100	1,244,076.400	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	84,097	75.920	6,384,644.240	
	ELECTRONIC ARTS INC	14,600	136.500	1,992,900.000	
	VULCAN MATERIALS CO	7,600	250.460	1,903,496.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,800	474.950	7,029,260.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	30,625	12.240	374,850.000	
	CARNIVAL CORP	57,800	16.940	979,132.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	28,100	16.500	463,650.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	226,390	39.560	8,955,988.400	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	38.540	369,984.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	66,800	3.430	229,124.000	
アメリカ・ドル 小計				2,600,690,388.020 (403,887,217,259)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	357,057	27.230	9,722,662.110	
	HALEON PLC	382,460	3.227	1,234,198.420	
	WISE PLC CLASS A	33,541	8.125	272,520.620	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BP PLC	938,105	4.629	4,342,488.040	
	UNILEVER PLC	139,961	43.670	6,112,096.870	
	BARCLAYS PLC	838,552	2.150	1,802,886.800	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	469,969	4.480	2,105,461.120	
	PRUDENTIAL PLC	153,543	7.498	1,151,265.410	
	NATWEST GROUP PLC	369,287	3.135	1,157,714.740	
	BAE SYSTEMS PLC	168,965	13.850	2,340,165.250	
	AVIVA PLC	149,480	4.752	710,328.960	
	GSK	231,552	16.150	3,739,564.800	
	INFORMA PLC	74,976	8.486	636,246.330	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	72,520	6.292	456,295.840	
	AUTO TRADER GROUP PLC	50,437	8.258	416,508.740	
	DCC PLC	5,390	57.700	311,003.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	9,946	149.000	1,481,954.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,117	88.050	362,501.850	
	HALMA PLC	21,214	22.900	485,800.600	
	ENTAIN PLC	35,711	7.140	254,976.540	
	JD SPORTS FASHION PLC	138,098	1.323	182,772.700	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	39,403	4.936	194,493.200	
	M&G PLC	126,560	2.007	254,005.920	
	ENDEAVOUR MINING PLC	10,449	16.640	173,871.360	
	RELX PLC	104,742	34.870	3,652,353.540	
	DIAGEO PLC	124,220	26.395	3,278,786.900	
	RIO TINTO PLC	62,972	53.520	3,370,261.440	
	STANDARD CHARTERED PLC	123,447	7.352	907,582.340	
	TESCO PLC	393,005	3.120	1,226,175.600	
	SMITH & NEPHEW PLC	48,799	9.952	485,647.640	
	GLENCORE PLC	579,145	4.684	2,712,715.180	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,953	10.620	201,280.860	
	SMITHS GROUP PLC	19,452	17.320	336,908.640	
	PEARSON PLC	33,165	9.416	312,281.640	
	SAINSBURY (J) PLC	93,101	2.786	259,379.380	
	NEXT PLC	6,612	94.160	622,585.920	
	TAYLOR WIMPEY PLC	198,070	1.498	296,708.860	
	WHITBREAD PLC	10,175	29.920	304,436.000	
	BUNZL PLC	18,847	29.500	555,986.500	
	VODAFONE GROUP PLC	1,285,319	0.768	987,639.110	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,238	44.040	318,761.520	
	KINGFISHER PLC	102,657	2.704	277,584.520	
	WPP PLC	60,259	8.120	489,303.080	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	38,195	10.220	390,352.900	
	SEVERN TRENT PLC	15,087	24.060	362,993.220	
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,949	4.240	597,623.760	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39,399	45.070	1,775,712.930	
	SCHRODERS PLC	42,839	3.938	168,699.980	
	SSE PLC	61,058	17.935	1,095,075.230	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	54,534	5.068	276,378.310	
	ASTRAZENECA PLC	86,577	124.040	10,739,011.080	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	333,958	2.508	837,566.660	
	3I GROUP PLC	54,343	29.420	1,598,771.060	
	ASHTEAD GROUP PLC	24,447	54.600	1,334,806.200	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,580	10.250	569,695.000	
	NATIONAL GRID PLC	287,707	9.118	2,623,312.420	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,535,416	0.556	1,967,105.460	
	IMPERIAL BRANDS PLC	45,589	19.530	890,353.170	
	CENTRICA PLC	294,667	1.422	419,163.800	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	5,933	52.550	311,779.150	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	112,083	24.220	2,714,650.260	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,580	25.660	476,762.800	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,053,083	6.902	7,268,378.860	
	ANGLO AMERICAN PLC	70,947	24.035	1,705,211.140	
	MONDI PLC	24,732	15.460	382,356.720	
	COMPASS GROUP PLC	95,031	21.800	2,071,675.800	
	PERSIMMON PLC	17,888	14.845	265,547.360	
	BT GROUP PLC	362,019	1.333	482,752.330	
	COCA-COLA HBC AG-DI	12,288	26.900	330,547.200	
	BURBERRY GROUP PLC	20,044	10.370	207,856.280	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,005	79.540	716,257.700	
	INTERTEK GROUP PLC	9,003	48.780	439,166.340	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,595	92.820	2,375,727.900	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	9,366	19.840	185,821.440	
	ADMIRAL GROUP PLC	14,613	26.990	394,404.870	
	ANTOFAGASTA PLC	21,985	21.350	469,379.750	
	EXPERIAN PLC	51,271	37.000	1,897,027.000	
イギリス・ポンド 小計				108,840,085.970 (21,589,519,453)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	73,333	19.700	1,444,660.100	
	AZRIELI GROUP LTD	2,516	233.700	587,989.200	
	ICL GROUP LTD	44,023	17.280	760,717.440	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,518	713.000	1,082,334.000	
	BANK HAPOALIM BM	75,312	34.490	2,597,510.880	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,278	31.630	2,855,493.140	
	NICE LTD	3,754	654.000	2,455,116.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,181	138.600	1,272,486.600	
イスラエル・シュケル 小計				13,056,307.360 (549,889,886)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	115,728	4.950	572,853.600	
	TELSTRA GROUP LTD	210,415	3.480	732,244.200	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	160,421	28.590	4,586,436.390	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	10,800	39.000	421,200.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	143,205	3.750	537,018.750	
	BHP GROUP LTD	270,550	44.280	11,979,954.000	
	SOUTH32 LTD	241,523	3.960	956,431.080	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	101,302	27.430	2,778,713.860	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,350	24.320	2,197,312.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	165,328	34.560	5,713,735.680	
	WESTPAC BANKING CORP	185,049	26.740	4,948,210.260	
	SANTOS LTD	173,184	7.510	1,300,611.840	
	RIO TINTO LTD	19,757	127.470	2,518,424.790	
	ORIGIN ENERGY LTD	91,846	10.210	937,747.660	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,381	3.690	344,575.890	
	PILBARA MINERALS LTD	153,072	3.750	574,020.000	
	XERO LTD	7,773	131.800	1,024,481.400	
	PRO MEDICUS LTD	3,500	117.480	411,180.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,201	31.180	380,427.180	
	COLES GROUP LTD	71,432	16.590	1,185,056.880	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,876	95.870	850,942.120	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	61,249	14.390	881,373.110	
	REECE LTD	11,443	25.350	290,080.050	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	82,315	4.950	407,459.250	
	SEEK LTD	18,528	22.680	420,215.040	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	43,476	11.390	495,191.640	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	89,275	122.460	10,932,616.500	
	AMPOL LTD	12,749	34.510	439,967.990	
	ORICA LTD	26,028	18.470	480,737.160	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	80,200	18.010	1,444,402.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,172	31.490	2,052,266.280	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	6.170	273,528.440	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	22,831	46.320	1,057,531.920	
	MACQUARIE GROUP LTD	19,377	192.510	3,730,266.270	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,048	44.930	1,350,056.640	
	CSL LTD	25,761	282.000	7,264,602.000	
	WESFARMERS LTD	60,570	65.410	3,961,883.700	
	COCHLEAR LTD	3,501	320.310	1,121,405.310	
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,673	21.640	512,283.720	
	SUNCORP GROUP LTD	67,897	15.940	1,082,278.180	
	ASX LTD	10,368	62.890	652,043.520	
	COMPUTERSHARE LTD	28,011	26.480	741,731.280	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	124,907	6.380	796,906.660	
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,371	24.040	585,878.840	
	BRAMBLES LTD	74,290	14.200	1,054,918.000	
	CARSALES.COM LTD	19,237	34.530	664,253.610	
	MINERAL RESOURCES LTD	9,385	70.820	664,645.700	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,541	48.470	462,452.270	
	REA GROUP LTD	2,750	183.220	503,855.000	
オーストラリア・ドル 小計				89,276,407.660	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
				(9,221,360,148)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	40,600	79.660	3,234,196.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	17,681	53.460	945,226.260	
	IMPERIAL OIL LTD	10,000	89.090	890,900.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,100	3,793.420	4,172,762.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	15,887	95.700	1,520,385.900	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,900	72.200	1,725,580.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,450	228.360	2,158,002.000	
	BCE INC	3,730	47.110	175,720.300	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,200	162.580	1,658,316.000	
	SUNCOR ENERGY INC	67,830	51.470	3,491,210.100	
	METRO INC/CN	12,000	74.850	898,200.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	17,900	118.170	2,115,243.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	64,500	64.570	4,164,765.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,500	67.630	3,347,685.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	93,200	76.100	7,092,520.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,900	41.560	619,244.000	
	MEG ENERGY CORP	14,200	27.830	395,186.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	74,350	146.950	10,925,732.500	
	TOURMALINE OIL CORP	17,600	65.280	1,148,928.000	
	TC ENERGY CORP	54,750	52.790	2,890,252.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,529	50.190	1,532,250.510	
	BARRICK GOLD CORP	92,600	22.540	2,087,204.000	
	CAE INC	16,900	25.290	427,401.000	
	THOMSON REUTERS CORP	8,341	232.960	1,943,119.360	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	31.880	226,348.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,000	105.350	316,050.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,750	70.280	544,670.000	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	20,600	24.460	503,876.000	
	HYDRO ONE LTD	17,000	40.300	685,100.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,060	160.910	1,296,934.600	
	STANTEC INC	6,100	111.320	679,052.000	
	NORTHLAND POWER INC	13,200	23.890	315,348.000	
	WSP GLOBAL INC	6,600	206.480	1,362,768.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,400	119.120	524,128.000	
	PARKLAND CORP	7,100	39.110	277,681.000	
	QUEBECOR INC -CL B	7,700	29.060	223,762.000	
	EMERA INC	15,100	47.680	719,968.000	
	TFI INTERNATIONAL INC	4,300	183.970	791,071.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,800	31.310	212,908.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	18,900	54.780	1,035,342.000	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	1,900	84.200	159,980.000	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,700	17.890	585,003.000	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	26,317	88.910	2,339,844.470	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AIR CANADA	8,900	18.360	163,404.000	
	KINROSS GOLD CORP	63,400	10.480	664,432.000	
	BANK OF MONTREAL	38,600	119.760	4,622,736.000	
	POWER CORP OF CANADA	29,900	39.510	1,181,349.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	63,700	82.970	5,285,189.000	
	NUTRIEN LTD	26,119	78.230	2,043,289.370	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	7,000	43.230	302,610.000	
	CAMECO CORP	22,900	73.310	1,678,799.000	
	FIRSTSERVICE CORP	2,200	205.200	451,440.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,600	50.650	587,540.000	
	TELUS CORP	10,800	22.810	246,348.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,200	66.020	1,597,684.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,800	140.000	392,000.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	56,600	98.070	5,550,762.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,200	1,532.670	1,839,204.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	14,400	60.910	877,104.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,237	195.480	632,768.760	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	19,300	27.650	533,645.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,600	123.540	568,284.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	30,700	67.810	2,081,767.000	
	ENBRIDGE INC	112,100	49.270	5,523,167.000	
	BROOKFIELD CORP	71,525	58.270	4,167,761.750	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	94,900	35.320	3,351,868.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	49,220	105.630	5,199,108.600	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,200	88.870	462,124.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,900	50.800	401,320.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	28,750	171.510	4,930,912.500	
	CGI INC - CLASS A	10,900	135.860	1,480,874.000	
	ONEX CORPORATION	3,400	98.140	333,676.000	
	IGM FINANCIAL INC	4,200	36.450	153,090.000	
	TMX GROUP LTD	14,700	37.000	543,900.000	
	OPEN TEXT CORP	14,400	38.050	547,920.000	
	SAPUTO INC	13,500	28.010	378,135.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	36,600	16.210	593,286.000	
	FORTIS INC	26,100	55.020	1,436,022.000	
	RB GLOBAL INC	9,700	98.980	960,106.000	
	LUNDIN MINING CORP	34,800	15.000	522,000.000	
	CENOVUS ENERGY INC	73,600	26.250	1,932,000.000	
	DOLLARAMA INC	14,700	126.960	1,866,312.000	
	ALTAGAS LTD	15,700	31.270	490,939.000	
	KEYERA CORP	12,200	35.870	437,614.000	
	ARC RESOURCES LTD	31,500	24.720	778,680.000	
カナダ・ドル 小計				140,151,034.480 (15,912,748,456)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	157,500	2.660	418,950.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	76,600	30.810	2,360,046.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	120,640	35.830	4,322,531.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	90,175	6.800	613,190.000	
	KEPPEL CORP LTD	88,200	6.620	583,884.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	205,000	14.390	2,949,950.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	366,100	0.895	327,659.500	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	499,850	2.500	1,249,625.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	94,500	4.040	381,780.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	54,100	5.070	274,287.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	51,900	9.600	498,240.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	116,300	3.110	361,693.000	
シンガポール・ドル 小計				14,341,835.700 (1,654,187,329)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	21,852	31.100	679,597.200	
	AVOLTA AG	4,854	37.260	180,860.040	
	UBS GROUP AG-REG	175,733	27.820	4,888,892.060	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,711	259.600	444,175.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	355	731.500	259,682.500	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,058	34.140	309,240.120	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	37,585	234.200	8,802,407.000	
	SIKA AG-REG	8,195	269.200	2,206,094.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	107,200.000	643,200.000	
	ABB LTD-REG	85,447	49.130	4,198,011.110	
	SWISS RE AG	16,121	111.550	1,798,297.550	
	NESTLE SA-REG	142,676	97.600	13,925,177.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,173	1,194.000	1,400,562.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,208	234.600	517,996.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,962	53.960	591,509.520	
	SGS SA-REG	7,978	81.920	653,557.760	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,291	229.000	295,639.000	
	TEMENOS AG - REG	3,232	57.100	184,547.200	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,028	120.000	243,360.000	
	VAT GROUP AG	1,398	473.700	662,232.600	
	BKW AG	1,174	142.900	167,764.600	
	ALCON INC	26,679	79.860	2,130,584.940	
	SIG GROUP N AG	15,864	17.620	279,523.680	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,500	193.900	290,850.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,779	470.300	3,658,463.700	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,416	154.100	372,305.600	
	CLARIANT AG-REG	10,962	13.730	150,508.260	
	NOVARTIS AG-REG	106,153	92.730	9,843,567.690	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	181	1,546.000	279,826.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,766	77.000	135,982.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	28,743	143.750	4,131,806.250	
	SWISSCOM AG-REG	1,341	502.500	673,852.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,544	94.650	146,139.600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GEBERIT AG-REG	1,834	548.400	1,005,765.600	
	GIVAUDAN-REG	478	4,263.000	2,037,714.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,980	115.600	691,288.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,729	285.800	779,948.200	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,537	87.100	743,572.700	
	LONZA GROUP AG-REG	3,956	492.300	1,947,538.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,686	37.650	101,127.900	
	HOLCIM LTD	27,894	78.140	2,179,637.160	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,530	625.400	956,862.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,815	257.600	725,144.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,180	84.900	354,882.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	49	10,500.000	514,500.000	
スイス・フラン 小計				77,184,194.840 (13,457,836,213)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	13,255	281.200	3,727,306.000	
	VOLVO CAR CLASS B	45,114	34.475	1,555,305.150	
	ERICSSON LM-B SHS	167,894	65.500	10,997,057.000	
	VOLVO AB-B SHS	96,165	278.600	26,791,569.000	
	SKF AB-B SHARES	20,605	223.300	4,601,096.500	
	TELE2 AB-B SHS	32,433	103.950	3,371,410.350	
	GETINGE AB-B SHS	13,892	186.550	2,591,552.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	96,073	147.650	14,185,178.450	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	88,268	98.400	8,685,571.200	
	SWEDBANK AB - A SHARES	51,431	214.400	11,026,806.400	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,789	183.650	6,388,999.850	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	36,726	158.200	5,810,053.200	
	SKANSKA AB-B SHS	20,570	184.650	3,798,250.500	
	SANDVIK AB	64,508	222.700	14,365,931.600	
	INVESTOR AB-B SHS	104,786	284.050	29,764,463.300	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	162,538	200.100	32,523,853.800	
	VOLVO AB-A SHS	12,071	284.000	3,428,164.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,577	435.800	1,994,656.600	
	SECURITAS AB-B SHS	29,755	108.200	3,219,491.000	
	TELIA CO AB	142,762	27.340	3,903,113.080	
	ALFA LAVAL AB	17,552	476.500	8,363,528.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	94,432	172.450	16,284,798.400	
	ASSA ABLOY AB-B	60,618	304.400	18,452,119.200	
	TRELLEBORG AB-B SHS	13,000	410.200	5,332,600.000	
	SAAB AB-B	19,388	250.300	4,852,816.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,455	367.200	2,737,476.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	40,092	73.640	2,952,374.880	
	INDUTRADE AB	16,498	267.400	4,411,565.200	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	11,825	284.400	3,363,030.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,551	535.500	2,437,060.500	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,943	288.600	2,580,949.800	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	LIFCO AB-B SHS	14,119	278.600	3,933,553.400	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	91,742	52.280	4,796,271.760	
	BEIJER REF AB	21,818	160.500	3,501,789.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,920	278.500	10,282,220.000	
	BOLIDEN AB	16,514	353.100	5,831,093.400	
	EPIROC AB-A	39,868	216.000	8,611,488.000	
	EPIROC AB-B	23,618	196.400	4,638,575.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,195	85.420	1,810,476.900	
	EQT AB	22,637	316.800	7,171,401.600	
	EVOLUTION AB	11,164	1,126.500	12,576,246.000	
	HEXAGON AB-B SHS	125,680	114.950	14,446,916.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,520	364.800	3,472,896.000	
スウェーデン・クローナ 小計				345,571,075.220 (5,149,009,021)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	197,487	936.200	184,887,329.400	
	DANSKE BANK A/S	41,790	205.900	8,604,561.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	173	11,670.000	2,018,910.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	61,167	191.750	11,728,772.250	
	CARLSBERG AS-B	5,738	940.800	5,398,310.400	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,618	419.600	9,490,512.800	
	COLOPLAST-B	7,677	818.200	6,281,321.400	
	DSV PANALPINA A/S	10,386	1,053.000	10,936,458.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	526	2,828.000	1,487,528.000	
	DEMANT A/S	6,039	326.000	1,968,714.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	252	11,985.000	3,020,220.000	
	TRYG A/S	21,099	142.700	3,010,827.300	
	PANDORA A/S	5,012	1,098.000	5,503,176.000	
	GENMAB A/S	4,017	1,937.500	7,782,937.500	
	ORSTED A/S	11,414	415.000	4,736,810.000	
デンマーク・クローネ 小計				266,856,388.050 (6,044,297,189)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	78,352	6.550	513,205.600	
	MERCURY NZ LTD	42,143	6.610	278,565.230	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	109,847	4.050	444,880.350	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	80,630	7.580	611,175.400	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	35,319	30.100	1,063,101.900	
ニュージーランド・ドル 小計				2,910,928.480 (279,420,025)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	51,370	203.300	10,443,521.000	
	NORSK HYDRO ASA	80,355	69.560	5,589,493.800	
	ORKLA ASA	42,457	85.400	3,625,827.800	
	TELENOR ASA	38,133	126.400	4,820,011.200	
	EQUINOR ASA	54,509	292.100	15,922,078.900	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,008	325.400	3,256,603.200	
	MOWI ASA	28,190	186.400	5,254,616.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,098	183.200	2,216,353.600	
	AKER BP ASA	19,134	257.300	4,923,178.200	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,315	881.000	4,682,515.000	
	SALMAR ASA	3,973	625.000	2,483,125.000	
ノルウェー・クローネ 小計				63,217,323.700 (929,926,831)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	45,627	28.440	1,297,631.880	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,629	38.860	1,151,382.940	
	EXOR NV	5,534	99.650	551,463.100	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	6,325	76.320	482,724.000	
	DSM FIRMENICH AG	10,288	101.200	1,041,145.600	
	FERROVIAL	28,747	36.500	1,049,265.500	
	LOTUS BAKERIES NV	21	9,800.000	205,800.000	
	SYENSQO SA	3,987	92.850	370,192.950	
	BAYER AG-REG	54,464	28.335	1,543,237.440	
	EVONIK INDUSTRIES AG	12,581	19.725	248,160.220	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	104,098	15.026	1,564,176.540	
	COMMERZBANK AG	58,418	14.950	873,349.100	
	VOLKSWAGEN AG	1,588	129.000	204,852.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	11,475	114.100	1,309,297.500	
	SIEMENS AG-REG	42,118	174.280	7,340,325.040	
	E.ON SE	124,380	12.560	1,562,212.800	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,626	92.040	1,622,297.040	
	GEA GROUP AG	8,802	37.480	329,898.960	
	CONTINENTAL AG	6,139	62.340	382,705.260	
	BASF SE	49,436	47.355	2,341,041.780	
	ALLIANZ SE-REG	21,738	262.000	5,695,356.000	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	9,408	83.160	782,369.280	
	RHEINMETALL AG	2,442	517.000	1,262,514.000	
	RWE AG	35,057	35.570	1,246,977.490	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,293	6.328	210,678.100	
	BRENNTAG SE	7,127	64.460	459,406.420	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	23,436	29.190	684,096.840	
	SAP SE	57,883	168.600	9,759,073.800	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,530	450.800	3,394,524.000	
	ZALANDO SE	12,435	24.370	303,040.950	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	7,596	94.300	716,302.800	
	COVESTRO AG	10,449	48.910	511,060.590	
	RATIONAL AG	268	808.000	216,544.000	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	77.900	296,020.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,407	236.100	332,192.700	
	TALANX AG	3,571	74.050	264,432.550	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	8,487	50.180	425,877.660	
	DELIVERY HERO SE	10,712	29.070	311,397.840	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,094	84.000	175,896.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BECHTLE AG	4,423	45.100	199,477.300	
	NEMETSCHEK SE	3,219	86.600	278,765.400	
	SCOUT24 AG	4,119	70.150	288,947.850	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	15,646	54.220	848,326.120	
	KNORR-BREMSE AG	3,902	70.750	276,066.500	
	SIEMENS ENERGY AG	33,594	23.910	803,232.540	
	BEIERSDORF AG	5,614	143.900	807,854.600	
	MERCK KGAA	7,141	166.350	1,187,905.350	
	ADIDAS AG	9,001	232.400	2,091,832.400	
	PUMA SE	5,826	47.590	277,259.340	
	HENKEL AG & CO KGAA	5,821	73.600	428,425.600	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	179,577	22.250	3,995,588.250	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,413	39.140	446,704.820	
	MERCEDES-BENZ GROUP N AG	44,494	65.530	2,915,691.820	
	QIAGEN N.V.	12,275	40.230	493,823.250	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	72,338	36.710	2,655,527.980	
	HANNOVER RUECK SE	3,339	229.400	765,966.600	
	DHL GROUP	54,938	38.570	2,118,958.660	
	DEUTSCHE BOERSE AG	10,505	186.000	1,953,930.000	
	MTU AERO ENGINES AG	2,991	228.000	681,948.000	
	SYMRISE AG	7,331	110.700	811,541.700	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,273	87.150	285,241.950	
	VONOVIA SE	40,677	29.390	1,195,497.030	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,986	83.240	331,794.640	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	44,527	24.380	1,085,568.260	
	NN GROUP NV	14,972	42.430	635,261.960	
	ARCELORMITTAL	27,534	23.820	655,859.880	
	HEINEKEN NV	15,968	91.120	1,455,004.160	
	AEGON LTD	77,964	5.864	457,180.890	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	52,248	28.600	1,494,292.800	
	AKZO NOBEL N.V.	9,476	63.800	604,568.800	
	WOLTERS KLUWER	13,747	146.950	2,020,121.650	
	ING GROEP NV	182,969	16.092	2,944,337.140	
	KONINKLIJKE KPN NV	221,749	3.474	770,356.020	
	ASML HOLDING NV	22,151	872.900	19,335,607.900	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	25,561	15.545	397,345.740	
	IMCD NV	3,159	139.400	440,364.600	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,239	133.200	564,634.800	
	ASR NEDERLAND NV	8,762	44.390	388,945.180	
	ADYEN NV	1,167	1,184.000	1,381,728.000	
	PROSUS NV	78,562	33.850	2,659,323.700	
	JDE PEET'S NV	6,885	20.820	143,345.700	
	INPOST SA	12,100	16.240	196,504.000	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,622	647.000	1,696,434.000	
	RANDSTAD NV	6,064	48.690	295,256.160	
	HEINEKEN HOLDING NV	7,171	74.250	532,446.750	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	OCI NV	5,520	25.150	138,828.000	
	TOTALENERGIES SE	118,894	64.330	7,648,451.020	
	MICHELIN (CGDE)	37,679	37.040	1,395,630.160	
	AIR LIQUIDE SA	29,071	182.260	5,298,480.460	
	KERING	4,098	322.300	1,320,785.400	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,127	224.400	6,760,498.800	
	BOUYGUES SA	10,549	35.780	377,443.220	
	BNP PARIBAS	57,265	66.830	3,827,019.950	
	THALES SA	5,279	166.900	881,065.100	
	DANONE	35,682	59.640	2,128,074.480	
	CARREFOUR SA	31,445	15.085	474,347.820	
	VIVENDI	40,308	10.125	408,118.500	
	L'OREAL	13,324	452.100	6,023,780.400	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	25,279	80.360	2,031,420.440	
	LEGRAND SA	14,680	97.500	1,431,300.000	
	PERNOD RICARD SA	11,383	138.650	1,578,252.950	
	EURAZEO SE	2,589	79.800	206,602.200	
	REXEL SA	12,800	27.130	347,264.000	
	SOCIETE GENERALE SA	40,008	26.425	1,057,211.400	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	15,330	735.000	11,267,550.000	
	ACCOR SA	10,771	39.930	430,086.030	
	CAPGEMINI SE	8,644	188.950	1,633,283.800	
	PUBLICIS GROUPE	12,692	102.900	1,306,006.800	
	BUREAU VERITAS SA	17,179	27.740	476,545.460	
	EIFFAGE	4,126	102.400	422,502.400	
	SODEXO SA	4,756	87.650	416,863.400	
	IPSEN	2,131	121.300	258,490.300	
	AMUNDI SA	3,414	66.850	228,225.900	
	TELEPERFORMANCE	3,077	105.000	323,085.000	
	EURONEXT NV	4,471	89.850	401,719.350	
	EUROFINS SCIENTIFIC	7,253	55.560	402,976.680	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,570	179.300	281,501.000	
	SEB SA	1,302	111.000	144,522.000	
	ESSILORLUXOTTICA	16,344	205.300	3,355,423.200	
	DASSAULT AVIATION SA	1,089	193.900	211,157.100	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,498	33.280	182,973.440	
	AXA SA	100,643	32.760	3,297,064.680	
	EDENRED	13,805	43.870	605,625.350	
	RENAULT SA	10,620	52.480	557,337.600	
	HERMES INTERNATIONAL	1,801	2,163.000	3,895,563.000	
	STMICROELECTRONICS NV	37,507	39.050	1,464,648.350	
	REMY COINTREAU	1,209	85.500	103,369.500	
	DASSAULT SYSTEMES SE	37,089	37.100	1,376,001.900	
	ORANGE	103,206	10.560	1,089,855.360	
	ALSTOM	16,033	17.300	277,370.900	
	SANOFI	63,036	90.270	5,690,259.720	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	VINCI SA	27,790	113.500	3,154,165.000	
	AIRBUS SE	32,940	152.600	5,026,644.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,213	30.690	1,172,756.970	
	CREDIT AGRICOLE SA	58,685	14.720	863,843.200	
	BIOMERIEUX	2,352	96.050	225,909.600	
	ENGIE	101,195	15.490	1,567,510.550	
	SAFRAN SA	18,958	211.300	4,005,825.400	
	ARKEMA	3,234	90.400	292,353.600	
	ADP	1,912	129.800	248,177.600	
	GETLINK SE	18,646	16.500	307,659.000	
	BOLLORE	38,368	6.260	240,183.680	
	UCB SA	6,990	127.750	892,972.500	
	KBC GROUP NV	13,847	66.780	924,702.660	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,884	69.700	340,414.800	
	UMICORE	11,664	17.370	202,603.680	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	49,950	57.100	2,852,145.000	
	AGEAS	8,892	45.820	407,431.440	
	D'IETEREN GROUP	1,222	202.400	247,332.800	
	ELIA GROUP SA/NV	1,662	96.950	161,130.900	
	SOFINA	831	222.800	185,146.800	
	ARGENX SE	3,279	349.300	1,145,354.700	
	PRYSMIAN SPA	14,609	58.880	860,177.920	
	ASSICURAZIONI GENERALI	56,535	23.650	1,337,052.750	
	MEDIOBANCA SPA	28,218	14.420	406,903.560	
	TENARIS SA	26,153	14.850	388,372.050	
	UNICREDIT SPA	83,772	35.290	2,956,313.880	
	TELECOM ITALIA SPA	556,274	0.246	137,121.540	
	INTESA SANPAOLO	810,587	3.547	2,875,557.380	
	POSTE ITALIANE SPA	24,593	12.790	314,544.470	
	MONCLER SPA	12,262	61.460	753,622.520	
	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	5,629	48.200	271,317.800	
	ENI SPA	117,844	14.014	1,651,465.810	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	34,206	9.412	321,946.870	
	BANCO BPM SPA	71,900	6.436	462,748.400	
	DIASORIN SPA	1,144	99.500	113,828.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	17,591	10.100	177,669.100	
	NEXI SPA	32,804	6.164	202,203.850	
	AMPLIFON SPA	6,724	33.510	225,321.240	
	LEONARDO SPA	22,428	23.690	531,319.320	
	ENEL SPA	450,723	6.736	3,036,070.120	
	SNAM SPA	111,765	4.486	501,377.790	
	TERNA SPA	77,941	7.856	612,304.490	
	FINECOBANK SPA	33,884	14.520	491,995.680	
	STELLANTIS NV	122,796	19.926	2,446,833.090	
	FERRARI NV	6,970	378.200	2,636,054.000	
	TELEFONICA SA	262,515	4.455	1,169,504.320	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ENDESA SA	17,655	18.700	330,148.500	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	323,534	9.456	3,059,337.500	
	IBERDROLA SA	329,598	12.310	4,057,351.380	
	BANCO DE SABADELL SA	329,300	1.858	611,839.400	
	REPSOL SA	67,472	14.570	983,067.040	
	GRIFOLS SA	15,613	9.386	146,543.610	
	BANCO SANTANDER SA	875,213	4.740	4,148,947.220	
	AMADEUS IT GROUP SA	24,995	66.180	1,654,169.100	
	CAIXABANK SA	207,840	5.028	1,045,019.520	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,352	41.000	465,432.000	
	AENA SME SA	4,128	180.800	746,342.400	
	CELLNEX TELECOM SA	27,557	34.340	946,307.380	
	ACCIONA SA	1,333	119.800	159,693.400	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	60,486	43.930	2,657,149.980	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	22,557	16.940	382,115.580	
	UPM-KYMMENE OYJ	29,566	34.900	1,031,853.400	
	NOKIA OYJ	295,558	3.620	1,070,067.730	
	WARTSILA OYJ ABP	28,085	19.045	534,878.820	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	32,332	12.920	417,729.440	
	ELISA OYJ	7,914	43.420	343,625.880	
	SAMPO OYJ-A SHS	25,046	39.900	999,335.400	
	FORTUM OYJ	24,889	14.055	349,814.890	
	KESKO OYJ-B SHS	15,138	16.530	250,231.140	
	KONE OYJ-B	18,855	47.380	893,349.900	
	NESTE OYJ	23,470	18.740	439,827.800	
	ORION OYJ-CLASS B	6,025	38.970	234,794.250	
	METSO CORPORATION	35,673	10.550	376,350.150	
	NORDEA BANK ABP	174,733	11.165	1,950,893.940	
	VERBUND AG	3,805	76.200	289,941.000	
	OMV AG	7,924	45.120	357,530.880	
	ERSTE GROUP BANK AG	18,467	44.070	813,840.690	
	VOESTALPINE AG	6,073	25.600	155,468.800	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,509	45.220	656,096.980	
	AIB GROUP PLC	94,963	5.050	479,563.150	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	56,730	10.145	575,525.850	
	KINGSPAN GROUP PLC	8,673	88.350	766,259.550	
	JERONIMO MARTINS	15,764	20.300	320,009.200	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	173,888	3.804	661,469.950	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,805	18.910	487,972.550	
	EDP RENOVAVEIS SA	17,370	14.970	260,028.900	
	KERRY GROUP PLC-A	8,694	77.700	675,523.800	
ユーロ 小計				288,379,636.860 (48,739,042,427)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	84,000	44.300	3,721,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	133,000	39.000	5,187,000.000	
	MTR CORP	94,500	26.300	2,485,350.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	88,000	74.350	6,542,800.000	
	SINO LAND CO	236,000	8.490	2,003,640.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	162,669	38.700	6,295,290.300	
	WHARF HOLDINGS LTD	65,000	23.850	1,550,250.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	26,000	69.300	1,801,800.000	
	CLP HOLDINGS LTD	99,500	64.450	6,412,775.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	88,507	24.900	2,203,824.300	
	HONG KONG & CHINA GAS	678,475	6.180	4,192,975.500	
	HANG SENG BANK LTD	46,300	110.000	5,093,000.000	
	WH GROUP LTD	505,000	5.370	2,711,850.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	73,000	271.000	19,783,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	71,000	14.520	1,030,920.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	117,669	31.100	3,659,505.900	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	38,500	45.150	1,738,275.000	
	AIA GROUP LTD	680,200	58.900	40,063,780.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	82,000	21.100	1,730,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	21.850	2,228,700.000	
	SANDS CHINA LTD	147,200	18.900	2,782,080.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,500	96.200	8,032,700.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	224,000	24.900	5,577,600.000	
香港・ドル 小計				136,828,516.000 (2,720,150,899)	
合計				530,134,605,136 [530,134,605,136]	

(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	8,137	1,602,419.410	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	18,707	2,852,256.290	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,600	515,570.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	6,200	1,231,506.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	20,100	1,318,761.000	
		EQUINIX INC	5,508	4,211,857.440	
		AMERICAN TOWER CORP	26,700	5,350,947.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	40,243	724,776.430	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	18,900	687,582.000	
		KIMCO REALTY CORP	38,600	744,208.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,600	705,120.000	
		INVITATION HOMES INC	35,000	1,223,250.000	
		VICI PROPERTIES INC	59,700	1,713,987.000	
		VENTAS INC	23,000	1,150,000.000	
		WEYERHAEUSER CO	41,714	1,229,311.580	
		CROWN CASTLE INTL CORP	24,900	2,580,138.000	
		IRON MOUNTAIN INC	16,800	1,363,320.000	
		SUN COMMUNITIES INC	7,200	852,336.000	
		PROLOGIS INC	52,954	5,759,806.580	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,200	1,081,092.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,200	659,556.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,700	976,097.000	
		WELLTOWER INC	32,600	3,406,374.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,600	801,444.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,700	914,349.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,200	651,474.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	28,600	565,708.000	
		REALTY INCOME CORP	49,395	2,688,569.850	
		PUBLIC STORAGE	9,100	2,538,627.000	
		REGENCY CENTERS CORP	10,100	621,756.000	
		UDR INC	17,900	708,661.000	
		WP CAREY INC	12,500	714,500.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,900	2,597,648.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,100	1,791,526.000	
	アメリカ・ドル 小計			56,534,534.580 (8,779,813,220)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,560	260,502.600	
		SEGRO PLC	71,041	660,965.460	
	イギリス・ポンド 小計			921,468.060 (182,782,404)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	55,930	379,205.400	
		TRANSURBAN GROUP	164,915	2,077,929.000	
		APA GROUP	68,713	576,502.070	
		SCENTRE GROUP	276,990	869,748.600	
		GPT GROUP	99,602	420,320.440	
		MIRVAC GROUP	211,167	418,110.660	
		STOCKLAND	127,778	581,389.900	
		GOODMAN GROUP	91,172	3,129,934.760	
		VICINITY CENTRES	201,203	385,303.740	
	オーストラリア・ドル 小計			8,838,444.570 (912,922,940)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,300	194,360.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,900	137,223.000	
	カナダ・ドル 小計			331,583.000 (37,647,934)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	226,100	594,643.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	325,970	642,160.900	
	シンガポール・ドル 小計			1,236,803.900 (142,652,962)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,557	530,723.580	
		GECINA SA	2,408	242,485.600	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		KLEPIERRE	11,572	313,138.320	
		COVIVIO	2,737	135,645.720	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,789	261,953.640	
	ユーロ 小計			1,483,946.860 (250,801,858)	
	香港・ドル	LINK REIT	154,600	5,248,670.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	230,000	1,971,100.000	
	香港・ドル 小計			7,219,770.000 (143,529,028)	
投資証券 合計				10,450,150,346 [10,450,150,346]	
合計				10,450,150,346 [10,450,150,346]	

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 580 銘柄 投資証券 34 銘柄	97.9%	2.1%	76.2%
イギリス・ポンド	株式 77 銘柄 投資証券 2 銘柄	99.2%	0.8%	4.0%
イスラエル・シュケル	株式 8 銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49 銘柄 投資証券 9 銘柄	91%	9.0%	1.9%
カナダ・ドル	投資証券 2 銘柄 株式 85 銘柄	99.8%	0.2%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 2 銘柄 株式 12 銘柄	92.1%	7.9%	0.3%
スイス・フラン	株式 45 銘柄	100%	-%	2.5%
スウェーデン・クローナ	株式 43 銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 15 銘柄	100%	-%	1.1%
ニュージーランド・ドル	株式 5 銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11 銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 218 銘柄 投資証券 5 銘柄	99.5%	0.5%	9.1%
香港・ドル	投資証券 2 銘柄 株式 23 銘柄	95%	5.0%	0.5%

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。

「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

	2023年6月5日現在 金　額（円）	2024年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	8,083,687,965	7,388,708,426
コール・ローン	1,316,481,366	1,600,798,871
国債証券	251,403,629,306	312,613,617,028
派生商品評価勘定	7,667,397	558,874
未収入金	11,204,843	80,135,777
未収利息	1,601,633,414	2,219,625,283
前払費用	71,242,440	139,792,047
流動資産合計	262,495,546,731	324,043,236,306
資産合計	262,495,546,731	324,043,236,306
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	712,889	21,185,483
未払金	5,474,668,258	5,429,991,507
未払解約金	248,983,806	202,685,174
流動負債合計	5,724,364,953	5,653,862,164
負債合計	5,724,364,953	5,653,862,164
純資産の部		
元本等		
元本　※1	79,326,984,057	86,486,918,304
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	177,444,197,721	231,902,455,838
元本等合計	256,771,181,778	318,389,374,142
純資産合計	256,771,181,778	318,389,374,142
負債純資産合計	262,495,546,731	324,043,236,306

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 6 月 5 日現在	2024 年 6 月 5 日現在
1.　※1　期首	2022 年 6 月 7 日	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	75,518,465,344 円	79,326,984,057 円
期中追加設定元本額	9,967,747,761 円	14,012,892,396 円
期中一部解約元本額	6,159,229,048 円	6,852,958,149 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	420,348,520 円	349,186,959 円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	7,898,412円	4,950,980円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	47,909,085円	32,233,766円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	18,253,368円	14,812,611円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	216,841,012円	185,995,811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）	457,193,545円	726,370,573円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	-円	585,089,705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）	730,996,597円	944,891,035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）	3,033,257,830円	4,796,062,679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）	855,201,324円	1,136,063,780円
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックス	1,615,120円	1,757,072円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,415,830円	21,265,158円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,204,039,693円	2,090,049,220円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,093,016,152円	2,508,886,852円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	408,215,928円	588,740,057円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	15,487円	1,737,489円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,799,853,169円	51,775,854,367円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,133,031,789円	1,176,516,654円
ダイワ・ライフ・バランス５０	746,371,730円	874,268,687円
ダイワ・ライフ・バランス７０	532,513,009円	710,444,873円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	676,398,361円	711,384,027円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	527,279,690円	577,596,785円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	206,860,176円	235,532,957円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	34,610,415円	35,042,588円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	17,092,551円	21,429,624円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,613,655,804円	2,272,208,108円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,454,951円	4,872,476円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,621,436円	2,187,275円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,253,618円	3,880,555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）	462,884,174円	1,782,890,469円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	112,079,398円	90,058,800円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	29,164,889円	26,110,093円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,126,411,245円	2,642,436,764円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	196,547,666円	170,383,732円
スタイル９（4資産分散・保守型）	−円	81,098円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	−円	1,050,847円
スタイル９（4資産分散・積極型）	−円	937,857円
スタイル９（6資産分散・保守型）	−円	26,750円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	−円	691,478円
スタイル９（6資産分散・積極型）	−円	263,119円
スタイル９（8資産分散・保守型）	−円	35,928円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	−円	702,717円
スタイル９（8資産分散・積極型）	−円	749,639円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	156,992,713円	139,510,747円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	58,631,967円	68,462,017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）	2,520,728,659円	3,199,624,709円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,747,816,771円	5,871,250,340円
ダイワライフスタイル２５	28,914,057円	25,543,259円
ダイワライフスタイル５０	61,248,945円	59,503,241円
ダイワライフスタイル７５	16,348,971円	17,291,977円
計	79,326,984,057円	86,486,918,304円
2. 期末日における受益権の総数	79,326,984,057口	86,486,918,304口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024 年 6 月 5 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	2023年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,884,416,101	2,019,869,309
合計	△2,884,416,101	2,019,869,309

（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	2023年6月5日現在				2024年6月5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	51,467,935	－	52,180,720	△712,785	83,768,730	－	83,209,960	558,770
イスラエル・シュケル	－	－	－	－	76,245,257	－	75,758,768	486,489
デンマーク・クローネ	－	－	－	－	7,523,473	－	7,451,192	72,281
ニュージーランド・ドル	51,467,935	－	52,180,720	△712,785	－	－	－	－
買建	1,064,544,748	－	1,072,212,041	7,667,293	1,566,274,930	－	1,545,089,551	△21,185,379
アメリカ・ドル	87,960,550	－	88,587,707	627,157	409,543,320	－	405,798,750	△3,744,570
イギリス・ポンド	9,014,278	－	9,022,317	8,039	－	－	－	－
オフショア・人民元	723,623,800	－	727,275,700	3,651,900	710,597,903	－	703,955,385	△6,642,518
カナダ・ドル	－	－	－	－	156,594,702	－	154,254,760	△2,339,942
シンガポール・ドル	27,108,708	－	27,276,004	167,296	51,914,150	－	51,497,600	△416,550
ニュージーランド・ドル	－	－	－	－	15,374,640	－	15,291,200	△83,440
ノルウェー・クローネ	－	－	－	－	12,131,042	－	11,925,100	△205,942
メキシコ・ペソ	195,982,580	－	199,129,385	3,146,805	148,292,739	－	140,545,606	△7,747,133
ユーロ	20,854,832	－	20,920,928	66,096	61,826,434	－	61,821,150	△5,284
合計	1,116,012,683	－	1,124,392,761	6,954,508	1,650,043,660	－	1,628,299,511	△20,626,609

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.2369円 (32,369円)	3.6814円 (36,814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	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	872,895.150	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	746,910.230	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	764,516.340	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	784,643.160	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,548,184.340	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,203,694.800	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	905,561.580	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	550,438.600	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	527,532.360	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	950,897.520	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,103,344.250	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,071,628.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,205,075.300	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,033,432.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,666,790.960	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,018,033.920	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,432,039.960	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,296,172.020	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,348,251.450	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,381,349.860	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,205,138.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,343,908.920	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,095,294.090	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,059,936.030	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,261,147.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,148,593.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,802,482.260	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,820,767.100	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,857,521.410	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	2,894,782.450	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,799,603.960	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,558,709.160	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,166,978.440	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,848,640.640	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,442,585.250	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,542,282.150	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,438,257.970	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,621,876.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	516,333.090	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,611,459.540	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,245,877.640	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,280,331.550	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,008,733.880	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,040,954.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,876,583.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,979,721.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	760,000.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,426,696.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,819,555.850	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,020,352.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,548,660.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,506,116.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,806,948.500	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,111,425.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,840,425.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,982,335.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,310,570.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,991,816.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,137,105.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,472,894.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,927,760.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,308,720.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,474,473.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,439,550.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,502,116.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,436,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,433,875.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,511,744.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,482,681.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,912,550.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,448,610.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,112,854.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,410,625.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,604,101.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,402,825.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,389,150.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,476,293.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,558,594.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,677,920.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,850,810.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,643,732.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,355,850.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,114,427.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,439,834.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,603,440.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,334,650.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,795,370.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,501,872.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,023,595.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,860,300.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,328,600.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,289,700.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,000,930.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,319,704.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	273,666.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,435,056.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,490,184.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,138,616.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	502,010.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,105,250.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,108,700.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,860,110.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,500,000.000	3,325,840.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,100,615.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,219,154.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,403,360.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,396,750.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	8,200,000.000	4,249,404.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,075,150.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,081,610.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,760,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,497,000.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,301,060.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,918,400.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,746,680.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,501,640.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,768,288.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,253,392.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,769,673.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,384,250.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,372,050.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,660,050.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,132,910.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,487,313.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,747,357.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,645,200.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,433,000.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,248,029.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,784,660.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,554,360.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,719,040.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,305,390.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,172,400.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,320,980.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,265,856.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,778,674.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,308,920.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,068,108.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,414,900.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,624,000.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,360,407.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,194,441.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,806,517.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,502,420.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,358,450.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,371,750.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,584,350.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,386,300.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,211,495.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,136,300.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,877,500.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,774,760.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,281,020.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,442,940.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,684,920.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,947,544.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,506,640.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,678,280.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,538,106.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,828,763.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,448,154.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,838,850.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,471,250.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,654,350.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,742,420.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,729,750.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,394,273.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,709,750.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,259,850.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,804,040.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,853,960.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,570,580.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,893,540.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,910,800.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,798,560.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,891,520.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,934,120.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,859,092.600	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,400,910.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,469,440.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,959,072.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,706,200.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,093,955.200	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,396,225.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,299,275.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,257,128.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,442,625.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,459,785.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,366,918.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,965,170.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,557,895.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,490,475.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,409,180.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,948,490.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,442,075.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,941,440.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,326,150.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,452,260.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,476,315.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,882,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,470,780.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,788,450.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,450,755.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,518,720.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,281,475.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,869,730.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,580,601.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	3,929,520.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,953,170.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,490,950.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,733,544.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,594,402.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,962,420.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,868,960.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,933,240.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,914,440.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,248,930.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,817,736.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,277,225.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,569,040.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,592,515.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,453,170.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,963,430.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,488,025.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,905,410.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,445,225.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	4,975,850.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	3,986,480.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,461,710.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,615,330.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	5,956,620.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,707,800.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,240,867.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,944,440.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,897,465.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,062,552.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	2,995,950.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	2,995,230.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	999,900.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,523,025.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,235,742.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	998,920.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	1,000,000.000	1,000,170.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,113,520.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,125,700.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,797,606.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,352,463.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,190,861.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,540,938.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,496,220.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,005,250.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	3,998,800.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	1,987,960.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,961,560.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,350,195.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	1,000,000.000	989,860.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	5,939,400.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,725,072.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	974,080.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	985,000.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	7,984,094.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	3,952,480.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,236,716.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,970,930.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,583,116.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	4,980,650.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,175,404.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	4,958,000.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	4,948,000.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,976,080.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,170,516.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	4,992,350.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,503,300.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	2,200,000.000	2,208,404.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	3,994,200.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,528,900.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,628,240.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	1,300,000.000	1,332,084.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	1,000,000.000	1,009,210.000	
	アメリカ・ドル 小計			948,645,920.080 (147,324,711,389)	
	イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	890,588.580	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	810,980.380	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,381,421.750	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	990,932.800	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,074,595.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	957,037.500	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,288,852.800	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,354,965.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	799,321.200	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	707,547.500	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	442,255.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,273,530.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,824,209.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	728,518.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,036,126.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	510,493.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,400,625.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,383,968.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	441,870.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,521,365.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,916,650.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	992,240.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,189,025.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	876,294.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,359,750.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,292,786.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,732,107.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	660,270.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,877,408.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	298,808.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,982,400.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	935,110.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	3,600,000.000	3,373,452.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	393,116.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,144,750.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,500,000.000	1,349,250.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,220,614.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,034,630.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,000,000.000	1,021,400.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,864,831.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	850,000.000	816,510.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	500,000.000	496,395.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	1,300,000.000	1,297,062.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,023,003.020	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,054,144.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,358,322.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,406,435.510	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,611,788.360	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,299,612.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,233,687.840	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,106,901.200	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,664,736.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,271,740.420	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,806,126.400	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,596,972.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,062,845.680	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,533,632.500	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,345,118.400	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,548,220.200	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,131,114.600	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,304,086.800	
	イギリス・ポンド 小計			82,302,547.440 (16,325,533,310)	
	イスラエル・シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,875,150.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,306,194.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,230,264.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,685,862.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	1,939,896.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,093,860.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	1,966,872.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,148,282.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	187,302.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,790,251.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	820,000.000	525,956.200	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,899,620.000	
		4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	931,040.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,441,050.000	
	イスラエル・シュケル 小計			23,021,599.200 (969,596,089)	
	オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,030,808.780	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,308,749.320	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,296,995.660	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,754,292.800	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,041,957.210	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,125,562.260	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	684,699.840	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,606,725.120	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,104,386.780	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	957,492.040	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,425,180.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,780,623.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,631,531.700	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,090,357.700	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,382,532.800	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,161,188.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,644,760.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	771,890.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,512,032.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,992,975.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,109,124.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,317,232.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,530,901.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,146,708.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,023,935.000	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	911,646.000	
	オーストラリア・ドル 小計			38,344,286.010 (3,960,581,302)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,319,756.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,274,750.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,313,050.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,152,400.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,381,600.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,439,840.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,343,460.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,798,770.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,327,240.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,435,150.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,358,125.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,156,520.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,929,725.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,270,690.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	16,934,960.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,609,750.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,578,795.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,097,850.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,814,545.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,363,500.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,377,910.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,811,175.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,719,950.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,731,171.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	13,716,240.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,694,810.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	13,507,670.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	16,671,520.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,197,030.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,447,176.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,476,400.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,225,000.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,246,900.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,158,200.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,118,320.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	19,490,390.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	25,131,500.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	32,602,560.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,717,170.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,431,340.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	15,409,800.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,690,135.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,134,460.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,611,990.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,398,800.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,418,380.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,681,150.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,502,950.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,523,750.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	25,850,160.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,065,940.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	41,096,800.000	
		2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	9,026,640.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	33,734,580.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,415,100.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	40,529,200.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,188,100.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,390,750.000	
		2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	30,194,700.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,412,200.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	24,000,000.000	26,167,440.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,390,200.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,666,000.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	36,946,080.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,154,980.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	50,887,500.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	58,730,800.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,105,700.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,019,920.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,103,740.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	9,000,000.000	9,020,250.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	72,921,160.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	40,000,000.000	39,914,400.000	
		2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	25,000,000.000	25,062,000.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	5,000,000.000	4,979,200.000	
	オフショア・人民元 小計			1,412,717,863.000 (30,252,364,134)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	535,552.050	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,087,817.290	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,314,072.310	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,176,085.680	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	980,059.850	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	977,279.340	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,202,671.610	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,131,978.320	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	923,747.700	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,147,136.400	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	614,263.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,814,406.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,157,292.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,044,866.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,760,239.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,662,180.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,967,511.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	281,445.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,992,646.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,867,720.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,057,044.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,831,830.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,349,190.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	94,508.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	389,112.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	983,520.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,113,188.400	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,295,892.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	588,990.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,609,730.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	801,630.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,186,596.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	495,030.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	984,770.000	
		4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,006,000.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	300,000.000	306,543.000	
		4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,010,680.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,637,695.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	999,120.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	400,000.000	402,660.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	800,936.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	700,581.000	
	カナダ・ドル 小計			54,284,214.450 (6,163,429,709)	
	シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	775,860.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	791,202.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	376,000.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	572,884.800	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	614,062.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	517,921.600	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	641,807.680	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	438,273.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	674,250.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	537,680.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	314,121.500	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	421,200.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	719,475.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	538,320.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	386,885.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	190,420.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	229,008.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	602,950.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	98,810.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	394,480.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	593,736.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	302,895.000	
	シンガポール・ドル 小計			10,732,242.080 (1,237,856,802)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,167,394.450	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,907,016.400	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,741,748.000	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,312,969.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,908,416.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,319,100.000	
		1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,914,080.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			31,270,723.850 (465,933,785)	
	デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,760,541.600	
		1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,908,073.150	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,750,446.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,685,744.400	
		0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,846,775.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	418,005.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,957,720.000	
	デンマーク・クローネ 小計			35,327,305.150 (800,163,462)	
	ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	596,556.000	
		3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,370,160.000	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	390,721.100	
		3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	558,564.000	
		1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	432,183.200	
		1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	221,375.000	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	927,663.000	
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	459,910.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	362,542.400	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	255,063.600	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	192,286.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	497,420.000	
		5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	699,545.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	487,830.000	
	ニュージーランド・ドル 小計			7,451,819.300 (715,300,134)	
	ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,174,255.400	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,236,578.000	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,303,160.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,522,981.000	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,224,672.000	
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,986,235.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,531,173.000	
		3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,498,565.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,432,800.000	
		3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,508,750.000	
	ノルウェー・クローネ 小計			32,419,169.400 (476,885,982)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,141,780.020	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,918,143.500	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,243,276.400	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,328,000.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,958,770.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,370,736.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	479,445.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,374,650.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,401,825.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,139,750.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,823,200.000	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,937,640.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	836,717.250	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,325,624.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,502,990.530	
	ポーランド・ズロチ 小計			41,782,548.200 (1,639,004,019)	
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,368,135.350	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,506,870.700	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,539,843.980	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,332,058.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	737,710.580	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,424,873.770	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,892,336.960	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,434,537.000	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,749,211.110	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,255,819.200	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,002,763.200	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,564,833.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,201,638.200	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,099,311.500	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,271,532.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,187,540.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	655,427.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,332,106.700	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,328,532.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	1,992,320.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,685,810.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,581,842.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,670,400.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,374,058.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,040,676.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,510.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,453,760.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	996,040.000	
		4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,203,816.000	
		4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	804,840.000	
	マレーシア・リンギット 小計			47,207,153.250 (1,559,851,803)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,447,010.400	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	17,443,422.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,220,480.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	11,353,020.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	25,688,700.000	
		7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,794,590.000	
		8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,299,950.000	
		8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,400,500.000	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	25,999,052.800	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	8,927,066.520	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	27,775,200.720	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	16,754,821.320	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	39,547,126.000	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	23,961,025.080	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	6,829,059.600	
	メキシコ・ペソ 小計			261,441,024.440 (2,284,288,663)	
	ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	316,086.680	
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	270,989.910	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	773,856.200	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	256,935.600	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	740,304.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	395,429.800	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	452,510.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	442,515.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	219,563.700	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	253,044.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	418,130.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	182,412.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	491,922.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	186,852.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	280,854.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	715,488.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	258,298.200	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	381,524.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	300,195.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	998,980.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	382,668.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	99,708.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	500,000.000	486,490.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	2,126,000.000	2,019,423.620	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	570,728.480	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	142,082.400	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,195,379.200	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	398,352.600	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,111,512.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,147,712.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	833,480.200	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	685,104.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	239,804.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	157,703.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	990,228.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	425,970.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	132,471.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,589,994.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,291,290.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	231,165.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	293,922.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	795,368.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	295,527.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,002,680.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	825,280.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	495,155.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	500,950.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,654,214.360	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,561,598.980	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	642,230.660	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,403,865.540	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	883,190.240	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	543,004.600	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,032,658.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	440,718.800	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	488,544.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,374,942.200	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	564,921.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,364,940.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	489,125.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	186,687.600	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	549,153.000	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,089,240.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,294,976.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	218,428.900	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,141,434.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	498,408.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	374,720.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,499,760.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	574,662.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	703,598.000	
		2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	300,000.000	293,883.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	989,410.000	
		2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	99,183.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,294,471.410	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,377,573.020	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,027,482.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,320,890.090	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,586,886.400	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,750,717.850	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,743,757.630	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,578,141.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,198,930.720	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,120,727.420	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,608,000.000	1,552,459.680	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,582,475.630	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,078,622.700	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,996,736.880	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,274,533.800	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,058,188.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,082,200.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,586,746.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,759,951.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,726,326.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,231,081.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,637,630.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,432,495.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,521,030.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,589,763.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,827,060.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,547,226.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,032,060.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	764,307.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,029,336.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,787,680.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	555,049.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,021,300.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	587,895.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,147,958.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,292,320.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,543,940.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	1,935,554.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,128,352.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,362,704.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,674,160.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	824,880.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,415,672.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,488,450.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	1,600,000.000	1,554,528.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,100,000.000	1,059,751.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	982,700.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,006,194.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	994,960.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	99,848.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	299,778.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	792,328.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	798,592.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,206,459.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	95,954.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,084,434.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,621,164.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,867,903.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,869,050.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	411,454.100	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	98,384.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	99,143.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	97,844.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	97,868.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,134,142.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,713,585.420	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,883,984.930	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,067,901.020	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,943,892.720	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,587,375.120	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,660,241.760	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,912,566.300	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,671,850.140	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	1,899,000.000	1,887,397.110	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,040,352.160	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	4,989,024.380	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,003,349.510	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,682,188.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,173,616.320	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,397,735.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	909,053.670	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,786,871.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,125,261.500	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,213,476.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,975,663.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,971,726.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,372,298.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,513,905.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,927,398.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,771,504.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,601,248.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,463,086.300	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,844,570.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,450,636.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,166,050.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	560,239.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,900,000.000	1,124,781.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,718,042.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,861,424.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,342,458.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,864,268.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	2,200,000.000	1,716,176.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	3,976,855.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,463,328.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	880,660.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,920,450.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,160,736.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	3,900,000.000	3,906,006.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,274,501.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	2,700,000.000	2,806,407.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	655,235.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,056,042.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	700,000.000	668,808.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	992,860.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,242,819.850	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,958,404.500	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,925,120.470	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,440,519.040	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,891,114.440	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,732,917.870	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,841,758.920	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,065,998.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,246,158.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,060,248.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	632,133.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,188,838.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,134,768.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	586,712.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,075,334.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	608,940.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	794,178.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	95,220.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	503,508.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	996,792.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	879,930.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,283,711.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	630,006.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	500,000.000	486,090.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,209,999.900	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,637,538.800	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,300,214.760	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,440,045.440	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,798,160.700	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,833,844.930	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,258,504.800	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,307,118.840	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,947,302.840	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,016,351.520	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	706,339.920	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,353,975.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,463,839.300	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,458,171.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,601,288.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,146,223.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,007,285.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,495,914.500	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,531,198.500	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,213,116.700	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,358,954.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,849,105.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,048,151.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,102,575.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,692,653.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,207,355.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,118,061.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,154,385.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,475,010.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,722,280.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,875,489.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,042,062.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,621,613.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,078,995.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,600,864.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	727,212.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	490,938.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,696,054.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,468,458.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,391,214.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,035,331.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	279,128.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	714,624.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,576,240.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,887,123.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	817,660.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	787,878.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	529,416.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	282,348.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,000,000.000	1,947,200.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	778,656.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,466,688.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,106,386.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	195,774.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	506,955.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,303,531.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,946,832.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	306,291.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,504,170.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	102,543.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	820,072.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	503,755.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	925,965.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,213,920.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,197,125.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	712,222.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	909,738.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	300,480.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,168,880.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,541,400.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	618,858.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	198,042.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	997,420.000	
		4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,000,520.000	
		3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	99,621.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	399,104.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	200,000.000	200,308.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	50,229.500	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,000,000.000	992,320.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,554,995.000	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,284,298.710	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,075,389.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,526,834.840	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,760,139.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,241,736.560	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,458,597.160	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,108,502.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,543,273.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,937,190.500	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,328,709.160	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,505,183.920	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,229,469.760	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,786,438.960	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,025,294.270	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	836,885.400	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	673,902.580	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	743,944.770	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	941,597.410	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	776,044.360	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,032,934.180	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	473,632.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	744,496.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	660,562.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	685,575.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	877,572.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	427,524.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	268,145.500	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	462,715.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	683,088.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	654,000.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	268,028.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	81,916.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	197,440.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	291,675.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	904,934.250	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,519,883.540	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	901,136.250	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	381,551.300	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	716,615.910	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	730,645.860	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	671,869.100	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	387,167.810	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	375,990.670	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,998,987.680	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,933,394.400	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,160,040.640	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,672,901.330	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,710,225.280	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,411,647.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,523,406.100	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,819,744.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,634,290.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,948,115.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,262,096.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,832,776.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,724,260.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,490,880.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,942,357.500	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,471,616.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,220,108.800	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	763,168.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,241,264.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,155,920.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	914,199.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	474,820.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,804,022.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	319,663.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,244,000.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	507,850.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,581,769.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	392,292.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	830,196.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,752,072.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,075,936.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	1,100,000.000	1,063,623.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	986,414.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,626,339.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	963,960.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,592,382.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,283,509.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	828,520.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,538,115.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	613,908.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,594,774.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	196,814.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,018,940.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,588,216.200	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,893,425.460	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,147,272.020	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,242,353.960	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,829,050.040	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,075,590.200	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,927,069.800	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,565,126.130	
	ユーロ 小計			582,439,597.920 (98,438,116,445)	
国債証券 合計				312,613,617,028 [312,613,617,028]	
合計				312,613,617,028 [312,613,617,028]	

（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	279 銘柄	100%	47.1%
イギリス・ポンド	国債証券	61 銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シュケル	国債証券	14 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	26 銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券	75 銘柄	100%	9.7%
カナダ・ドル	国債証券	42 銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	22 銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7 銘柄	100%	0.1%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券	14 銘柄	100%	0.2%

ノルウェー・クローネ	国債証券	10 銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15 銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	30 銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15 銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	386 銘柄	100%	31.5%

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

	2023年6月5日現在 金　額（円）	2024年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	844,965,775	1,633,316,704
国債証券	40,102,905,890	78,982,841,780
地方債証券	2,693,837,873	5,056,420,277
特殊債券	932,153,700	4,399,795,427
社債券	2,865,361,500	6,808,299,900
未収利息	80,306,475	143,570,691
前払費用	6,011,813	24,495,748
流動資産合計	47,525,543,026	97,048,740,527
資産合計	47,525,543,026	97,048,740,527
負債の部		
流動負債		
未払金	711,652,000	2,075,940,000
未払解約金	12,361,571	161,602
流動負債合計	724,013,571	2,076,101,602
負債合計	724,013,571	2,076,101,602
純資産の部		
元本等		
元本　※1	37,438,102,323	79,534,327,542
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,363,427,132	15,438,311,383
元本等合計	46,801,529,455	94,972,638,925
純資産合計	46,801,529,455	94,972,638,925
負債純資産合計	47,525,543,026	97,048,740,527

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2024 年 6 月 5 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	2023 年 6 月 5 日現在	2024 年 6 月 5 日現在
1.　※1　期首	2022 年 6 月 7 日	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	30,891,408,853 円	37,438,102,323 円
期中追加設定元本額	7,312,021,169 円	43,080,599,426 円
期中一部解約元本額	765,327,699 円	984,374,207 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）	2,049,608,556 円	3,574,576,557 円
日本債券インデックスファンド VA（適格機関投資家専用）	－円	30,372,368,739 円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	3,549,142,220 円	2,936,179,418 円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,344,516,746 円	7,657,263,891 円
ダイワ・ライフ・バランス３０	10,631,228,521 円	12,692,085,787 円
ダイワ・ライフ・バランス５０	7,613,146,325 円	10,551,584,695 円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,742,507,483 円	4,353,349,045 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,722,613,826 円	2,178,385,186 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,341,988,777 円	1,750,979,994 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	528,570,997 円	724,464,014 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,594,215,198 円	2,395,945,791 円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	41,786,183 円	54,869,712 円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	16,600,215 円	27,058,330 円

区分	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
ダイワつみたてインデックスバランス７０	16,691,466円	24,027,180円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	201,596,693円	193,800,497円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	43,889,117円	47,388,706円
計	37,438,102,323円	79,534,327,542円
2. 期末日における受益権の総数	37,438,102,323口	79,534,327,542口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月6日 至2024年6月5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月5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	2023年6月5日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2024年6月5日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	314,736,180	△2,186,348,380
地方債証券	4,709,005	△46,225,816
特殊債券	△807,900	△57,326,908
社債券	△18,115,100	△51,814,200
合計	300,522,185	△2,341,715,304

（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

2023年6月5日現在	2024年6月5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）

	2023年6月5日現在	2024年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2501円 （12,501円）	1.1941円 （11,941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
国債証券	451 2年国債	20,000,000	19,955,000	
	452 2年国債	2,130,000,000	2,124,589,800	
	453 2年国債	60,000,000	59,829,600	
	455 2年国債	2,020,000,000	2,012,505,800	
	456 2年国債	500,000,000	498,665,000	
	457 2年国債	160,000,000	159,510,400	
	458 2年国債	750,000,000	748,702,500	
	459 2年国債	40,000,000	39,916,400	
	460 2年国債	50,000,000	49,971,500	
	145 5年国債	800,000,000	798,760,000	
	146 5年国債	540,000,000	538,714,800	
	147 5年国債	800,000,000	795,800,000	
	148 5年国債	1,500,000,000	1,489,965,000	
	149 5年国債	2,380,000,000	2,361,340,800	
	150 5年国債	1,200,000,000	1,189,128,000	
	151 5年国債	300,000,000	296,898,000	
	152 5年国債	130,000,000	128,996,400	
	153 5年国債	1,600,000,000	1,581,264,000	
	154 5年国債	2,180,000,000	2,157,698,600	
	155 5年国債	90,000,000	89,576,100	
	156 5年国債	630,000,000	624,834,000	
	157 5年国債	60,000,000	59,419,200	
	158 5年国債	1,500,000,000	1,479,900,000	
	159 5年国債	200,000,000	196,950,000	
	161 5年国債	400,000,000	397,068,000	
	162 5年国債	280,000,000	277,530,400	
	163 5年国債	1,300,000,000	1,293,994,000	
	164 5年国債	1,200,000,000	1,181,916,000	
	166 5年国債	150,000,000	149,101,500	
	168 5年国債	450,000,000	450,733,500	
	1 40年国債	30,000,000	32,537,100	
	2 40年国債	48,000,000	50,046,720	
	3 40年国債	19,000,000	19,679,820	
	4 40年国債	54,000,000	55,641,060	
	5 40年国債	61,000,000	59,981,910	
	6 40年国債	268,000,000	256,998,600	
	7 40年国債	190,000,000	172,903,800	
	8 40年国債	40,000,000	33,481,200	
	9 40年国債	40,000,000	23,995,600	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	10 40年国債	290,000,000	204,737,100	
	11 40年国債	85,000,000	57,171,850	
	12 40年国債	99,000,000	58,359,510	
	13 40年国債	252,000,000	145,789,560	
	14 40年国債	273,000,000	168,498,330	
	15 40年国債	650,000,000	443,319,500	
	16 40年国債	1,030,000,000	771,408,200	
	17 40年国債	120,000,000	116,658,000	
	340 10年国債	190,000,000	190,438,900	
	341 10年国債	15,000,000	15,010,350	
	342 10年国債	140,000,000	139,501,600	
	343 10年国債	300,000,000	298,572,000	
	344 10年国債	90,000,000	89,487,900	
	345 10年国債	410,000,000	407,265,300	
	346 10年国債	20,000,000	19,845,600	
	347 10年国債	300,000,000	297,342,000	
	348 10年国債	430,000,000	425,601,100	
	349 10年国債	430,000,000	424,977,600	
	350 10年国債	400,000,000	394,640,000	
	351 10年国債	420,000,000	413,595,000	
	352 10年国債	250,000,000	245,695,000	
	353 10年国債	520,000,000	509,974,400	
	355 10年国債	100,000,000	97,698,000	
	356 10年国債	500,000,000	487,805,000	
	357 10年国債	700,000,000	681,779,000	
	358 10年国債	810,000,000	787,344,300	
	359 10年国債	1,000,000,000	969,730,000	
	360 10年国債	1,000,000,000	967,340,000	
	361 10年国債	900,000,000	868,401,000	
	362 10年国債	1,620,000,000	1,558,537,200	
	363 10年国債	830,000,000	796,053,000	
	364 10年国債	850,000,000	812,081,500	
	365 10年国債	880,000,000	837,680,800	
	366 10年国債	1,000,000,000	956,020,000	
	367 10年国債	1,025,000,000	976,702,000	
	368 10年国債	1,000,000,000	949,650,000	
	369 10年国債	1,000,000,000	970,970,000	
	370 10年国債	1,050,000,000	1,016,620,500	
	371 10年国債	1,060,000,000	1,013,996,000	
	372 10年国債	850,000,000	840,191,000	
	373 10年国債	1,040,000,000	1,005,960,800	
	374 10年国債	500,000,000	491,085,000	
	2 30年国債	9,000,000	9,916,200	
	3 30年国債	4,000,000	4,395,920	
	4 30年国債	8,000,000	9,143,840	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	5 30年国債	8,000,000	8,819,040	
	6 30年国債	9,000,000	10,080,810	
	7 30年国債	12,000,000	13,390,920	
	10 30年国債	25,000,000	25,469,250	
	11 30年国債	9,000,000	9,621,900	
	12 30年国債	11,000,000	12,142,020	
	13 30年国債	11,000,000	12,041,810	
	14 30年国債	22,000,000	24,889,700	
	15 30年国債	21,000,000	23,982,840	
	16 30年国債	26,000,000	29,707,860	
	17 30年国債	17,000,000	19,269,160	
	18 30年国債	20,000,000	22,465,600	
	19 30年国債	15,000,000	16,846,350	
	20 30年国債	16,000,000	18,313,920	
	21 30年国債	16,000,000	17,975,200	
	22 30年国債	17,000,000	19,462,790	
	23 30年国債	16,000,000	18,322,720	
	24 30年国債	15,000,000	17,171,250	
	25 30年国債	17,000,000	19,069,240	
	26 30年国債	32,000,000	36,256,640	
	27 30年国債	32,000,000	36,600,320	
	28 30年国債	34,000,000	38,860,640	
	29 30年国債	43,000,000	48,495,400	
	30 30年国債	56,000,000	62,288,240	
	31 30年国債	76,000,000	83,237,480	
	32 30年国債	115,000,000	127,310,750	
	33 30年国債	95,000,000	100,821,600	
	34 30年国債	110,000,000	119,523,800	
	35 30年国債	120,000,000	126,415,200	
	36 30年国債	138,000,000	144,840,660	
	37 30年国債	165,000,000	169,841,100	
	38 30年国債	250,000,000	252,300,000	
	39 30年国債	105,000,000	107,402,400	
	40 30年国債	80,000,000	80,344,800	
	41 30年国債	80,000,000	78,843,200	
	42 30年国債	200,000,000	196,508,000	
	43 30年国債	335,000,000	328,373,700	
	44 30年国債	155,000,000	151,681,450	
	45 30年国債	200,000,000	188,458,000	
	46 30年国債	170,000,000	159,866,300	
	47 30年国債	355,000,000	339,245,100	
	48 30年国債	170,000,000	156,167,100	
	49 30年国債	340,000,000	311,633,800	
	50 30年国債	170,000,000	137,273,300	
	51 30年国債	350,000,000	249,998,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	52 30年国債	300,000,000	224,058,000	
	53 30年国債	230,000,000	175,076,000	
	54 30年国債	290,000,000	230,474,600	
	55 30年国債	390,000,000	308,642,100	
	56 30年国債	160,000,000	126,086,400	
	57 30年国債	235,000,000	184,404,500	
	58 30年国債	360,000,000	281,300,400	
	59 30年国債	185,000,000	140,483,450	
	60 30年国債	250,000,000	198,707,500	
	61 30年国債	260,000,000	195,819,000	
	62 30年国債	265,000,000	188,359,350	
	63 30年国債	240,000,000	164,928,000	
	64 30年国債	250,000,000	170,772,500	
	65 30年国債	275,000,000	186,727,750	
	66 30年国債	330,000,000	222,740,100	
	67 30年国債	290,000,000	206,352,400	
	68 30年国債	255,000,000	180,573,150	
	69 30年国債	261,000,000	189,368,550	
	70 30年国債	391,000,000	282,391,930	
	71 30年国債	280,000,000	201,286,400	
	72 30年国債	250,000,000	178,885,000	
	73 30年国債	340,000,000	242,355,400	
	74 30年国債	335,000,000	258,975,100	
	75 30年国債	360,000,000	300,427,200	
	76 30年国債	220,000,000	187,836,000	
	77 30年国債	245,000,000	219,419,550	
	78 30年国債	180,000,000	153,135,000	
	79 30年国債	250,000,000	201,595,000	
	80 30年国債	230,000,000	214,951,100	
	81 30年国債	300,000,000	266,814,000	
	82 30年国債	60,000,000	55,932,600	
	81 20年国債	65,000,000	66,488,500	
	82 20年国債	28,000,000	28,677,320	
	85 20年国債	31,000,000	31,994,170	
	86 20年国債	6,000,000	6,213,720	
	87 20年国債	35,000,000	36,184,750	
	88 20年国債	33,000,000	34,316,040	
	89 20年国債	15,000,000	15,567,900	
	92 20年国債	60,000,000	62,635,200	
	93 20年国債	18,000,000	18,809,100	
	94 20年国債	45,000,000	47,146,950	
	95 20年国債	30,000,000	31,725,300	
	96 20年国債	63,000,000	66,244,500	
	97 20年国債	25,000,000	26,457,000	
	98 20年国債	64,000,000	67,521,920	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	99 20年国債	53,000,000	56,095,730	
	100 20年国債	35,000,000	37,286,900	
	101 20年国債	18,000,000	19,310,220	
	102 20年国債	10,000,000	10,767,000	
	103 20年国債	21,000,000	22,527,330	
	104 20年国債	64,000,000	68,133,760	
	105 20年国債	38,000,000	40,561,960	
	106 20年国債	16,000,000	17,146,080	
	107 20年国債	40,000,000	42,802,800	
	108 20年国債	68,000,000	72,161,600	
	109 20年国債	60,000,000	63,777,000	
	110 20年国債	27,000,000	28,958,310	
	111 20年国債	35,000,000	37,840,250	
	113 20年国債	70,000,000	75,577,600	
	114 20年国債	45,000,000	48,736,350	
	115 20年国債	42,000,000	45,713,220	
	116 20年国債	27,000,000	29,465,100	
	117 20年国債	77,000,000	83,598,900	
	118 20年国債	13,000,000	14,068,730	
	119 20年国債	23,000,000	24,622,650	
	120 20年国債	98,000,000	103,740,840	
	123 20年国債	42,000,000	45,892,140	
	124 20年国債	100,000,000	108,639,000	
	125 20年国債	25,000,000	27,527,500	
	126 20年国債	21,000,000	22,842,540	
	127 20年国債	110,000,000	118,936,400	
	128 20年国債	32,000,000	34,633,600	
	129 20年国債	95,000,000	102,181,050	
	130 20年国債	110,000,000	118,351,200	
	131 20年国債	150,000,000	160,293,000	
	132 20年国債	25,000,000	26,723,250	
	133 20年国債	150,000,000	161,469,000	
	134 20年国債	15,000,000	16,152,600	
	135 20年国債	20,000,000	21,382,000	
	136 20年国債	180,000,000	191,115,000	
	137 20年国債	18,000,000	19,252,440	
	139 20年国債	250,000,000	265,405,000	
	140 20年国債	100,000,000	106,955,000	
	141 20年国債	140,000,000	149,711,800	
	142 20年国債	210,000,000	226,333,800	
	143 20年国債	100,000,000	106,088,000	
	144 20年国債	50,000,000	52,635,500	
	145 20年国債	40,000,000	42,764,000	
	146 20年国債	160,000,000	170,900,800	
	147 20年国債	350,000,000	370,384,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	148 20年国債	290,000,000	303,737,300	
	149 20年国債	110,000,000	115,121,600	
	150 20年国債	350,000,000	362,383,000	
	151 20年国債	490,000,000	496,737,500	
	152 20年国債	500,000,000	505,795,000	
	153 20年国債	670,000,000	683,185,600	
	154 20年国債	380,000,000	382,660,000	
	155 20年国債	300,000,000	294,963,000	
	156 20年国債	380,000,000	347,532,800	
	157 20年国債	510,000,000	452,778,000	
	158 20年国債	680,000,000	623,668,800	
	159 20年国債	530,000,000	490,260,600	
	160 20年国債	780,000,000	727,490,400	
	161 20年国債	290,000,000	265,883,600	
	162 20年国債	540,000,000	492,696,000	
	163 20年国債	230,000,000	208,936,600	
	164 20年国債	600,000,000	535,122,000	
	165 20年国債	550,000,000	487,916,000	
	166 20年国債	620,000,000	563,282,400	
	167 20年国債	300,000,000	263,403,000	
	168 20年国債	500,000,000	430,055,000	
	169 20年国債	350,000,000	294,665,000	
	170 20年国債	455,000,000	380,693,950	
	171 20年国債	380,000,000	316,156,200	
	172 20年国債	510,000,000	429,083,400	
	173 20年国債	1,400,000,000	1,171,366,000	
	174 20年国債	650,000,000	540,819,500	
	175 20年国債	330,000,000	277,800,600	
	176 20年国債	495,000,000	414,448,650	
	177 20年国債	340,000,000	277,929,600	
	178 20年国債	600,000,000	496,818,000	
	179 20年国債	510,000,000	419,934,000	
	180 20年国債	650,000,000	562,425,500	
	181 20年国債	260,000,000	227,978,400	
	182 20年国債	490,000,000	443,107,000	
	183 20年国債	410,000,000	388,823,500	
	184 20年国債	420,000,000	376,870,200	
	185 20年国債	490,000,000	437,947,300	
	186 20年国債	420,000,000	401,381,400	
	187 20年国債	380,000,000	349,501,200	
	188 20年国債	80,000,000	77,270,400	
	1 フイリピン共和国	100,000,000	98,773,100	
国債証券 合計			78,982,841,780	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	100,095,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	797 東京都公債	100,000,000	96,982,700	
	28 東京都 20 年	100,000,000	105,548,700	
	27-15 北海道公債	100,000,000	99,775,200	
	3-5 北海道公債	100,000,000	95,680,500	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,322,600	
	262 神奈川県公債	300,000,000	300,000,000	
	401 大阪府公債	100,000,000	100,259,300	
	457 大阪府公債	100,000,000	96,628,300	
	26-5 京都府 20 年	100,000,000	103,520,300	
	6-1 京都府 5 年	200,000,000	198,682,000	
	11 兵庫県公債 20 年	100,000,000	107,044,500	
	28-1 静岡県公債	100,000,000	99,504,700	
	8 静岡県 20 年	100,000,000	108,307,400	
	5-3 愛知県公債	100,000,000	97,683,800	
	6-1 愛知県 5 年	300,000,000	297,953,700	
	24-1 広島県 20 年	100,000,000	106,511,800	
	25-1 広島県 20 年	100,000,000	106,748,300	
	1 埼玉県 15 年	100,000,000	101,684,800	
	9 埼玉県 20 年	100,000,000	108,728,200	
	22-1 福岡県 15 年	100,000,000	101,998,500	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	99,098,700	
	30-3 新潟県公債	134,160,000	131,235,177	
	3-1 茨城県公債	100,000,000	95,718,900	
	151 共同発行地方	100,000,000	100,248,500	
	168 共同発行地方	100,000,000	99,367,800	
	170 共同発行地方	200,000,000	198,408,000	
	206 共同発行地方	200,000,000	193,824,600	
	244 共同発行地方	100,000,000	96,688,800	
	3-3 堺市公債	100,000,000	94,932,400	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	96,113,700	
	27-1 滋賀県公債	100,000,000	100,262,100	
	2-1 静岡市公債	100,000,000	96,481,900	
	6-1 大阪市 5 年	200,000,000	199,609,000	
	6-2 大阪市公債	200,000,000	198,660,400	
	11 名古屋市 20 年	100,000,000	108,160,300	
	10 京都市 20 年	100,000,000	107,223,000	
	24-3 神戸市 20 年	100,000,000	105,984,900	
	2-2 横浜市公債	100,000,000	96,697,300	
	6 札幌市 20 年	100,000,000	108,035,200	
	2-1 千葉市公債	100,000,000	97,009,300	
地方債証券 合計			5,056,420,277	
特殊債券	47 日本政策投資 CO	100,000,000	101,617,100	
	174 日本政策投資	100,000,000	96,263,500	
	184 日本政策投資	200,000,000	197,873,200	
	79 政保道路機構	100,000,000	107,150,700	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	81 政保道路機構	100,000,000	107,292,800	
	97 政保道路機構	100,000,000	108,061,700	
	143 政保道路機構	200,000,000	214,475,000	
	235 政保道路機構	100,000,000	101,053,000	
	261 政保道路機構	100,000,000	100,132,800	
	321 政保道路機構	100,000,000	99,007,800	
	397 政保道路機構	100,000,000	96,975,900	
	478 政保道路機構	300,000,000	300,000,000	
	23 地方公共団 20	100,000,000	104,766,400	
	F163 地方公共団体	100,000,000	101,265,100	
	F168 地方公共団体	200,000,000	205,951,600	
	3 地方公共団 15 年	100,000,000	101,719,900	
	F231 地方公共団体	100,000,000	101,903,500	
	129 地方公共団体	100,000,000	95,881,200	
	F568 地方公共団体	300,000,000	267,658,800	
	95 日本政策金融	300,000,000	298,254,000	
	4 国際協力銀行 CO	100,000,000	100,139,500	
	127 都市再生	100,000,000	99,040,500	
	80 住宅支援機構	100,000,000	102,478,800	
	47 住宅機構 RMBS	178,212,000	183,879,141	
	92 住宅機構 RMBS	82,502,000	80,513,701	
	100 住宅機構 RMBS	50,469,000	49,192,134	
	120 住宅機構 RMBS	936,530,000	877,247,651	
特殊債券 合計			4,399,795,427	
社債券	33 首都高速道路	300,000,000	297,492,000	
	30 阪神高速道路	200,000,000	198,725,000	
	20 成田国際空港	100,000,000	99,004,800	
	111 東日本高速道	300,000,000	298,032,000	
	101 中日本高速道	200,000,000	198,073,000	
	88 西日本高速道	300,000,000	299,203,500	
	32 大和ハウス工業	100,000,000	99,447,500	
	22 積水ハウス	100,000,000	98,532,000	
	11 サントリーホールデイング	100,000,000	98,571,800	
	3 伊藤園	100,000,000	98,685,300	
	11 ヒユーリツク	100,000,000	99,526,500	
	29 東急不動産 HD	100,000,000	98,521,300	
	14 セブンアンドアイ	100,000,000	99,594,800	
	18 セブンアンドアイ	100,000,000	100,592,200	
	35 東レ	100,000,000	99,654,400	
	57 三井化学	200,000,000	198,397,000	
	16 武田薬品	100,000,000	94,121,500	
	32 住友電工	100,000,000	98,136,600	
	16 クボタ	100,000,000	98,906,400	
	17 パナソニツク	100,000,000	99,499,600	
	40 ソニーG	100,000,000	99,207,700	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	31 トヨタ自動車	100,000,000	96,642,600	
	6 楽天カード	100,000,000	92,562,900	
	4 オリツクス銀行	100,000,000	99,549,300	
	26 りそなホールデイン	100,000,000	98,588,800	
	36 芙蓉総合リース	100,000,000	99,310,500	
	39 芙蓉総合リース	200,000,000	198,158,400	
	5 NTT フアイナンス	100,000,000	94,704,800	
	33 NTT フアイナンス	200,000,000	200,340,000	
	58 日産フイナンシヤル	200,000,000	198,793,800	
	81 ホンダフアイナンス	100,000,000	98,669,200	
	102 トヨタフアイナンス	100,000,000	99,496,300	
	103 トヨタフアイナンス	200,000,000	198,236,800	
	42 リコーリース	100,000,000	98,982,200	
	214 オリツクス	100,000,000	94,993,200	
	1 SOMPOHD	100,000,000	98,884,700	
	7 三井住友海上	100,000,000	98,991,900	
	82 三井不動産	100,000,000	98,391,500	
	80 三菱地所	100,000,000	104,646,700	
	143 三菱地所	100,000,000	97,093,700	
	55 西日本鉄道	200,000,000	198,148,600	
	20 三菱倉庫	100,000,000	98,460,700	
	9 ソフトバンク	100,000,000	98,450,000	
	46 光通信	100,000,000	99,046,300	
	566 中部電力	200,000,000	194,763,600	
	448 中国電力	100,000,000	96,838,500	
	563 東北電力	200,000,000	195,513,800	
	489 九州電力	100,000,000	96,982,500	
	87 電源開発	100,000,000	97,466,300	
	16 JERA	100,000,000	99,123,900	
	65 東京瓦斯	100,000,000	96,002,000	
	50 大阪瓦斯	100,000,000	98,680,800	
	60 ソフトバンクグループ	100,000,000	99,860,700	
社債券 合計			6,808,299,900	
合計			95,247,357,384	

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。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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 284 条及び第 307 条の規定により、「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(2024 年 6 月 6 日から 2024 年 12 月 5 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。

独立監査人の中間監査報告書

2025 年 1 月 31 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	秋山　範之
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」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス３０の2024年6月6日から2024年12月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス３０の2024年12月5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（2024年6月6日から2024年12月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚

偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

ダイワ・ライフ・バランス３０

(1)【中間貸借対照表】

		当中間計算期間末 2024年12月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		146,989,841
親投資信託受益証券		29,396,111,402
未収入金		7,509,000
流動資産合計		29,550,610,243
資産合計		29,550,610,243
負債の部		
流動負債		
未払解約金		36,483,151
未払受託者報酬		4,817,458
未払委託者報酬		24,087,464
その他未払費用		1,096,745
流動負債合計		66,484,818
負債合計		66,484,818
純資産の部		
元本等		
元本	※1	14,421,178,334
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）		15,062,947,091
（分配準備積立金）		4,762,711,605
元本等合計		29,484,125,425
純資産合計		29,484,125,425
負債純資産合計		29,550,610,243

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 日 金　額（円）
営業収益	
受取利息	112,977
有価証券売買等損益	267,455,240
営業収益合計	267,568,217
営業費用	
受託者報酬	4,817,458
委託者報酬	24,087,464
その他費用	1,096,745
営業費用合計	30,001,667
営業利益又は営業損失（△）	237,566,550
経常利益又は経常損失（△）	237,566,550
中間純利益又は中間純損失（△）	237,566,550
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（△）	843,993
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,524,549,651
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,213,278,636
中間追加信託に伴う剰余金増加額 　又は欠損金減少額	1,213,278,636
剰余金減少額又は欠損金増加額	911,603,753
中間一部解約に伴う剰余金減少額 　又は欠損金増加額	911,603,753
中間剰余金又は中間欠損金（△）	15,062,947,091

(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 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 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 2024 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首元本額	14,133,783,401 円
期中追加設定元本額	1,174,206,588 円
期中一部解約元本額	886,811,655 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	14,421,178,334 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 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 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 2024 年 12 月 5 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 2024 年 12 月 5 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 2024年12月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0445円 (20,445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、「外国債券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

		2024年12月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		25,267,695,019
株式	※2※3	395,492,628,010
派生商品評価勘定		283,642,450
未収入金		7,080,000
未収配当金		991,150,345
その他未収収益	※4	24,677,930
差入委託証拠金		229,675,975
流動資産合計		422,296,549,729
資産合計		422,296,549,729
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		557,650
前受金		299,600,600
未払解約金		352,937,670
未払利息		3,286,674
受入担保金		13,876,837,399
流動負債合計		14,533,219,993
負債合計		14,533,219,993
純資産の部		
元本等		
元本	※1	202,464,214,380
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		205,299,115,356
元本等合計		407,763,329,736
純資産合計		407,763,329,736
負債純資産合計		422,296,549,729

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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	2024 年 12 月 5 日現在
1.　※1 期首	2024 年 6 月 6 日
期首元本額	178,188,938,492 円
期中追加設定元本額	33,899,233,048 円
期中一部解約元本額	9,623,957,160 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックスファンド	2,776,825,902 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	3,752,108,841 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	904,872 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	8,959,470 円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	131,983,541 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	11,283,120 円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	308,334,441 円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,175,871,836 円

区分	2024年12月5日現在
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）	863,302,269円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	963,731,047円
Ｄ－Ｉ’ｓ ＴＯＰＩＸインデックス	11,681,143円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	251,419,479円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	9,919,705,075円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,204,346,385円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,226,728,690円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	4,383,167円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	73,219,077,877円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,982,860,584円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,202,179,173円
ダイワ・ライフ・バランス７０	6,250,059,066円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,593,151,924円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	49,772,395円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	76,847,932円
ダイワつみたてインデックス日本株式	6,558,240,405円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,566,747円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	14,112,652円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	79,475,135円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	23,629,223,700円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	47,104,361円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	19,806,181円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,993,395,102円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	280,994,393円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	39,319,630円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	55,931,105円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	236,064,274円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	15,450,137,617円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	14,913,683,077円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,527,748,825円
スタイル９（4資産分散・保守型）	866,864円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	6,091,396円
スタイル９（4資産分散・積極型）	8,614,015円
スタイル９（6資産分散・保守型）	365,916円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	11,207,988円
スタイル９（6資産分散・積極型）	12,772,303円
スタイル９（8資産分散・保守型）	577,437円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	9,088,739円
スタイル９（8資産分散・積極型）	27,274,055円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	4,999,907円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	991,148,651円
ダイワライフスタイル２５	93,262,550円
ダイワライフスタイル５０	433,705,855円

区分	2024年12月5日現在
ダイワライフスタイル７５	379,919,302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）	7,640,997,969円
計	202,464,214,380円
2. 期末日における受益権の総数	202,464,214,380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　13,091,752,810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　1,031,390,000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	2024年12月5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	2024年12月5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				

種類	2024年12月5日現在			
	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
買建	11,660,895,400	－	11,944,220,000	283,324,600
合計	11,660,895,400	－	11,944,220,000	283,324,600

(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)

	2024年12月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0140円 (20,140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

	2024年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,056,795,404
コール・ローン	15,491,292,014
株式	647,530,208,137
投資証券	12,701,778,115
派生商品評価勘定	691,733,156
未収入金	271,234,720
未収配当金	684,506,256
差入委託証拠金	8,446,184,680
流動資産合計	686,873,732,482
資産合計	686,873,732,482
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	65,972,797
未払金	351,019,600
未払解約金	900,469,800
流動負債合計	1,317,462,197
負債合計	1,317,462,197
純資産の部	
元本等	
元本　※1	97,264,398,837
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	588,291,871,448
元本等合計	685,556,270,285
純資産合計	685,556,270,285
負債純資産合計	686,873,732,482

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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。

区分	自 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 日
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024 年 12 月 5 日現在
1.　※1 期首	2024 年 6 月 6 日
期首元本額	87,479,090,223 円
期中追加設定元本額	14,258,094,261 円
期中一部解約元本額	4,472,785,647 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	219,275,512 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	1,350,771 円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	15,943,925 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	3,401,571 円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	86,699,466 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）	115,538,162 円
ダイワバランスファンド 2023-01（適格機関投資家専用）	78,362,997 円
外国株式インデックスファンド VA（適格機関投資家専用）	8,658,395,848 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）	762,152,648 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）	5,927,427,003 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）	574,783,722 円
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国株式インデックス	16,129,330 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	46,233,196 円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	9,730,874,596 円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,526,183,061 円

区分	2024年12月5日現在
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	348,256,632円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	18,626,164円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	51,374,210,127円
ダイワ・ライフ・バランス３０	436,137,248円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,020,728,710円
ダイワ・ライフ・バランス７０	998,847,599円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,110,971,720円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	9,675,973円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	11,211,512円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,844,156,532円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,783,392円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	12,636,137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）	15,823,612円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	40,010,033円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	28,225,334円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	634,015,845円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	33,701,276円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	123,320,896円
スタイル９（4資産分散・保守型）	323,801円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	2,285,324円
スタイル９（4資産分散・積極型）	3,279,999円
スタイル９（6資産分散・保守型）	136,016円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	4,188,679円
スタイル９（6資産分散・積極型）	4,849,433円
スタイル９（8資産分散・保守型）	191,623円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	3,005,545円
スタイル９（8資産分散・積極型）	9,456,692円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,217,076,486円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	427,479,088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）	5,215,097,131円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,255,477,076円
ダイワライフスタイル２５	6,740,978円
ダイワライフスタイル５０	31,688,743円
ダイワライフスタイル７５	27,235,788円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	78,106,048円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	75,686,081円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	74,388,492円
計	97,264,398,837円
2. 期末日における受益権の総数	97,264,398,837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	2024年12月5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	2024年12月5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	24,405,327,617	－	25,022,328,556	617,000,939
合計	24,405,327,617	－	25,022,328,556	617,000,939

(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	2024年12月5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	14,340,634,910	－	14,349,394,330	8,759,420
アメリカ・ドル	8,530,772,560	－	8,546,042,800	15,270,240
イギリス・ポンド	1,137,791,200	－	1,140,204,000	2,412,800
オーストラリア・ドル	640,598,760	－	634,819,020	△5,779,740
カナダ・ドル	1,684,966,500	－	1,682,110,660	△2,855,840
スイス・フラン	1,274,665,790	－	1,274,660,250	△5,540
ユーロ	1,071,840,100	－	1,071,557,600	△282,500
合計	14,340,634,910	－	14,349,394,330	8,759,420

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	7.0484円 （70,484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

	2024年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,583,529,252
コール・ローン	1,442,257,007
国債証券	320,478,626,286
派生商品評価勘定	1,395,509
未収入金	73,529
未収利息	2,339,965,754
前払費用	131,446,062
流動資産合計	332,977,293,399
資産合計	332,977,293,399
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,118,643
未払金	6,216,690,920
未払解約金	344,402,818
流動負債合計	6,562,212,381
負債合計	6,562,212,381
純資産の部	
元本等	
元本　※1	89,419,666,016
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	236,995,415,002
元本等合計	326,415,081,018
純資産合計	326,415,081,018
負債純資産合計	332,977,293,399

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024 年 12 月 5 日現在
1.　※1 期首	2024 年 6 月 6 日
期首元本額	86,486,918,304 円
期中追加設定元本額	8,509,102,010 円
期中一部解約元本額	5,576,354,298 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	324,211,441 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	4,781,204 円

区分	2024年12月5日現在
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	30,452,268円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,033,041円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	166,076,821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）	846,444,734円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	626,758,810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）	968,548,690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）	6,078,893,816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）	1,136,078,450円
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックス	1,848,064円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	22,064,434円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,372,160,192円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,794,633,933円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	658,965,586円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	2,375,142円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51,595,352,012円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,195,099,739円
ダイワ・ライフ・バランス５０	929,852,590円
ダイワ・ライフ・バランス７０	745,880,144円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	742,922,378円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	609,099,071円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	292,333,678円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	36,927,941円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	22,725,316円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,476,156,529円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	5,041,201円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,514,030円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	9,674,973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）	2,520,143,983円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	87,623,017円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	26,313,609円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,417,899,002円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	150,818,032円
スタイル９（4資産分散・保守型）	229,040円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	2,568,720円
スタイル９（4資産分散・積極型）	2,318,334円
スタイル９（6資産分散・保守型）	51,070円

区分	2024年12月5日現在
スタイル９（6資産分散・バランス型）	1,745,035円
スタイル９（6資産分散・積極型）	610,087円
スタイル９（8資産分散・保守型）	80,263円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	1,704,960円
スタイル９（8資産分散・積極型）	1,927,569円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	2,705,214円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	131,650,909円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,617,690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）	4,168,436,286円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,022,035,855円
ダイワライフスタイル２５	25,044,104円
ダイワライフスタイル５０	58,177,404円
ダイワライフスタイル７５	17,059,605円
計	89,419,666,016円
2. 期末日における受益権の総数	89,419,666,016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	2024年12月5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	2024年12月5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				

種類	2024年12月5日現在			
	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
買建	1,019,996,427	－	1,020,273,293	276,866
アメリカ・ドル	144,498,907	－	144,746,362	247,455
イギリス・ポンド	23,424,418	－	23,567,192	142,774
オフショア・人民元	480,028,249	－	479,744,276	△283,973
カナダ・ドル	38,156,338	－	38,010,504	△145,834
スウェーデン・クローナ	11,630,489	－	11,641,344	10,855
ニュージーランド・ドル	52,620,253	－	52,188,045	△432,208
ノルウェー・クローネ	25,831,178	－	25,903,605	72,427
メキシコ・ペソ	108,926,260	－	108,941,125	14,865
ユーロ	134,880,335	－	135,530,840	650,505
合計	1,019,996,427	－	1,020,273,293	276,866

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年12月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6504円 (36,504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

	2024年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	187,324,249
国債証券	84,947,152,980
地方債証券	4,925,610,999
特殊債券	4,334,569,912
社債券	6,981,657,800
未収利息	183,270,837
前払費用	16,154,108
流動資産合計	101,575,740,885
資産合計	101,575,740,885
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,166,107
流動負債合計	4,166,107
負債合計	4,166,107
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	85,238,293,964
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,333,280,814
元本等合計	101,571,574,778
純資産合計	101,571,574,778
負債純資産合計	101,575,740,885

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2024 年 6 月 6 日 至 2024 年 12 月 5 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	2024 年 12 月 5 日現在
1.　※1 期首	2024 年 6 月 6 日
期首元本額	79,534,327,542 円
期中追加設定元本額	6,862,920,538 円
期中一部解約元本額	1,158,954,116 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）	4,226,977,118 円
日本債券インデックスファンド VA（適格機関投資家専用）	32,149,647,151 円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	2,702,200,399 円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	8,611,169,477 円
ダイワ・ライフ・バランス３０	13,387,016,047 円
ダイワ・ライフ・バランス５０	11,384,257,934 円
ダイワ・ライフ・バランス７０	4,577,241,666 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	2,289,173,313 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,874,714,626 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	905,155,228 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,740,371,039 円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	57,073,919 円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	31,138,748 円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	59,173,317 円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	194,032,014 円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	48,951,968 円
計	85,238,293,964 円

区分	2024年12月5日現在
2.　期末日における受益権の総数	85,238,293,964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	2024年12月5日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年12月5日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2024年12月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1916円 （11,916円）

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	29,838,921,913円
Ⅱ	負債総額	21,967,566円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	29,816,954,347円
Ⅳ	発行済数量	14,431,073,088口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0662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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	431,783,605,199円
Ⅱ	負債総額	14,239,153,946円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	417,544,451,253円
Ⅳ	発行済数量	203,873,244,351口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0481円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	102,185,492,452円
Ⅱ	負債総額	6,329,547円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	102,179,162,905円
Ⅳ	発行済数量	85,749,137,564口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1916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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	708,622,749,220 円
Ⅱ	負債総額	625,196,470 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	707,997,552,750 円
Ⅳ	発行済数量	97,816,242,760 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	7.2380 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

2024 年 12 月 30 日

Ⅰ	資産総額	337,607,885,211 円
Ⅱ	負債総額	45,678,812 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	337,562,206,399 円
Ⅳ	発行済数量	89,726,141,857 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7621 円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

(5) 受益権の譲渡
① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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

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

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

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2024 年 12 月末日現在

資本金の額　　414 億 2,454 万 1,896 円

発行可能株式総数　799 万 9,980 株

発行済株式総数　　326 万 657 株

過去 5 年間における資本金の額の増減：2024 年 10 月 1 日 262 億 5,026 万 9,396 円増加しました。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2024 年 12 月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	91	340,875
追加型株式投資信託	791	30,692,916
株式投資信託　　合計	882	31,033,791
単位型公社債投資信託	77	144,018
追加型公社債投資信託	14	1,440,104
公社債投資信託　合計	91	1,584,122
総合計	973	32,617,913

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、「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282条及び第306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。

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65期事業年度（2023年４月１日から2024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66期事業年度に係る中間会計期間（2024年４月１日から2024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る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。

独立監査人の監査報告書

2024年５月27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	渡部　啓太

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2023年４月１日から2024年３月31日までの第65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2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年５月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注) 1.　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2.　XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (2023年３月31日)		当事業年度 (2024年３月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,982		4,813
有価証券		346		503
前払費用		393		481
未収委託者報酬		12,525		16,513
未収収益		47		78
関係会社短期貸付金		22,100		23,400
その他		59		88
流動資産計		37,455		45,878
固定資産				
有形固定資産	※1	196	※1	176
建物		3		2
器具備品		193		174
無形固定資産		1,482		1,342
ソフトウェア		1,351		1,063
ソフトウェア仮勘定		131		279
投資その他の資産		13,824		13,660
投資有価証券		8,260		8,448
関係会社株式		3,475		3,475
出資金		177		177
長期差入保証金		1,066		1,021
繰延税金資産		824		524
その他		20		12
固定資産計		15,503		15,180
資産合計		52,959		61,058

（単位:百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）		当事業年度 （2024年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		101		158
未払金		5,874		6,187
未払収益分配金		38		39
未払償還金		12		12
未払手数料		4,525		5,849
その他未払金	※2	1,297	※2	285
未払費用		3,987		5,035
未払法人税等		560		3,842
未払消費税等		327		872
賞与引当金		692		1,048
その他		2		1
流動負債計		11,545		17,146
固定負債				
退職給付引当金		2,276		2,227
役員退職慰労引当金		51		62
その他		0		－
固定負債計		2,329		2,289
負債合計		13,874		19,435
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		11,505		13,048
利益剰余金合計		11,879		13,422
株主資本合計		38,549		40,092
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		534		1,530
評価・換算差額等合計		534		1,530
純資産合計		39,084		41,623
負債・純資産合計		52,959		61,058

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048
福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	286	220
受取配当金	25	40
有価証券償還益	150	32
その他	146	93
営業外収益計	608	388
営業外費用		
有価証券償還損	2	196
投資有価証券売却損	244	1
その他	31	18
営業外費用計	277	215
経常利益	15,642	17,540
特別損失		
システム刷新関連費用	－	153
投資有価証券評価損	257	132
関係会社整理損失	229	－
特別損失計	486	286
税引前当期純利益	15,155	17,253
法人税、住民税及び事業税	4,589	5,533
法人税等調整額	248	△139
法人税等合計	4,838	5,394
当期純利益	10,317	11,859

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	－	－	－	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	971	971	41,941
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 12,737
当期純利益	－	－	10,317
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 436	△ 436	△ 436
当期変動額合計	△ 436	△ 436	△ 2,856
当期末残高	534	534	39,084

当事業年度（自　2023年４月１日 至　2024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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	－	－	－	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	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	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 10,316
当期純利益	－	－	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

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の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員及び参与についても当事業年度末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（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」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の 100 分の 10 を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」のその他に表示していた 171 百万円は、「受取配当金」25 百万円、「その他」146 百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2023 年３月 31 日）	当事業年度 （2024 年３月 31 日）
建物	38 百万円	39 百万円
器具備品	296 百万円	308 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 （2023 年３月 31 日）	当事業年度 （2024 年３月 31 日）
未払金	1,178 百万円	236 百万円

３　保証債務

前事業年度（2023 年３月 31 日）

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務 2,112 百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2024 年３月 31 日）

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務 2,354 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　2022年４月１日　至　2023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
2022年６月23日 定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年 ３月31日	2022年 ６月24日

（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

2023 年６月 26 日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①剰余金の配当の総額　10,316百万円
②配当の原資　利益剰余金
③１株当たり配当額　3,955円
④基準日　2023年３月31日
⑤効力発生日　2023年６月27日

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024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
2023年６月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 ３月31日	2023年 ６月27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

2024 年６月 19 日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①剰余金の配当の総額　11,858百万円
②配当の原資　利益剰余金
③１株当たり配当額　4,546円
④基準日　2024年３月31日
⑤効力発生日　2024年６月20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グループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ⅱ）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。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（2023 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
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	－	7,939
資産合計	57	7,882	－	7,939

当事業年度（2024 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
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	－	8,285
資産合計	144	8,141	－	8,285

（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

有価証券及び投資有価証券
株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。

（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	666	666
子会社株式	1,448	1,448
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（2023年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,448百万円）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（2024年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,448百万円）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（2023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	57	55	1
（２）その他	5,084	3,923	1,161
小計	5,141	3,978	1,163
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,798	3,190	△392
小計	2,798	3,190	△392
合計	7,939	7,168	△771

（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（2024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	144	55	89
（２）その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	△213
小計	1,543	1,756	△213
合計	8,285	6,079	2,205

（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　2022年４月１日　至　2023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	2,359	296	244
合計	2,359	296	244

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024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	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

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257百万円、関係会社株式について229百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、証券投資信託について132百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

（１）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,399百万円	2,276百万円
勤務費用	150	138
退職給付の支払額	△ 322	△ 266
その他	48	78
退職給付債務の期末残高	2,276	2,227

（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　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,276 百万円	2,227 百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,276	2,227
退職給付引当金	2,276	2,227
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,276	2,227

（３）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
勤務費用	150 百万円	138 百万円
その他	153	9
確定給付制度に係る退職給付費用	303	147

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

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184百万円、当事業年度187百万円であります。

（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 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262
投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	△ 459	△ 486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 356	△ 740
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 515	△ 899
繰延税金資産の純額	824	524

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（2023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（2024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。

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社はグループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021年８月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

（１）　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 76,221 百万円、その他 717 百万円であります。

（２）　収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024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　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	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（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	17,100 0	関係会社短期貸付金 －	22,100 －

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	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（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	11,100 0	関係会社短期貸付金 －	23,400 －

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　2022 年４月１日　至　2023 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）	2,112	－	－

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　2023年４月１日　至　2024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）	2,354	－	－

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　2022年４月１日　至　2023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	証券投資信託の代行手数料（注2）	13,072	未払手数料	2,663
						本社ビルの管理	不動産の賃借料（注3）	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注３）差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

（注４）ソフトウェアの購入・保守については、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。

当事業年度（自　2023 年４月１日　至　2024 年３月 31 日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注２） 不動産の賃借料（注３）	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注４）	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注３）　差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

（注４）　ソフトウェアの購入・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）		当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）	
１株当たり純資産額	14,983.42円	１株当たり純資産額	15,956.63円
１株当たり当期純利益	3,955.35円	１株当たり当期純利益	4,546.57円

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

（注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,317	11,859
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）
（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議いたしました。条件等は次のとおりであります。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式　652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込期日	2024年7月1日（予定）
資金の使途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

独立監査人の中間監査報告書

2024 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	渡部　啓太
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	松田　好弘

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2024年４月１日から2025年３月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年４月１日から2024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2024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（2024年４月１日から2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年10月１日付で株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を実施している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の

執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注) 1.　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2.　XBRL データは監査の対象には含まれていません。

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 （2024年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,555
有価証券		1,271
未収委託者報酬		18,273
関係会社短期貸付金		16,900
その他		916
流動資産合計		41,916
固定資産		
有形固定資産	※１	60
無形固定資産		
ソフトウエア		878
その他		346
無形固定資産合計		1,225
投資その他の資産		
投資有価証券		9,666
関係会社株式		3,414
繰延税金資産		748
その他		1,095
投資その他の資産合計		14,924
固定資産合計		16,211
資産合計		58,128

（単位：百万円）

		当中間会計期間 （2024年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		6,580
未払費用		5,540
未払法人税等		4,405
賞与引当金		910
その他	※２	1,107
流動負債合計		18,545
固定負債		
退職給付引当金		2,270
役員退職慰労引当金		55
固定負債合計		2,325
負債合計		20,870
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		8,774
利益剰余金合計		9,148
株主資本合計		35,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,438
評価・換算差額等合計		1,438
純資産合計		37,257
負債・純資産合計		58,128

（２）中間損益計算書

（単位：百万円）

		当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		44,508
その他営業収益		483
営業収益合計		44,992
営業費用		
支払手数料		18,092
その他営業費用		9,300
営業費用合計		27,392
一般管理費	※１	6,708
営業利益		10,890
営業外収益	※２	281
営業外費用	※３	21
経常利益		11,150
特別利益	※４	491
特別損失	※５	154
税引前中間純利益		11,487
法人税、住民税及び事業税		4,086
法人税等調整額		△183
中間純利益		7,584

（３）中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2024 年４月１日 至　2024 年９月 30 日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当中間期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△11,858	△11,858	△11,858
中間純利益	－	－	－	7,584	7,584	7,584
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	－	－	－	△4,274	△4,274	△4,274
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,774	9,148	35,818

	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	1,530	1,530	41,623
当中間期変動額			
剰余金の配当	－	－	△11,858
中間純利益	－	－	7,584
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△91	△91	△91
当中間期変動額合計	△91	△91	△4,365
当中間期末残高	1,438	1,438	37,257

注記事項
（重要な会計方針）

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

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

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

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

建物	10～18年
器具備品	４～20年

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

３．引当金の計上基準
（１）賞与引当金
役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

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

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

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

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

５．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用しておりましたが、2024 年 10 月 1 日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の 100％子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 (2024 年９月 30 日現在)
有形固定資産	358百万円

※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（2024年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万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　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
投資有価証券売却益	184百万円
有価証券償還益	45百万円
受取配当金	27百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
為替差損	17百万円

※４　特別利益の項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
投資有価証券売却益	380百万円
固定資産売却益	
美術品	83百万円
ゴルフ会員権	26百万円

※５　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
固定資産売却損	
美術品	85百万円
ゴルフ会員権	15百万円
投資有価証券評価損	53百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024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
2024年６月19日定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年３月31日	2024年６月20日

（金融商品関係）
当中間会計期間（2024年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	1,602	8,991	－	10,594
資産合計	1,602	8,991	－	10,594

（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、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

有価証券及び投資有価証券

市場で取得した株式及び上場投資信託は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。当社が保有している証券投資信託のうちレベル１の時価を採用しているもの以外は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。

（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	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2024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　1,386百万円）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	123	55	67
（２）その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
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	3,756	3,988	△232
小計	3,756	3,988	△232
合計	10,594	8,520	2,073

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　342百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 44,508 百万円、その他 483 百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日 至　2024年９月30日）	
１株当たり純資産額	14,283.03円
１株当たり中間純利益	2,907.52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おりません。

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
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）

（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

2024年5月15日開催の株主総会及び2024年6月27日開催の臨時株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行について決議し、2024年10月1日付で払込手続きが完了いたしました。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式　652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込日	2024年10月1日
資金の使途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100％
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80％ 株式会社かんぽ生命保険：20％

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

５【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2024 年 5 月 15 日、株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携を締結し、本提携に基づき 2024 年 10 月 1 日、かんぽ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたしました。

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。

追加型証券投資信託

（ダイワ・ライフ・バランス３０）

約　　款

大和アセットマネジメント株式会社

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 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（配当込み））
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）
3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
（ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース））
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

(2) 投資態度

①　主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

②　各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券　……　信託財産の純資産総額の20％
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券
……　信託財産の純資産総額の55％
外国株式インデックスマザーファンド受益証券　……　信託財産の純資産総額の10％
外国債券インデックスマザーファンド受益証券　……　信託財産の純資産総額の15％

③　保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

④　保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

⑤　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。

イ．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
ロ．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
ハ．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

⑥　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。

(3) 投資制限

①　株式への投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

② 新株引受権証券等への投資制限

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③ 投資信託証券への投資制限

投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑤ 同一銘柄の転換社債等への投資制限

同一銘柄の転換社債、ならびに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への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥ 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

⑦ 有価証券先物取引等の範囲

有価証券先物取引等は、約款第22条の範囲で行ないます。

⑧ スワップ取引の範囲

スワップ取引は、約款第23条の範囲で行ないます。

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引の範囲

金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第24条の範囲で行ないます。

３．収益分配方針

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
（ダイワ・ライフ・バランス３０）
約　　款

（信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託）
第 1条　この信託は、証券投資信託であり、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ます。
②　この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
③　受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
④　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。
（信託の目的および金額）
第 2条　委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。
（信託金の限度額）
第 3条　委託者は、受託者と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
②　追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。
③　委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。
（信託期間）
第 4条　この信託の期間は、信託契約締結日から第49条第1項、第50条第1項、第51条第1項および第53条第2項の規定による信託終了日までとします。
（受益権の取得申込の勧誘の種類）
第 5条　この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。
（当初の受益者）
第 6条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。
（受益権の分割および再分割）
第 7条　委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。
②　委託者は、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところに従い、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。
（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）
第 8条　追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。
②　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。
③　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。
④　第29条に規定する予約為替の評価は、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。
（信託日時の異なる受益権の内容）
第 9条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。
（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第10条　この信託の受益権は、2007年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

②　委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者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　委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）に当該申請の手続を委任することができます。

（受益権の設定にかかる受託者の通知）

第11条　受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位および価額）

第12条　委託者は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。

②　指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される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口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従って契約（以下「積立投資契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1円以上1円単位または1口以上1口単位をもって取得の申込に応じることができるものとします。

③　前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、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。

④　第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤　前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）
第12条の2　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
②　前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
③　委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。
（受益権の譲渡の対抗要件）
第12条の3　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。
第13条　（削　　除）
第14条　（削　　除）
第15条　（削　　除）
（投資の対象とする資産の種類）
第16条　この信託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、約款第22条、第23条および第24条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
（有価証券および金融商品の指図範囲等）
第17条　委託者は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の第1号から第4号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、ならびに次の第5号から第24号までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1.　トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2.　ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3.　外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
4.　外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
5.　株券または新株引受権証書
6.　国債証券
7.　地方債証券
8.　特別の法律により法人の発行する債券
9.　社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10.　特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11.　特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12.　協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13.　特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引

法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
18. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第20号の証券または証書のうち第5号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、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第20号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（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。

② 委託者は、信託金を、前項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号の権利の性質を有するもの

③ 委託者は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の

100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑧　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第17条の2　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第30条において同じ。）、第30条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条ならびに第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。

②　前項の取扱いは、第21条から第24条まで、第26条、第29条、第34条から第36条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第18条　委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

（投資する株式等の範囲）

第19条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②　前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限）

第20条　委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信用取引の指図範囲）

第21条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

②　前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図および範囲）

第22条　委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

③ 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

（スワップ取引の運用指図および範囲）

第23条　委託者は、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。

② 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、第4条に定める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。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみ

なした額との合計額（以下本項において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

④　前項においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤　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。

⑥　委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲）

第24条　委託者は、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。

②　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、第4条に定める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。

③　金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

④　前項においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤　為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

⑥　前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦　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。

⑧　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

（デリバティブ取引等にかかる投資制限）
第24条の2　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
（同一銘柄の転換社債等への投資制限）
第25条　委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
（有価証券の貸付けの指図および範囲）
第26条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50％を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
③　委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。
（外貨建資産への投資制限）
第27条　委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。
②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）
第28条　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。
（外国為替予約取引の指図）
第29条　委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
（信用リスク集中回避のための投資制限）
第29条の2　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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
（信託業務の委託等）
第30条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。
1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第31条 （削　　除）

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、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。

② 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。

③ 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。

④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第37条 委託者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、すべて受益者に帰属し

ます。
（受託者による資金の立替え）
第38条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
③　前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。
（信託の計算期間）
第39条　この信託の計算期間は、毎年6月6日から翌年6月5日までとします。
②　前項の規定にかかわらず、前項の規定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。
（信託財産に関する報告）
第40条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
（信託事務の諸費用および監査報酬）
第41条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
②　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。
（信託報酬等の額および支弁の方法）
第42条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の18の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ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。
③　第1項の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。
（収益の分配方式）
第43条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。
第44条　（削　　除）
（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）
第45条　収益分配金は、毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。
②　前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、

受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、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指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③　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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。

④　一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。

⑤　前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。

⑥　収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第46条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②　受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第47条　受益者が、収益分配金については第45条第1項に規定する支払開始日から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第45条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第48条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として委託者または指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

②　委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約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この信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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　前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

④　2007年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、2007年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、2007年1月4日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

⑤　委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。

⑥　前項により一部解約請求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一部解約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請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第48条の2　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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

（信託契約の解約）

第49条　委託者は、信託期間中において、この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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②　委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

⑤　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

⑥　第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第50条　委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

②　委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第54条の規定に従います。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第51条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

②　前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第54条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第52条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第53条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第54条の規定に従い、新受託者を選任します。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

（信託約款の変更）

第54条　委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述

べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

（反対者の買取請求権）

第55条　第49条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第49条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第55条の2　委託者は、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の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

（公告）

第56条　委託者が受益者に対してする公告は、2008年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、2008年7月1日以降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　2008年7月1日以降において、前項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。

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第57条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（付　　則）

第 1条　この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条　第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条　2006年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の再交付）から第15条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第 4条　第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 5条　第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の

数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

2005年 6月 6日

委託者　　大和アセットマネジメント株式会社

受託者　　三井住友信託銀行株式会社