DCダイワ・ターゲットイヤー2030

追加型投信／内外／資産複合

※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3月12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「DCダイワ・ターゲットイヤー2030」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3月11日に関東財務局長に提出しており、2025年3月12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

◇TSM0372720250312◇

第一部【証券情報】

⑴【ファンドの名称】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030

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】

10 兆円を上限とします。

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。

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】

1 円以上 1 円単位

⑺【申込期間】

2025 年 3 月 12 日から 2025 年 9 月 11 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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信 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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 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　資産配分変更型 （株式、債券、不動産投信）） 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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注１）商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ

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

（注 2）属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの

	格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）	目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの
投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッ	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

ジ		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 兆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、債券、リートおよび短期金融資産に投資し、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

●当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減（ぜんげん）させ、債券の組入れを漸増（ぜんぞう）させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2030年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

〈2024年12月時点の基本配分比率〉

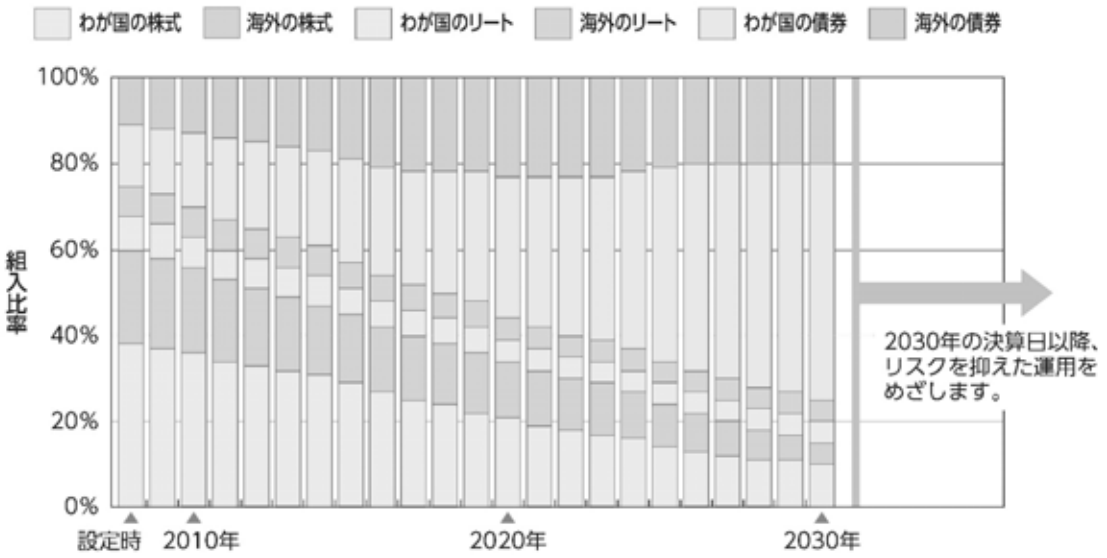
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	16%	11%	5%	5%	41%	22%

〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

※上記基本配分比率における「わが国の債券」の比率には、「わが国の短期債券および短期金融資産」の比率を含みます。
※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



（注1）2024年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2023年以前は過去の基本配分比率を示しています。

（注2）解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。

（注3）組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。

（注4）投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

2 わが国の株式への投資にあたっては、投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

●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、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。

(a) 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。

(b) 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。

(c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス

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。ベンチマークである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っています。

(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。

3 海外の株式への投資にあたっては、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います。

運用プロセス

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。ベンチマークである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っています。

（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 わが国のリートへの投資にあたっては、「東証REIT指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用プロセス

- 組入銘柄はベンチマークである「東証REIT指数」（配当込み）の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。
- 組入銘柄それぞれの時価総額に応じた投資比率に基づきポートフォリオを構築することを基本とします。
- ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があれば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。

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

東証REIT指数とは

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

配当込み東証REIT指数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。

5 海外のリートへの投資にあたっては、ベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用プロセス

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてベンチマークであるS＆P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の構成銘柄の全てに投資することをめざします。

ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

- 運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

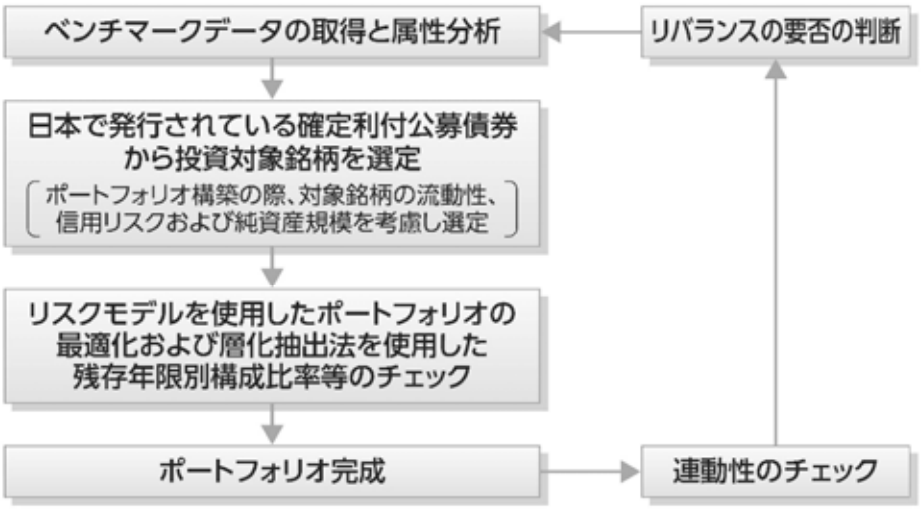
S＆P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

S&P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

6 わが国の債券への投資にあたっては、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て運用を行ないます。

運用プロセス



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である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、ベンチマーク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、ベンチマーク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。

・運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額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、ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の信託財産の純資産総額を超えることがあります。

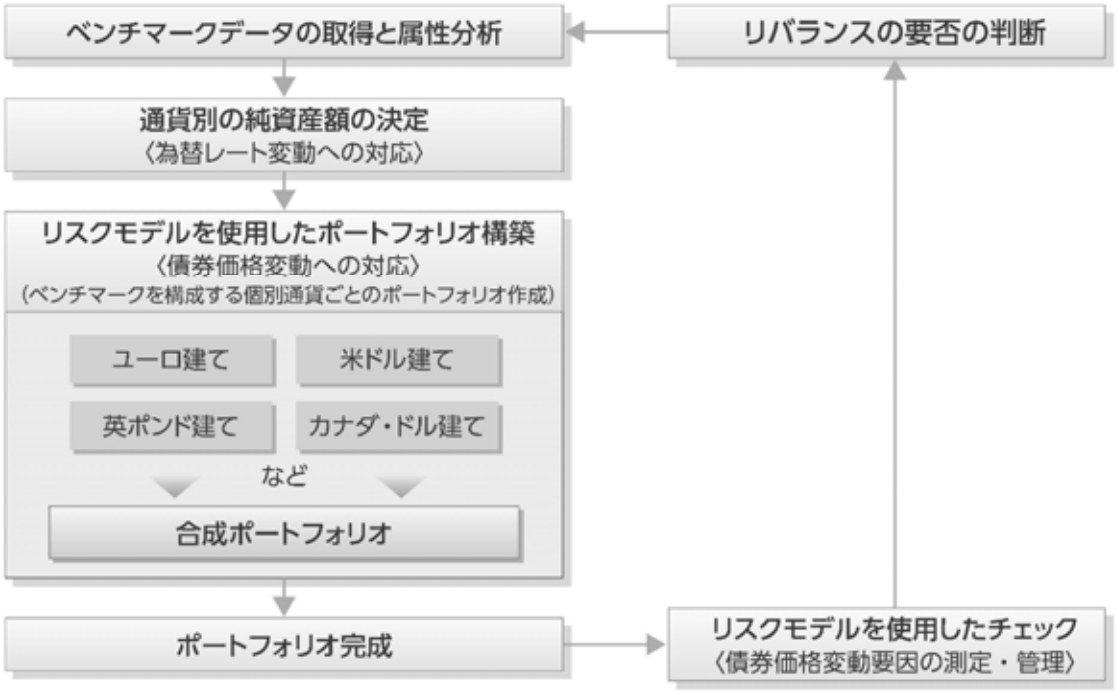
NOMURA－BPI総合指数とは

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。

7 海外の債券への投資にあたっては、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

運用プロセス



ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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に、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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に、リスクモデル(注)を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理

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、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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っています。

（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しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、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を測定・管理する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。

8 2030年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

●わが国の短期債券への投資にあたっては、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数とは

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総合には、債券の残存期間別に短期・中期・長期などのサブ・インデックスがあり、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期(ＮＯＭＵＲＡ－ボンド・パフォーマンス・インデックス総合短期)は、残存期間１年以上３年未満の短期の公募利付債市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の銘柄採用基準に基づいて構成された債券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。

ファンドの仕組み

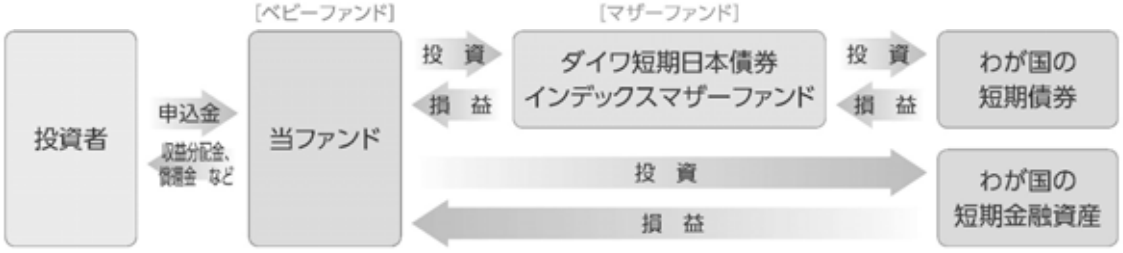
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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。

〈2030年の決算日前日まで〉

※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈2030年の決算日から〉



・為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

・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.～8.の運用が行なわれないことがあります。

9 当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

10 毎年12月18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。
収益分配金は、自動的に再投資されます。

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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
●株式への直接投資は、行ないません。
●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

(2)【ファンドの沿革】

2008年2月28日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金(※3)	
お取扱窓口	販売会社	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	内外の株式・債券・リート（ＲＥＩＴ）および短期金融資産　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）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
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目 9 番 1 号	株 2,608,525	% 80.00
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	株 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。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券
4. ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
5. 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
6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030 年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

当初設定時の基本配分比率

トピックス･インデックス･マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の 38%
外国株式インデックスマザーファンドの受益証券　　……信託財産の純資産総額の 22%
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券　　……信託財産の純資産総額の 8%

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
……信託財産の純資産総額の 7%
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
……信託財産の純資産総額の 14%
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の 11%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．2030 年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．外国法人が発行する譲渡性預金証書

4．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。）

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。）

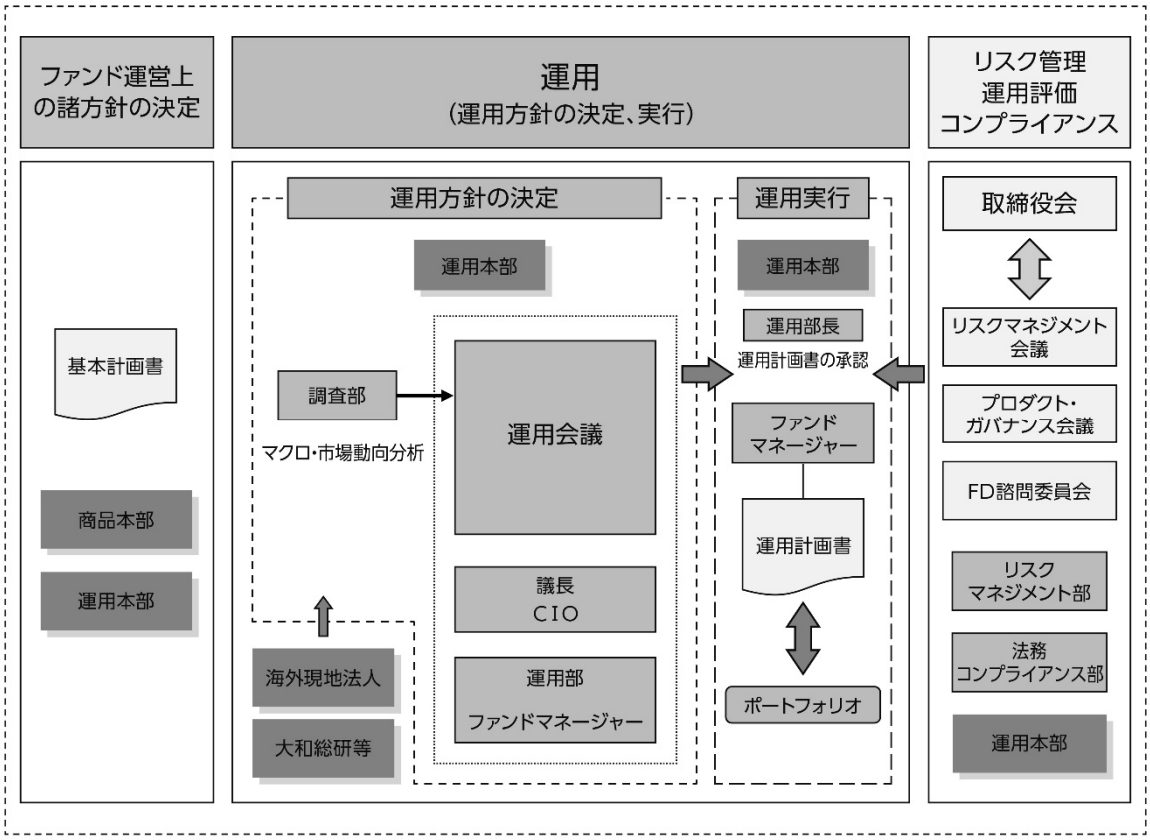
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(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】

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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）

株式への直接投資は、行ないません。

②　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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＞各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　投資態度

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限
① 株式への投資には、制限を設けません。
② 外貨建資産への投資は、行ないません。

２．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針
① 主要投資対象
外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。
② 投資態度
イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（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

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、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。

３．ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

※金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下、「＜参考＞各マザーファンドの概要」において同じ。

② 投資態度

イ.「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ. 投資成果を「東証ＲＥＩＴ指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証

ＲＥＩＴ指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。

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

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

(2) 投資対象

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)⑤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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の投資信託証券

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

④ 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤　先物取引

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

４．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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(3)⑤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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書
6．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

(3) 主な投資制限
①　株式への直接投資は、行ないません。
②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
③　同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が 30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
⑤　先物取引
委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

５．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

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。

６．ダイワ短期日本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

わが国の公社債等（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総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．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、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した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

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、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。
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。

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。

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

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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 リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。

・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。

・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。

・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。

・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

④　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

⑤　その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付けの申込みの受付けを中止することがあります。

②　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。

※　流動性リスクに関する事項

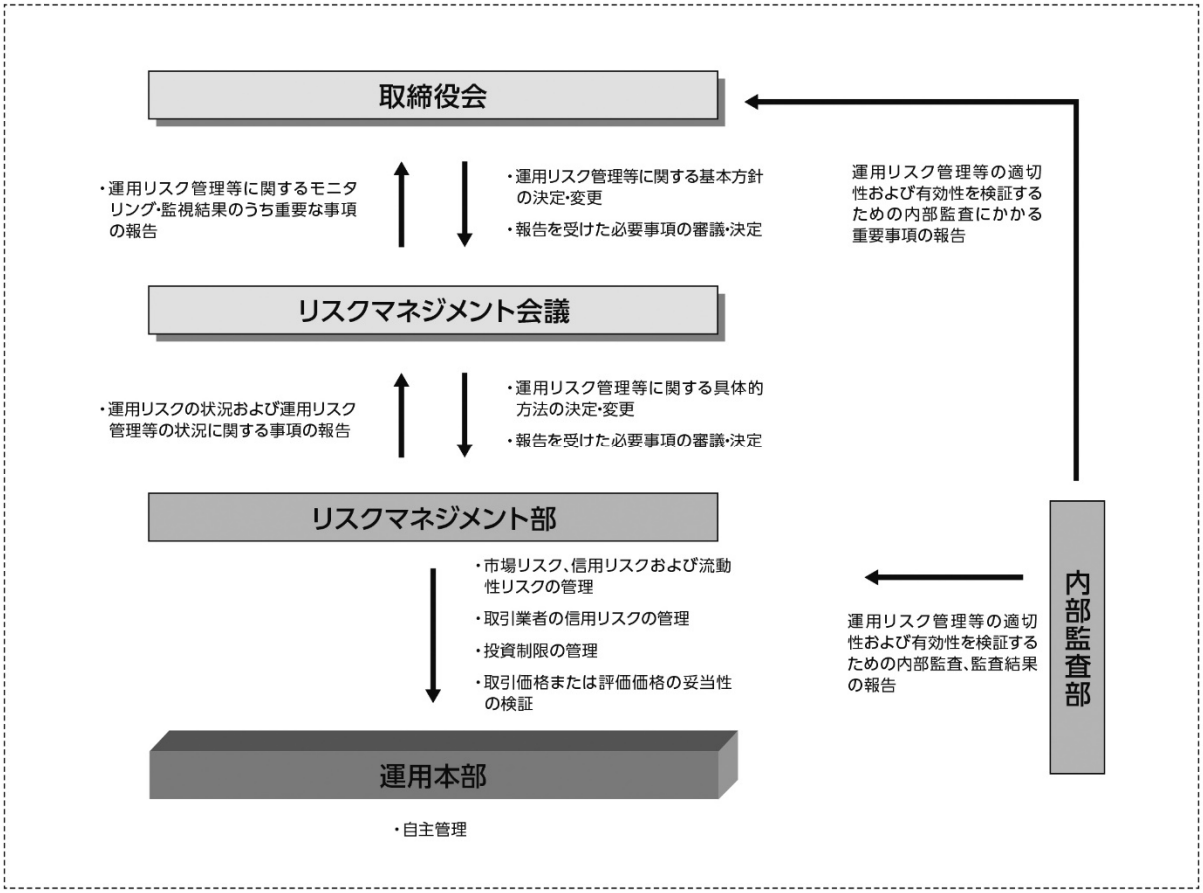
・　当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合

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。

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次の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

	信託報酬率
第1計算期間から2016年3月11日まで	年率0.715%（税抜0.65%）
2016年3月12日から第18計算期間まで	年率0.374%（税抜0.34%）
第19計算期間から第23計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第24計算期間以降	年率0.242%（税抜0.22%）

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。

＜第1計算期間から2016年3月11日まで＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.300% （税抜）	年率0.300% （税抜）	年率0.05% （税抜）

＜2016年3月12日から第18計算期間まで＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.155% （税抜）	年率0.155% （税抜）	年率0.03% （税抜）

＜第19計算期間から第23計算期間まで＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.125% （税抜）	年率0.125% （税抜）	年率0.03% （税抜）

＜第24計算期間以降＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.095% （税抜）	年率0.095% （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（有価証券等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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、所得税および地方税がかかりません。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。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

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）」について

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の対象ではありません。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

＜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		620,523,748	99.81
	内 日本	620,523,748	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,207,109	0.19
純資産総額		621,730,857	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	ダイワ短期日本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	242,906,880	1.0366 251,797,282	1.0367 251,821,562	40.50
2	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	36,693,061	3.6991 135,734,971	3.7621 138,042,964	22.20
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	48,971,311	1.9978 97,835,936	2.0481 100,298,142	16.13
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	9,583,884	7.1468 68,494,103	7.2380 69,368,152	11.16
5	ダイワJ－REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,903,902	3.0409 30,117,156	3.1195 30,895,222	4.97
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,353,279	4.1015 30,159,489	4.0931 30,097,706	4.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.81%
合計	99.81%

(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8計算期間末 (2015年12月18日)	164,118,771	164,118,771	1.3135	1.3135
第9計算期間末 (2016年12月19日)	202,443,979	202,443,979	1.3306	1.3306
第10計算期間末 (2017年12月18日)	229,901,968	229,901,968	1.4390	1.4390
第11計算期間末 (2018年12月18日)	228,565,144	228,565,144	1.3825	1.3825
第12計算期間末 (2019年12月18日)	283,602,330	283,602,330	1.5154	1.5154
第13計算期間末 (2020年12月18日)	266,061,502	266,061,502	1.5414	1.5414
第14計算期間末 (2021年12月20日)	404,356,667	404,356,667	1.6902	1.6902
第15計算期間末 (2022年12月19日)	437,915,846	437,915,846	1.6918	1.6918
第16計算期間末 (2023年12月18日)	553,083,926	553,083,926	1.8448	1.8448
2023年12月末日	557,069,839	－	1.8629	－
2024年1月末日	556,420,715	－	1.9065	－
2月末日	559,072,131	－	1.9341	－
3月末日	578,883,456	－	1.9715	－
4月末日	587,254,618	－	1.9771	－
5月末日	588,552,226	－	1.9841	－
6月末日	584,909,246	－	2.0220	－
7月末日	579,311,294	－	1.9920	－
8月末日	568,534,938	－	1.9734	－
9月末日	579,626,661	－	1.9722	－
10月末日	612,952,219	－	2.0141	－
11月末日	617,038,568	－	2.0010	－
第17計算期間末 (2024年12月18日)	614,313,871	614,313,871	2.0122	2.0122
12月末日	621,730,857	－	2.0328	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

	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
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

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 8 計算期間	4.5
第 9 計算期間	1.3
第 10 計算期間	8.1
第 11 計算期間	△3.9
第 12 計算期間	9.6
第 13 計算期間	1.7
第 14 計算期間	9.7
第 15 計算期間	0.1
第 16 計算期間	9.0
第 17 計算期間	9.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 8 計算期間	55,198,367	20,861,737
第 9 計算期間	51,030,255	23,832,682
第 10 計算期間	51,008,648	43,394,758
第 11 計算期間	37,107,015	31,539,565
第 12 計算期間	41,417,826	19,595,592
第 13 計算期間	62,234,725	76,774,144
第 14 計算期間	114,918,718	48,290,467
第 15 計算期間	78,856,220	59,246,003
第 16 計算期間	88,434,290	47,479,105
第 17 計算期間	78,911,508	73,415,573

（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。

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。

ダイワＪ－ＲＥＩＴ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(%)
投資証券		256,272,413,516	96.55
	内 日本	256,272,413,516	96.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,152,197,159	3.45
純資産総額		265,424,610,675	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)		9,153,200,000	3.45
	内 日本	9,153,200,000	3.45

(注 1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注 2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
(注 3) 不動産投信指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産 (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	日本ビルファンド	日本	投資証券	156,018	135,124.92 21,081,921,045	122,400.00 19,096,603,200	7.19
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	137,377	118,330.10 16,255,834,641	107,900.00 14,822,978,300	5.58
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	138,698	101,068.66 14,018,022,106	90,200.00 12,510,559,600	4.71
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	85,621	151,202.24 12,946,087,280	137,700.00 11,790,011,700	4.44
5	KDX 不動産投資法人	日本	投資証券	74,832	154,542.00 11,564,687,160	149,500.00 11,187,384,000	4.21
6	GLP投資法人	日本	投資証券	89,846	135,128.57 12,140,762,239	123,400.00 11,086,996,400	4.18
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	46,596	267,755.64 12,476,342,176	222,900.00 10,386,248,400	3.91
8	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	147,371	58,073.25 8,558,313,070	66,200.00 9,755,960,200	3.68

	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 (%)
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	39,889	235,181.83 9,381,168,201	231,800.00 9,246,270,200	3.48
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	53,295	155,475.95 8,286,090,852	164,100.00 8,745,709,500	3.29
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	59,401	140,297.92 8,333,836,789	140,800.00 8,363,660,800	3.15
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	26,287	336,149.58 8,836,364,188	292,400.00 7,686,318,800	2.90
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	98,265	68,629.73 6,743,901,313	70,600.00 6,937,509,000	2.61
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	80,376	80,353.83 6,458,520,073	77,300.00 6,213,064,800	2.34
15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	58,304.94	108,254.92 6,311,797,353	101,500.00 5,917,951,816	2.23
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	18,293	352,775.63 6,453,324,612	315,500.00 5,771,441,500	2.17
17	産業ファンド	日本	投資証券	48,974	120,748.00 5,913,512,785	114,900.00 5,627,112,600	2.12
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,236	658,381.27 6,080,809,461	587,000.00 5,421,532,000	2.04
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	34,244	144,786.71 4,958,076,180	142,100.00 4,866,072,400	1.83
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,972	277,305.17 4,983,728,613	263,200.00 4,730,230,400	1.78
21	API投資法人	日本	投資証券	13,001	326,026.70 4,238,673,243	328,500.00 4,270,828,500	1.61
22	イオンリート投資	日本	投資証券	32,811	135,026.70 4,430,361,323	126,700.00 4,157,153,700	1.57
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	31,453	127,183.56 4,000,304,679	123,900.00 3,897,026,700	1.47
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	49,622	86,537.49 4,294,163,452	77,700.00 3,855,629,400	1.45
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	13,543	331,568.96 4,490,438,481	277,900.00 3,763,599,700	1.42
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	39,505	101,989.12 4,029,080,581	89,100.00 3,519,895,500	1.33
27	NTT 都市開発リート投資法人	日本	投資証券	27,187	116,411.23 3,164,872,257	119,600.00 3,251,565,200	1.23
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	23,635	140,160.11 3,312,684,357	137,300.00 3,245,085,500	1.22
29	三菱地所物流 REIT	日本	投資証券	9,236	374,273.23 3,456,787,593	346,500.00 3,200,274,000	1.21
30	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	51,557	64,871.65 3,344,587,897	61,600.00 3,175,911,200	1.20

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.55%
合計	96.55%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT　先物 0703 月	買建	5,600	9,004,856,000	9,153,200,000	3.45%

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

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

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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(%)
投資信託受益証券		1,169,404,968	2.41
	内 アメリカ	1,169,404,968	2.41
投資証券		45,980,596,214	94.74
	内 ガーンジィ	64,537,239	0.13
	内 韓国	74,209,961	0.15
	内 香港	400,803,882	0.83
	内 シンガポール	1,462,102,253	3.01
	内 イスラエル	65,161,614	0.13
	内 イギリス	1,884,279,250	3.88
	内 アイルランド	13,358,296	0.03
	内 オランダ	52,096,823	0.11
	内 ベルギー	335,240,995	0.69
	内 フランス	686,244,707	1.41
	内 ドイツ	12,486,370	0.03
	内 スペイン	166,474,234	0.34
	内 イタリア	3,909,646	0.01
	内 カナダ	578,406,097	1.19
	内 アメリカ	36,591,851,397	75.39
	内 オーストラリア	3,548,765,058	7.31
	内 ニュージーランド	40,668,392	0.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,385,754,381	2.86
純資産総額		48,535,755,563	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)		1,436,275,772	2.96
	内 ドイツ	373,147,992	0.77
	内 アメリカ	1,063,127,780	2.19
為替予約取引(買建)		537,788,422	1.11
	内 日本	537,788,422	1.11

(注 1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注 2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
(注 3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（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	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	187,400	18,404.24 3,448,984,718	16,646.86 3,119,622,164	6.43
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	19,506	154,857.42 3,020,649,077	149,109.95 2,908,538,856	5.99
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	119,635	21,744.53 2,601,414,249	19,772.50 2,365,483,038	4.87
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	63,004	30,837.50 1,942,886,464	28,178.18 1,775,338,380	3.66
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	62,030	28,983.79 1,797,873,247	27,208.54 1,687,745,848	3.48
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	31,803	54,821.23 1,743,482,762	47,153.45 1,499,621,425	3.09
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	408,653	3,725.86 1,522,585,017	3,633.66 1,484,908,103	3.06
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	177,116	9,127.61 1,616,650,730	8,329.75 1,475,333,560	3.04
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	83,300	15,261.20 1,271,261,087	14,038.47 1,169,404,968	2.41
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,697	37,157.43 1,066,308,297	34,986.25 1,004,000,485	2.07
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	42,821	26,924.60 1,152,942,726	23,424.87 1,003,076,624	2.07
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	59,313	19,471.00 1,154,892,856	16,564.60 982,496,689	2.02
13	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	213,300	5,135.47 1,095,403,460	4,577.72 976,429,638	2.01
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	84,845	10,095.68 856,569,400	9,315.22 790,349,858	1.63
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	69,057	12,097.92 835,454,500	11,322.52 781,899,567	1.61
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	115,225	5,407.22 623,052,236	5,077.57 585,063,925	1.21
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	12,967	48,965.56 634,938,288	44,991.13 583,400,079	1.20
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	23,591	25,912.73 611,310,742	24,320.17 573,737,248	1.18
19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	136,385	4,034.06 550,186,176	3,696.66 504,169,874	1.04
20	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,460	17,377.33 546,693,617	15,557.00 489,423,314	1.01

	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 (%)
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,207	19,960.41 483,182,688	19,560.53 473,501,963	0.98
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	141,540	3,470.78 491,261,935	3,176.25 449,567,048	0.93
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	55,436	8,142.31 451,380,227	7,568.91 419,590,261	0.86
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	60,760	7,241.63 440,010,983	6,866.59 417,214,239	0.86
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	38,566	11,243.59 433,623,703	10,534.78 406,284,634	0.84
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	141,386	2,912.88 411,858,030	2,843.28 402,000,764	0.83
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	21,568	19,840.20 427,916,350	18,227.08 393,121,692	0.81
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,112,672	362.38 403,265,903	347.70 386,881,618	0.80
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	33,007	11,947.49 394,354,466	11,697.41 386,096,445	0.80
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	279,635	1,551.95 433,993,685	1,379.20 385,674,997	0.79

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	2.41%
投資証券	94.74%
合計	97.14%

(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
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	買建	188	1,116,450,701	1,063,127,780	2.19%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 25	買建	360	377,907,055	373,147,992	0.77%

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1月	買建	2,330,000	351,544,637	368,078,000	0.76%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	1,030,000	162,423,687	169,710,422	0.35%

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

ダイワ短期日本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		527,971,030	98.71
	内 日本	527,971,030	98.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,890,821	1.29
純資産総額		534,861,851	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	342 10年国債	日本	国債証券	70,000,000	99.52 69,664,700	99.55 69,686,400	0.100000 2026/03/20	13.03
2	152 5年国債	日本	国債証券	63,000,000	98.97 62,356,140	98.97 62,356,140	0.100000 2027/03/20	11.66
3	153 5年国債	日本	国債証券	62,000,000	98.60 61,135,720	98.60 61,137,580	0.005000 2027/06/20	11.43
4	149 5年国債	日本	国債証券	58,000,000	99.03 57,440,880	99.05 57,451,320	0.005000 2026/09/20	10.74
5	155 5年国債	日本	国債証券	55,000,000	99.14 54,529,200	99.11 54,513,250	0.300000 2027/12/20	10.19
6	150 5年国債	日本	国債証券	52,000,000	98.90 51,428,000	98.90 51,432,160	0.005000 2026/12/20	9.62
7	463 2年国債	日本	国債証券	41,000,000	99.75 40,897,910	99.74 40,894,630	0.400000 2026/08/01	7.65
8	154 5年国債	日本	国債証券	40,000,000	98.69 39,479,600	98.69 39,478,000	0.100000 2027/09/20	7.38
9	343 10年国債	日本	国債証券	35,000,000	99.35 34,773,200	99.37 34,780,550	0.100000 2026/06/20	6.50
10	148 5年国債	日本	国債証券	29,000,000	99.21 28,770,900	99.23 28,778,440	0.005000 2026/06/20	5.38
11	147 5年国債	日本	国債証券	14,000,000	99.40 13,916,420	99.43 13,921,460	0.005000 2026/03/20	2.60
12	98 20年国債	日本	国債証券	8,000,000	104.16 8,332,880	104.06 8,324,800	2.100000 2027/09/20	1.56
13	97 20年国債	日本	国債証券	5,000,000	104.43 5,221,600	104.32 5,216,300	2.200000 2027/09/20	0.98

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.71%
合計	98.71%

（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

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2030

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	20,328円
純資産総額	6.2億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	3.1%
6カ月間	0.5%
1年間	9.1%
3年間	18.4%
5年間	33.6%
設定来	103.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第 6 期 13年12月	第 7 期 14年12月	第 8 期 15年12月	第 9 期 16年12月	第 10 期 17年12月	第 11 期 18年12月	第 12 期 19年12月	第 13 期 20年12月	第 14 期 21年12月	第 15 期 22年12月	第 16 期 23年12月	第 17 期 24年12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
国内債券	13	40.0%
外国債券	1,025	21.7%
国内株式・先物	2,091	16.1%
外国株式・先物	1,156	11.0%
国内リート・先物	58	5.0%
外国リート・先物	296	4.9%
外国投資信託等	5	0.1%
コール・ローン、その他		2.3%
合計	4,644	－

通貨別構成	比率
日本円	61.8%
米ドル	23.1%
ユーロ	7.7%
オフショア人民元	2.6%
英ポンド	1.7%
カナダ・ドル	0.8%
豪ドル	0.8%
シンガポール・ドル	0.3%
スイス・フラン	0.3%
その他	1.0%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.1
最終利回り(%)	1.6
修正デュレーション	3.5
残存年数	4.2

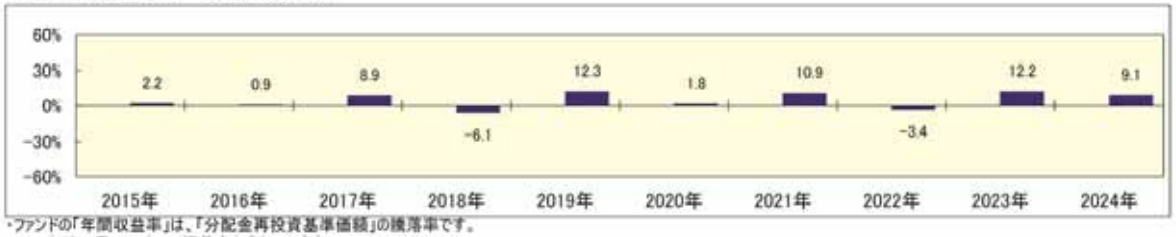
債券格付別構成	比率
AAA	90.6%
AA	6.3%
A	3.1%
BBB	－
BB	－
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	トヨタ自動車	日本	0.7%
株式	APPLE INC	アメリカ	0.6%
株式	NVIDIA CORP	アメリカ	0.5%
株式	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%
株式	ソニーグループ	日本	0.5%
リート	日本ビルファンド	日本	0.4%
リート	PROLOGIS INC	アメリカ	0.3%
リート	EQUINIX INC	アメリカ	0.3%
リート	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
リート	WELLTOWER INC	アメリカ	0.2%
合計			4.3%

※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。
※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

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2024年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（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
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	0.39%	0.37%	0.02%

※対象期間は2023年12月19日～2024年12月18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】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ取得申込者に対し、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、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。

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、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。

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

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、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。
・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社
電話番号（コールセンター） 0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ https://www.daiwa-am.co.jp/

⑵【保管】

該当事項はありません。

⑶【信託期間】

無期限とします。ただし、⑸①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。

⑷【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年2月28日から2008年12月18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。

⑸【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、あるいは、第24計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

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

7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファン

ドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

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

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

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

③　反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④　運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

４【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金にかかる請求権＞

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

＜償還金にかかる請求権＞

受益者は、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。

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。

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 17 期計算期間(2023 年 12 月 19 日から 2024 年 12 月 18 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

2025年2月7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ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030の2023年12月19日から2024年12月18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、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030の2024年12月18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】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030

(1)【貸借対照表】

	第16期 2023年12月18日現在 金　額（円）	第17期 2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,158,238	2,320,894
親投資信託受益証券	552,000,599	613,120,316
流動資産合計	554,158,837	615,441,210
資産合計	554,158,837	615,441,210
負債の部		
流動負債		
未払解約金	95,599	155
未払受託者報酬	84,517	97,284
未払委託者報酬	873,753	1,005,665
その他未払費用	21,042	24,235
流動負債合計	1,074,911	1,127,339
負債合計	1,074,911	1,127,339
純資産の部		
元本等		
元本　※1	299,806,057	305,301,992
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	253,277,869	309,011,879
（分配準備積立金）	72,726,920	98,840,713
元本等合計	553,083,926	614,313,871
純資産合計	553,083,926	614,313,871
負債純資産合計	554,158,837	615,441,210

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第16期 自2022年12月20日 至2023年12月18日 金　額（円）	第17期 自2023年12月19日 至2024年12月18日 金　額（円）
営業収益		
受取利息	－	2,158
有価証券売買等損益	43,825,959	51,413,717
営業収益合計	43,825,959	51,415,875
営業費用		
支払利息	343	16
受託者報酬	159,641	191,440
委託者報酬	1,650,395	1,979,046
その他費用	39,738	47,701
営業費用合計	1,850,117	2,218,203
営業利益又は営業損失（△）	41,975,842	49,197,672
経常利益又は経常損失（△）	41,975,842	49,197,672
当期純利益又は当期純損失（△）	41,975,842	49,197,672
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（△）	3,545,943	7,015,224
期首剰余金又は期首欠損金（△）	179,064,974	253,277,869
剰余金増加額又は欠損金減少額	68,873,817	76,280,946
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	68,873,817	76,280,946
剰余金減少額又は欠損金増加額	33,090,821	62,729,384
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	33,090,821	62,729,384
分配金　※1	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	253,277,869	309,011,879

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第17期 自2023年12月19日 至2024年12月18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16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
1. ※1 期首元本額	258,850,872円	299,806,057円
期中追加設定元本額	88,434,290円	78,911,508円
期中一部解約元本額	47,479,105円	73,415,573円
2. 計算期間末日における受益権の総数	299,806,057口	305,301,992口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第16期 自2022年12月20日 至2023年12月18日	第17期 自2023年12月19日 至2024年12月18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（38,429,977円）、投資信託約款に規定される収益調整金（216,827,542円）及び分配準備積立金（34,296,943円）より分配対象額は289,554,462円（1万口当たり9,658.06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（2,075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（42,180,113円）、投資信託約款に規定される収益調整金（238,204,249円）及び分配準備積立金（56,658,525円）より分配対象額は337,044,962円（1万口当たり11,039.72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17期 自2023年12月19日 至2024年12月18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17期 自2023年12月19日 至2024年12月18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17期 2024年12月18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16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18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	39,188,301	41,321,176
合計	39,188,301	41,321,176

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第17期 自2023年12月19日 至2024年12月18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16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8448円 （18,448円）	2.0122円 （20,122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	48,865,163	97,617,936	
	外国株式インデックスマザーファンド	9,588,199	68,524,940	
	外国債券インデックスマザーファンド	36,746,467	135,932,530	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	9,854,023	29,961,156	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	7,266,352	29,801,489	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	242,410,057	251,282,265	
親投資信託受益証券 合計			613,120,316	
合計			613,120,316	

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Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2023年12月18日現在 金　額（円）	2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		12,509,355,185	18,115,112,162
株式	※2※3	271,694,881,710	400,098,341,150
派生商品評価勘定		－	317,850
未収入金		－	606,500
未収配当金		34,216,517	40,745,686
未収利息		354,362	－
前払金		40,870,000	20,385,000
その他未収収益	※4	3,809,987	7,066,226
差入委託証拠金		83,656,486	－
流動資産合計		284,367,144,247	418,282,574,574
資産合計		284,367,144,247	418,282,574,574
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		88,366,150	34,588,400
未払解約金		45,582,510	143,616,770
未払利息		－	1,160,023
受入担保金		6,027,500,124	12,735,844,660
流動負債合計		6,161,448,784	12,915,209,853
負債合計		6,161,448,784	12,915,209,853
純資産の部			
元本等			
元本	※1	167,363,042,675	202,918,715,077
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		110,842,652,788	202,448,649,644
元本等合計		278,205,695,463	405,367,364,721
純資産合計		278,205,695,463	405,367,364,721
負債純資産合計		284,367,144,247	418,282,574,574

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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1.　※1　期首	2022 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 19 日
期首元本額	148,213,575,565 円	167,363,042,675 円
期中追加設定元本額	33,709,870,987 円	54,208,209,542 円
期中一部解約元本額	14,560,403,877 円	18,652,537,140 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	2,806,589,377 円	2,749,376,688 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,338,435,108 円	3,722,637,732 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	911,033 円	904,647 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	15,019,052 円	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）	186,897,779 円	127,893,647 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	13,126,071 円	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）	405,732,331 円	302,620,796 円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	335,745,401円	1,171,311,234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）	683,176,927円	862,207,445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）	-円	963,731,047円
Ｄ－Ｉ’ｓ ＴＯＰＩＸインデックス	13,681,132円	11,679,154円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	252,698,013円	246,515,707円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	7,316,732,442円	9,959,603,282円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,616,250,454円	5,200,333,681円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,010,425,277円	1,228,550,661円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	606,201円	4,364,951円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	70,764,909,047円	72,963,753,872円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,117,247,592円	2,973,734,629円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,949,158,053円	5,197,844,995円
ダイワ・ライフ・バランス７０	5,667,590,984円	6,247,921,235円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,353,575,651円	10,598,144,797円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	55,620,720円	48,865,163円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	76,255,756円	76,595,831円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,843,673,479円	6,604,969,865円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,445,814円	12,474,384円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	11,685,906円	14,025,228円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	29,772,487円	83,687,341円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	11,959,611,664円	24,141,805,204円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	54,371,807円	47,149,049円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	21,015,894円	19,954,146円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,760,384,417円	2,951,993,147円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	350,930,093円	278,988,473円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	51,746,439円	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）	73,719,521円	53,700,842円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	239,106,880円	234,374,933円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	12,349,270,983円	15,707,598,819円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	6,002,426,419円	14,902,340,770円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,346,831,688円	3,541,584,334円
スタイル９（4資産分散・保守型）	86,587円	886,764円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	145,111円	6,283,264円
スタイル９（4資産分散・積極型）	202,435円	9,095,535円
スタイル９（6資産分散・保守型）	74,055円	367,913円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	128,381円	11,597,753円
スタイル９（6資産分散・積極型）	203,035円	13,270,370円
スタイル９（8資産分散・保守型）	74,654円	577,437円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	126,582円	9,307,452円
スタイル９（8資産分散・積極型）	213,768円	28,207,165円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	−円	4,999,558円
ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ	1,153,362,208円	976,015,710円
ダイワライフスタイル２５	107,605,154円	92,382,825円
ダイワライフスタイル５０	481,894,635円	431,876,444円
ダイワライフスタイル７５	403,714,677円	379,440,247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）	8,127,833,501円	7,641,606,691円
計	167,363,042,675円	202,918,715,077円
2. 期末日における受益権の総数	167,363,042,675口	202,918,715,077口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 5,729,754,780円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 12,125,038,290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 617,720,000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 1,018,970,000円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
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12月19日 至2024年12月18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12月18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12月18日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2024年12月18日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	△12,681,916,678	13,825,653,988
合計	△12,681,916,678	13,825,653,988

（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12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等 （円）	うち1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	6,859,435,000	－	6,771,230,000	△88,205,000	5,510,405,000	－	5,476,245,000	△34,160,000
合計	6,859,435,000	－	6,771,230,000	△88,205,000	5,510,405,000	－	5,476,245,000	△34,160,000

（注）
1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6623円 （16,623円）	1.9977円 （19,977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	6,000	3,950.00	23,700,000	
ニッスイ	144,200	881.90	127,169,980	
マルハニチロ	21,400	2,912.00	62,316,800	
雪国まいたけ	12,300	1,016.00	12,496,800	
カネコ種苗	4,000	1,420.00	5,680,000	
サカタのタネ	16,100	3,445.00	55,464,500	
ホクト	12,800	1,806.00	23,116,800	貸付株式数 3,200株
ホクリヨウ	300	1,128.00	338,400	貸付株式数 200株
ショーボンドＨＤ	19,000	5,265.00	100,035,000	
ミライト・ワン	47,200	2,254.00	106,388,800	貸付株式数 9,600株
タマホーム	9,000	3,435.00	30,915,000	貸付株式数 3,500株
サンヨーホームズ	200	716.00	143,200	貸付株式数 100株 (100株)
日本アクア	800	776.00	620,800	
ファーストコーポレーション	500	835.00	417,500	貸付株式数 400株
ベステラ	400	1,018.00	407,200	貸付株式数 300株 (300株)
キャンディル	700	571.00	399,700	貸付株式数 100株
住石ホールディングス	15,800	793.00	12,529,400	貸付株式数 7,500株
日鉄鉱業	5,800	4,185.00	24,273,000	
三井松島HLDGS	7,000	3,270.00	22,890,000	貸付株式数 2,700株
ＩＮＰＥＸ	435,700	1,940.00	845,258,000	
石油資源開発	79,000	1,083.00	85,557,000	
K&Oエナジーグループ	6,500	3,070.00	19,955,000	貸付株式数 2,500株
リョーサン菱洋HD	18,400	2,255.00	41,492,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,285.00	514,000	貸付株式数 300株
第一カッター興業	4,100	1,435.00	5,883,500	
明豊ファシリティワークス	700	870.00	609,000	
安藤・間	83,600	1,172.00	97,979,200	
東急建設	45,000	699.00	31,455,000	貸付株式数 11,300株
コムシスホールディングス	51,100	3,218.00	164,439,800	
ビーアールホールディングス	22,500	334.00	7,515,000	
高松コンストラクションGP	10,700	2,668.00	28,547,600	貸付株式数 2,600株
東建コーポレーション	3,600	12,040.00	43,344,000	
ソネック	200	833.00	166,600	貸付株式数 100株
ヤマウラ	7,200	1,184.00	8,524,800	貸付株式数 2,300株
オリエンタル白石	53,100	388.00	20,602,800	
大成建設	91,500	6,590.00	602,985,000	
大 林 組	332,800	2,049.00	681,907,200	
清水建設	285,900	1,205.50	344,652,450	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
長谷工コーポレーション	92,500	2,000.00	185,000,000	貸付株式数 4,000株
松井建設	9,300	882.00	8,202,600	貸付株式数 3,600株
錢高組	100	3,725.00	372,500	
鹿島建設	223,600	2,745.00	613,782,000	
不動テトラ	6,400	2,020.00	12,928,000	
大末建設	500	1,553.00	776,500	
鉄建建設	6,600	2,213.00	14,605,800	
西松建設	16,000	5,136.00	82,176,000	
三井住友建設	81,300	412.00	33,495,600	
大豊建設	2,800	3,315.00	9,282,000	
佐田建設	700	976.00	683,200	
ナカノフドー建設	900	796.00	716,400	
奥村組	17,800	3,805.00	67,729,000	貸付株式数 7,000株
東鉄工業	11,200	3,175.00	35,560,000	
イチケン	300	2,539.00	761,700	
富士ピー・エス	800	398.00	318,400	貸付株式数 400株
淺沼組	40,200	620.00	24,924,000	
戸田建設	124,000	920.90	114,191,600	貸付株式数 14,400株
熊谷組	16,600	3,975.00	65,985,000	
北野建設	200	4,095.00	819,000	
植木組	400	1,537.00	614,800	
矢作建設	13,700	1,542.00	21,125,400	貸付株式数 5,300株
ピーエス・コンストラクション	7,600	1,093.00	8,306,800	
日本ハウスHLDGS	21,300	325.00	6,922,500	貸付株式数 8,400株
大東建託	34,400	17,595.00	605,268,000	
新日本建設	14,100	1,466.00	20,670,600	
東亜道路	17,500	1,279.00	22,382,500	貸付株式数 5,200株
日本道路	10,300	1,755.00	18,076,500	
東亜建設	30,500	1,182.00	36,051,000	
日本国土開発	28,600	512.00	14,643,200	
若築建設	3,000	3,810.00	11,430,000	
東洋建設	29,100	1,280.00	37,248,000	
五洋建設	132,100	619.10	81,783,110	
世紀東急	14,600	1,486.00	21,695,600	貸付株式数 5,600株
福田組	3,800	5,240.00	19,912,000	貸付株式数 1,400株
日本ドライケミカル	300	4,155.00	1,246,500	貸付株式数 100株
住友林業	87,100	5,610.00	488,631,000	
日本基礎技術	800	584.00	467,200	
巴コーポレーション	1,300	925.00	1,202,500	
大和ハウス	304,200	4,748.00	1,444,341,600	
ライト工業	20,600	2,201.00	45,340,600	貸付株式数 7,400株
積水ハウス	305,900	3,627.00	1,109,499,300	
日特建設	10,000	978.00	9,780,000	
北陸電気工事	7,100	1,111.00	7,888,100	
ユアテック	19,600	1,421.00	27,851,600	貸付株式数 7,300株
日本リーテック	8,000	1,123.00	8,984,000	貸付株式数 2,900株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
四電工	12,800	1,536.00	19,660,800	
中電工	15,800	3,290.00	51,982,000	
関 電 工	55,300	2,260.50	125,005,650	
きんでん	70,200	3,109.00	218,251,800	
東京エネシス	10,700	1,041.00	11,138,700	
トーエネック	16,900	927.00	15,666,300	
住友電設	8,300	4,795.00	39,798,500	
日本電設工業	19,100	2,011.00	38,410,100	
エクシオグループ	106,900	1,700.00	181,730,000	貸付株式数 31,500 株
新日本空調	6,500	3,925.00	25,512,500	
九電工	21,800	5,071.00	110,547,800	
三機工業	21,100	3,150.00	66,465,000	
日揮ホールディングス	99,800	1,271.00	126,845,800	
中外炉工業	3,300	3,490.00	11,517,000	
ヤマト	1,100	1,204.00	1,324,400	貸付株式数 400 株
太平電業	6,400	5,020.00	32,128,000	貸付株式数 700 株
高砂熱学	24,300	6,172.00	149,979,600	
三晃金属	200	4,265.00	853,000	
NEC ネッツエスアイ	37,900	3,330.00	126,207,000	
朝日工業社	9,500	2,101.00	19,959,500	
明星工業	17,500	1,380.00	24,150,000	
大 氣 社	13,000	4,615.00	59,995,000	
ダイダン	13,300	3,900.00	51,870,000	
日比谷総合設備	8,300	3,805.00	31,581,500	貸付株式数 3,200 株
ニップン	33,400	2,127.00	71,041,800	貸付株式数 12,000 株
日清製粉Ｇ本社	105,400	1,844.00	194,357,600	
日東富士製粉	1,800	6,530.00	11,754,000	
昭和産業	8,600	2,778.00	23,890,800	
鳥越製粉	1,000	800.00	800,000	貸付株式数 300 株
中部飼料	14,000	1,290.00	18,060,000	
フィード・ワン	14,700	776.00	11,407,200	
東洋精糖	200	1,458.00	291,600	
日本甜菜糖	5,300	2,366.00	12,539,800	貸付株式数 2,100 株
DM 三井製糖ホールディ	10,000	3,425.00	34,250,000	
塩水港精糖	1,500	315.00	472,500	貸付株式数 200 株
ウェルネオシュガー	6,100	2,143.00	13,072,300	
ＬＩＦＵＬＬ	25,900	196.00	5,076,400	
ＭＩＸＩ	19,900	3,185.00	63,381,500	
ジェイエイシーリクルートメント	38,200	720.00	27,504,000	
日本 M&A センターホールデ	155,500	641.80	99,799,900	
メンバーズ	4,100	1,050.00	4,305,000	
中広	200	438.00	87,600	
ＵＴグループ	13,800	2,146.00	29,614,800	貸付株式数 5,400 株
アイティメディア	5,700	1,540.00	8,778,000	貸付株式数 100 株
ケアネット	21,600	573.00	12,376,800	貸付株式数 8,400 株
E・Ｊホールディングス	6,200	1,675.00	10,385,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
オープンアップグループ	31,800	1,750.00	55,650,000	
コシダカホールディングス	32,000	1,157.00	37,024,000	貸付株式数 12,200株
アルトナー	500	1,957.00	978,500	貸付株式数 300株
パソナグループ	12,800	1,993.00	25,510,400	貸付株式数 2,200株
ＣＤＳ	400	1,826.00	730,400	
リンクアンドモチベーション	26,100	571.00	14,903,100	貸付株式数 9,800株
エス・エム・エス	40,400	1,555.50	62,842,200	
サニーサイドアップＧ	400	552.00	220,800	
パーソルホールディングス	986,300	236.30	233,062,690	
リニカル	800	327.00	261,600	
クックパッド	28,800	151.00	4,348,800	貸付株式数 10,900株
エスクリ	500	190.00	95,000	貸付株式数 200株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホールディンク	800	730.00	584,000	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	42,300	2,769.00	117,128,700	
中 村 屋	2,500	3,180.00	7,950,000	
江崎グリコ	29,000	4,750.00	137,750,000	
名糖産業	4,500	1,942.00	8,739,000	貸付株式数 1,400株
井村屋グループ	5,500	2,467.00	13,568,500	
不 二 家	7,000	2,696.00	18,872,000	貸付株式数 2,700株
山崎製パン	67,700	2,950.50	199,748,850	
第一屋製パン	300	561.00	168,300	
モロゾフ	3,300	4,775.00	15,757,500	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	6,400	4,035.00	25,824,000	貸付株式数 2,500株
寿スピリッツ	59,900	2,088.00	125,071,200	貸付株式数 5,800株
カルビー	46,400	3,210.00	148,944,000	貸付株式数 3,000株
森永乳業	38,900	2,916.50	113,451,850	
六甲バター	7,400	1,338.00	9,901,200	貸付株式数 2,800株
ヤクルト	144,700	3,075.00	444,952,500	貸付株式数 1,400株
明治ホールディングス	135,400	3,178.00	430,301,200	
雪印メグミルク	27,200	2,729.00	74,228,800	
プリマハム	13,600	2,206.00	30,001,600	
日本ハム	43,600	5,064.00	220,790,400	
林兼産業	400	459.00	183,600	貸付株式数 300株
丸大食品	10,200	1,676.00	17,095,200	貸付株式数 3,700株
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	11,200	2,702.00	30,262,400	貸付株式数 4,300株
柿安本店	4,000	2,827.00	11,308,000	貸付株式数 1,500株
伊藤ハム米久HLDGS	15,500	3,900.00	60,450,000	貸付株式数 2,700株
学情	5,400	2,268.00	12,247,200	
スタジオアリス	5,300	2,104.00	11,151,200	貸付株式数 1,300株 (300株)
クロスキャット	5,900	1,032.00	6,088,800	貸付株式数 1,600株
エプコ	300	787.00	236,100	
システナ	147,400	363.00	53,506,200	
ＮＪＳ	2,600	3,680.00	9,568,000	貸付株式数 1,000株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
デジタルアーツ	6,500	5,980.00	38,870,000	貸付株式数 2,500株
日鉄ソリューションズ	35,200	4,154.00	146,220,800	貸付株式数 13,600株
綜合警備保障	176,600	1,106.50	195,407,900	貸付株式数 68,300株
キューブシステム	5,400	1,063.00	5,740,200	貸付株式数 1,600株
いちご	85,600	358.00	30,644,800	
日本駐車場開発	120,500	206.00	24,823,000	
コア	4,600	1,840.00	8,464,000	
カカクコム	76,200	2,393.00	182,346,600	貸付株式数 29,500株
アイロムグループ	4,300	2,588.00	11,128,400	
セントケア・ホールディング	6,700	724.00	4,850,800	貸付株式数 2,000株
サイネックス	200	756.00	151,200	貸付株式数 100株
ルネサンス	8,200	1,002.00	8,216,400	貸付株式数 3,200株
ディップ	18,500	2,462.00	45,547,000	貸付株式数 7,200株
SBSホールディングス	9,200	2,359.00	21,702,800	
デジタルホールディングス	5,400	1,267.00	6,841,800	
新日本科学	11,200	1,556.00	17,427,200	貸付株式数 4,400株
キャリアデザインセンター	200	1,861.00	372,200	
エムスリー	208,900	1,391.00	290,579,900	貸付株式数 80,800株
ツカダ・グローバルHOLD	900	431.00	387,900	貸付株式数 600株
ブラス	200	537.00	107,400	貸付株式数 100株
ウェルネット	1,000	812.00	812,000	
ワールドホールディングス	4,200	1,997.00	8,387,400	貸付株式数 1,600株
ディー・エヌ・エー	42,300	2,684.50	113,554,350	
博報堂ＤＹHLDGS	119,800	1,214.00	145,437,200	貸付株式数 49,700株
ぐるなび	19,700	280.00	5,516,000	貸付株式数 7,400株
タカミヤ	14,200	408.00	5,793,600	
ファンコミュニケーションズ	14,900	415.00	6,183,500	
ライク	4,000	1,362.00	5,448,000	貸付株式数 1,400株 (1,200株)
Ａｏｂａ－ＢＢＴ	500	317.00	158,500	貸付株式数 400株
エスプール	33,400	303.00	10,120,200	貸付株式数 13,000株
WDBホールディングス	5,400	1,676.00	9,050,400	貸付株式数 1,800株
手間いらず	1,700	3,460.00	5,882,000	貸付株式数 600株
ティア	800	428.00	342,400	貸付株式数 300株
アドウェイズ	12,900	297.00	3,831,300	
バリューコマース	9,300	1,164.00	10,825,200	
インフォマート	99,700	289.00	28,813,300	貸付株式数 1,800株
サッポロホールディングス	33,300	8,618.00	286,979,400	
アサヒグループホールディン	760,300	1,646.00	1,251,453,800	
キリンＨＤ	421,800	2,074.50	875,024,100	
シマダヤ	2,900	1,402.00	4,065,800	
宝ホールディングス	68,400	1,336.50	91,416,600	貸付株式数 9,300株
オエノンホールディングス	32,800	397.00	13,021,600	貸付株式数 12,700株
養 命 酒	3,400	2,495.00	8,483,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
飛島ホールディングス	10,500	1,576.00	16,548,000	
コカ・コーラボトラーズJHD	71,400	2,447.50	174,751,500	
サントリー食品インター	71,300	5,076.00	361,918,800	
ダイドーグループHD	11,500	3,380.00	38,870,000	貸付株式数 3,800株
伊 藤 園	33,900	3,569.00	120,989,100	
キーコーヒー	11,400	2,036.00	23,210,400	貸付株式数 4,200株
ユニカフェ	400	950.00	380,000	貸付株式数 300株
日清オイリオグループ	14,300	5,120.00	73,216,000	
不二製油グループ	20,200	3,614.00	73,002,800	貸付株式数 5,300株
かどや製油	100	3,590.00	359,000	
Ｊ－オイルミルズ	11,600	2,124.00	24,638,400	貸付株式数 2,600株
サンエー	18,300	2,804.00	51,313,200	貸付株式数 2,600株
カワチ薬品	8,300	2,512.00	20,849,600	
エービーシー・マート	47,600	3,267.00	155,509,200	
ハードオフコーポレーション	4,300	1,803.00	7,752,900	
高千穂交易	4,300	3,805.00	16,361,500	貸付株式数 1,600株
アスクル	25,800	1,723.00	44,453,400	
ゲオホールディングス	12,200	1,582.00	19,300,400	貸付株式数 4,800株
アダストリア	15,000	3,620.00	54,300,000	
ジーフット	1,000	283.00	283,000	貸付株式数 900株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	522.00	104,400	貸付株式数 100株
オルバヘルスケアHLDGS	200	2,000.00	400,000	
伊藤忠食品	2,400	6,920.00	16,608,000	貸付株式数 500株
くら寿司	12,700	3,035.00	38,544,500	貸付株式数 5,000株
キャンドゥ	3,800	3,460.00	13,148,000	貸付株式数 1,400株
IKホールディングス	400	404.00	161,600	貸付株式数 300株
パルグループHLDGS	24,900	3,230.00	80,427,000	
エディオン	47,400	1,770.00	83,898,000	
あらた	16,600	3,050.00	50,630,000	貸付株式数 2,900株
サーラコーポレーション	22,600	850.00	19,210,000	
ワッツ	500	679.00	339,500	貸付株式数 400株
トーメンデバイス	1,600	6,370.00	10,192,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,300	3,925.00	16,877,500	
JPホールディングス	27,000	649.00	17,523,000	貸付株式数 1,700株
フジオフードG本社	12,200	1,183.00	14,432,600	貸付株式数 4,800株 (300株)
あみやき亭	7,900	1,624.00	12,829,600	貸付株式数 3,000株
東京エレクトロンデバイス	10,800	2,856.00	30,844,800	貸付株式数 4,200株
ひらまつ	2,700	171.00	461,700	貸付株式数 1,000株
円谷フィールズホールディ	17,600	1,707.00	30,043,200	貸付株式数 6,100株
双日	121,100	3,032.00	367,175,200	
アルフレッサホールディングス	101,400	2,149.50	217,959,300	
大黒天物産	3,300	9,810.00	32,373,000	貸付株式数 1,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ハニーズホールディングス	9,700	1,620.00	15,714,000	貸付株式数 3,300株
ファーマライズHD	300	576.00	172,800	貸付株式数 100株
キッコーマン	335,500	1,713.00	574,711,500	貸付株式数 14,500株
味 の 素	234,500	6,435.00	1,509,007,500	貸付株式数 32,600株
ブルドックソース	5,400	1,864.00	10,065,600	
キユーピー	54,400	3,418.00	185,939,200	
ハウス食品Ｇ本社	34,100	2,866.50	97,747,650	
カ ゴ メ	43,300	2,946.00	127,561,800	
アリアケジャパン	10,100	5,490.00	55,449,000	貸付株式数 3,900株
ピエトロ	200	1,742.00	348,400	貸付株式数 100株
エバラ食品工業	2,700	2,874.00	7,759,800	
やまみ	200	3,900.00	780,000	貸付株式数 100株
ニチレイ	41,200	4,166.00	171,639,200	
横浜冷凍	27,300	826.00	22,549,800	貸付株式数 10,700株
東洋水産	46,900	10,600.00	497,140,000	
イートアンドHLDGS	5,300	2,125.00	11,262,500	貸付株式数 1,900株
大冷	200	1,900.00	380,000	
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,500	1,264.00	6,952,000	貸付株式数 800株
日清食品ＨＤ	130,500	3,786.00	494,073,000	貸付株式数 50,500株
一正蒲鉾	500	737.00	368,500	貸付株式数 200株 (200株)
フジッコ	10,500	1,695.00	17,797,500	貸付株式数 3,800株
ロックフィールド	12,400	1,535.00	19,034,000	貸付株式数 4,800株
日本たばこ産業	615,200	4,154.00	2,555,540,800	
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,052.00	12,927,600	
わらべや日洋HD	6,800	1,958.00	13,314,400	貸付株式数 2,100株
なとり	6,400	2,184.00	13,977,600	
イフジ産業	200	1,626.00	325,200	貸付株式数 100株
ファーマフーズ	13,400	938.00	12,569,200	貸付株式数 5,200株
北の達人コーポ	43,600	146.00	6,365,600	貸付株式数 17,000株 (1,300株)
ユーグレナ	63,000	396.00	24,948,000	貸付株式数 24,600株 (600株)
紀文食品	8,800	1,059.00	9,319,200	貸付株式数 3,400株
ピックルスホールディングス	6,000	1,015.00	6,090,000	貸付株式数 1,900株
スター・マイカ・HLDGS	10,500	736.00	7,728,000	
SREホールディングス	3,700	3,045.00	11,266,500	貸付株式数 1,600株
ADワークスグループ	2,700	208.00	561,600	貸付株式数 1,000株
片倉工業	9,500	1,894.00	17,993,000	貸付株式数 3,600株
グ ン ゼ	7,300	5,320.00	38,836,000	
ヒューリック	236,100	1,343.00	317,082,300	貸付株式数 92,600株
神 栄	200	1,620.00	324,000	
ラサ商事	5,900	1,356.00	8,000,400	貸付株式数 900株
アルペン	9,100	2,046.00	18,618,600	貸付株式数 3,400株
ハブ	400	742.00	296,800	貸付株式数 300株
ラクーンホールディングス	7,700	747.00	5,751,900	貸付株式数 300株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
クオールホールディングス	13,500	1,492.00	20,142,000	
アルコニックス	15,500	1,456.00	22,568,000	
神戸物産	84,200	3,566.00	300,257,200	
ソリトンシステムズ	5,300	1,161.00	6,153,300	
ジンズホールディングス	8,300	6,330.00	52,539,000	貸付株式数 2,700株
ビックカメラ	65,100	1,723.00	112,167,300	貸付株式数 700株
DCMホールディングス	56,300	1,413.00	79,551,900	
ペッパーフードサービス	32,100	189.00	6,066,900	貸付株式数 12,200株
ハイパー	300	287.00	86,100	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	154,200	2,675.50	412,562,100	
東京一番フーズ	300	496.00	148,800	
ＤＤグループ	800	1,386.00	1,108,800	貸付株式数 700株
あい ホールディングス	17,400	2,078.00	36,157,200	
ディーブイエックス	200	912.00	182,400	
きちりホールディングス	400	900.00	360,000	貸付株式数 300株
J. フロント リテイリング	124,800	1,908.00	238,118,400	
ドトール・日レスＨＤ	19,300	2,307.00	44,525,100	
マツキヨココカラ&カンパニー	191,700	2,161.00	414,263,700	貸付株式数 60,900株
ブロンコビリー	6,400	3,750.00	24,000,000	貸付株式数 2,400株
ＺＯＺＯ	80,900	4,899.00	396,329,100	
トレジャー・ファクトリー	7,500	1,376.00	10,320,000	貸付株式数 2,800株
物語コーポレーション	19,400	3,580.00	69,452,000	貸付株式数 7,600株
三越伊勢丹ＨＤ	165,000	2,336.00	385,440,000	
東洋紡	44,600	937.00	41,790,200	貸付株式数 17,400株
ユニチカ	33,200	143.00	4,747,600	貸付株式数 13,000株
富士紡ホールディングス	4,100	5,460.00	22,386,000	
日清紡ホールディングス	78,100	872.70	68,157,870	
倉敷紡績	7,300	5,390.00	39,347,000	
ダイワボウＨＤ	48,200	3,045.00	146,769,000	
シキボウ	7,400	996.00	7,370,400	貸付株式数 1,800株
日東紡績	11,600	6,180.00	71,688,000	貸付株式数 2,700株
トヨタ紡織	43,300	1,990.00	86,167,000	
マクニカホールディングス	84,200	1,714.50	144,360,900	貸付株式数 13,300株
Ｈａｍｅｅ	4,400	1,260.00	5,544,000	
マーケットエンタープライズ	100	838.00	83,800	
ラクト・ジャパン	4,600	2,706.00	12,447,600	貸付株式数 300株
ウエルシアＨＤ	56,300	1,925.50	108,405,650	
クリエイトＳＤＨ	15,300	2,781.00	42,549,300	貸付株式数 5,600株
グリムス	4,600	2,400.00	11,040,000	貸付株式数 1,800株
バイタルＫＳＫＨＤ	15,000	1,116.00	16,740,000	
八洲電機	8,800	1,661.00	14,616,800	貸付株式数 3,100株
メディアスホールディングス	6,200	829.00	5,139,800	貸付株式数 2,300株
レスター	9,200	2,439.00	22,438,800	
ジオリーブグループ	300	1,060.00	318,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
丸善CHI HD	2,000	318.00	636,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
大光	600	584.00	350,400	貸付株式数 500株
OCHIホールディングス	300	1,305.00	391,500	
TOKAIホールディングス	58,800	957.00	56,271,600	貸付株式数 22,300株
黒谷	300	548.00	164,400	貸付株式数 100株
ミサワ	200	700.00	140,000	
ティーライフ	200	1,140.00	228,000	貸付株式数 100株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	200	902.00	180,400	
エー・ピーホールディングス	300	948.00	284,400	貸付株式数 200株
三洋貿易	11,200	1,521.00	17,035,200	
チムニー	500	1,251.00	625,500	貸付株式数 300株
シュッピン	10,700	993.00	10,625,100	貸付株式数 4,200株
ビューティガレージ	3,400	1,310.00	4,454,000	貸付株式数 1,300株
オイシックス・ラ・大地	17,600	1,344.00	23,654,400	貸付株式数 6,800株
ウイン・パートナーズ	7,900	1,253.00	9,898,700	貸付株式数 2,300株
ネクステージ	24,800	1,317.00	32,661,600	貸付株式数 9,700株
ジョイフル本田	30,200	1,837.00	55,477,400	貸付株式数 8,600株
エターナルホスピタリティグル	4,000	2,817.00	11,268,000	貸付株式数 1,500株
ホットランド	8,300	2,228.00	18,492,400	貸付株式数 3,200株 (200株)
すかいらーくHD	148,700	2,431.50	361,564,050	貸付株式数 57,600株
SFPホールディングス	6,100	1,961.00	11,962,100	貸付株式数 2,300株
綿半ホールディングス	8,400	1,497.00	12,574,800	貸付株式数 1,800株
日本毛織	26,400	1,291.00	34,082,400	貸付株式数 7,100株
ダイトウボウ	2,000	102.00	204,000	貸付株式数 1,800株
トーア紡コーポレーション	500	412.00	206,000	貸付株式数 100株
ダイドーリミテツド	1,100	891.00	980,100	貸付株式数 1,000株
ヨシックスホールディングス	3,600	3,290.00	11,844,000	貸付株式数 1,300株
ユナイテッド・スーパーマーケ	45,700	742.00	33,909,400	貸付株式数 18,100株 (300株)
野村不動産HLDGS	63,500	3,697.00	234,759,500	
三重交通グループHD	21,700	493.00	10,698,100	貸付株式数 7,600株
地主	8,900	2,112.00	18,796,800	貸付株式数 3,400株
プレサンスコーポレーション	13,400	1,932.00	25,888,800	貸付株式数 4,900株
フィル・カンパニー	2,000	885.00	1,770,000	貸付株式数 800株
ハウスコム	200	1,397.00	279,400	貸付株式数 100株
ＪＰＭＣ	5,800	1,126.00	6,530,800	
サンセイランディック	400	941.00	376,400	貸付株式数 300株
エストラスト	100	687.00	68,700	
フージャースHD	15,500	1,001.00	15,515,500	
オープンハウスグループ	37,100	5,370.00	199,227,000	貸付株式数 13,600株
東急不動産ＨＤ	304,500	913.30	278,099,850	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
飯田ＧＨＤ	97,000	2,334.50	226,446,500	
イーグランド	200	1,386.00	277,200	貸付株式数 100株
帝国繊維	11,600	2,370.00	27,492,000	貸付株式数 3,900株
日本コークス工業	104,700	94.00	9,841,800	貸付株式数 40,000株
ゴルフダイジェスト・オン	6,200	368.00	2,281,600	貸付株式数 2,400株
ミタチ産業	400	1,200.00	480,000	貸付株式数 300株
ＢＥＥＮＯＳ	6,800	3,370.00	22,916,000	貸付株式数 2,400株
あさひ	9,100	1,543.00	14,041,300	
日本調剤	7,200	1,358.00	9,777,600	貸付株式数 2,300株
コスモス薬品	18,400	6,629.00	121,973,600	
シップヘルスケアHD	43,000	2,202.50	94,707,500	
トーエル	500	731.00	365,500	貸付株式数 100株
ソフトクリエイトHD	7,400	2,244.00	16,605,600	
セブン&アイ・HLDGS	1,201,600	2,499.50	3,003,399,200	
クリエイト・レストランツ・ホール	81,800	1,175.00	96,115,000	貸付株式数 32,000株
明治電機工業	4,000	1,348.00	5,392,000	
ツルハホールディングス	22,800	8,257.00	188,259,600	
デリカフーズHLDGS	500	501.00	250,500	
スターティアホールディングス	400	2,201.00	880,400	貸付株式数 300株
サンマルクホールディングス	8,800	2,571.00	22,624,800	
フェリシモ	400	832.00	332,800	
トリドールホールディングス	30,600	3,874.00	118,544,400	貸付株式数 12,000株
帝 人	99,000	1,289.00	127,611,000	
東 レ	752,800	996.10	749,864,080	
ク ラ レ	150,100	2,252.50	338,100,250	
旭 化 成	696,700	1,071.50	746,514,050	
TOKYO BASE	11,600	321.00	3,723,600	貸付株式数 4,400株
稲葉製作所	5,900	1,691.00	9,976,900	貸付株式数 2,300株
宮地エンジニアリングＧ	12,800	1,898.00	24,294,400	貸付株式数 5,000株
トーカロ	30,600	1,851.00	56,640,600	
アルファCO	400	1,109.00	443,600	
ＳＵＭＣＯ	202,000	1,153.00	232,906,000	貸付株式数 78,200株
川田テクノロジーズ	6,900	2,641.00	18,222,900	
RS TECHNOLOGIES	8,100	3,300.00	26,730,000	貸付株式数 1,800株
ジェイテックコーポレーション	200	1,245.00	249,000	
信和	800	737.00	589,600	貸付株式数 700株
ビーロット	700	1,351.00	945,700	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	300	1,009.00	302,700	
AND DOホールディングス	6,000	966.00	5,796,000	貸付株式数 2,400株
シーアールイー	4,500	1,195.00	5,377,500	
ケイアイスター不動産	5,500	4,230.00	23,265,000	貸付株式数 300株
アグレ都市デザイン	300	1,603.00	480,900	貸付株式数 200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ジェイ・エス・ビー	4,200	2,605.00	10,941,000	
ロードスターキャピタル	5,800	2,474.00	14,349,200	
イノベーションホールディンク	400	917.00	366,800	貸付株式数 200株
グロバルリンクマネジメント	200	2,802.00	560,400	貸付株式数 100株
フェイスネットワーク	400	1,633.00	653,200	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	4,200	12,730.00	53,466,000	貸付株式数 1,600株
ＳＵＭＩＮＯＥ	300	2,014.00	604,200	貸付株式数 200株 (200株)
日本フエルト	600	479.00	287,400	
イチカワ	100	1,579.00	157,900	
エコナックホールディングス	1,100	112.00	123,200	貸付株式数 1,000株
日東製網	200	1,493.00	298,600	貸付株式数 100株
芦森工業	200	2,580.00	516,000	
アツギ	800	979.00	783,200	貸付株式数 300株
ウイルプラスHLDGS	200	1,003.00	200,600	
JMホールディングス	7,700	2,425.00	18,672,500	
コメダホールディングス	28,500	2,880.00	82,080,000	貸付株式数 9,000株
サツドラホールディングス	500	790.00	395,000	貸付株式数 400株
アレンザホールディングス	8,100	1,086.00	8,796,600	貸付株式数 3,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,300	1,389.00	4,583,700	貸付株式数 1,200株 (300株)
バロックジャパン	12,800	787.00	10,073,600	貸付株式数 4,900株
クスリのアオキHLDGS	36,400	3,239.00	117,899,600	
ダイニック	400	730.00	292,000	
共和レザー	700	687.00	480,900	
ピーバンドットコム	200	390.00	78,000	貸付株式数 100株
力の源HD	8,100	951.00	7,703,100	貸付株式数 3,200株
FOOD&LIFE COMPAN	58,000	3,445.00	199,810,000	
アセンテック	4,200	957.00	4,019,400	
セーレン	19,900	2,807.00	55,859,300	
ソトー	300	668.00	200,400	貸付株式数 100株
東海染工	100	690.00	69,000	
小松マテーレ	15,000	784.00	11,760,000	
ワコールホールディングス	21,300	5,300.00	112,890,000	
ホギメディカル	13,900	4,770.00	66,303,000	貸付株式数 5,300株
クラウディアHLDGS	300	329.00	98,700	貸付株式数 200株
ＴＳＩホールディングス	32,500	1,034.00	33,605,000	貸付株式数 11,100株
マツオカコーポレーション	300	1,985.00	595,500	
ワールド	15,900	2,487.00	39,543,300	
ＴＩＳ	109,000	3,868.00	421,612,000	貸付株式数 28,500株
テクミラホールディングス	600	333.00	199,800	貸付株式数 500株
グリー	34,700	449.00	15,580,300	
ＧＭＯペパボ	1,300	1,542.00	2,004,600	貸付株式数 200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
コーエーテクモＨＤ	77,600	1,816.00	140,921,600	貸付株式数　30,400株
三菱総合研究所	5,100	4,675.00	23,842,500	
ボルテージ	300	225.00	67,500	貸付株式数　100株
電算	100	1,428.00	142,800	
ＡＧＳ	500	809.00	404,500	貸付株式数　400株
ファインデックス	8,100	803.00	6,504,300	貸付株式数　3,200株
ブレインパッド	8,600	1,187.00	10,208,200	貸付株式数　3,300株
ＫＬａｂ	26,000	171.00	4,446,000	貸付株式数　6,100株
ポールトゥウィンホールディン	14,700	421.00	6,188,700	貸付株式数　5,500株
ネクソン	226,600	2,230.00	505,318,000	
アイスタイル	34,500	474.00	16,353,000	貸付株式数　13,200株
エムアップホールディングス	12,600	1,569.00	19,769,400	
エイチーム	6,800	996.00	6,772,800	貸付株式数　2,600株
エニグモ	11,600	294.00	3,410,400	貸付株式数　4,600株
テクノスジャパン	1,000	766.00	766,000	
ｅｎｉｓｈ	1,500	153.00	229,500	貸付株式数　800株
コロプラ	35,100	470.00	16,497,000	貸付株式数　13,300株
オルトプラス	1,100	78.00	85,800	貸付株式数　900株
ブロードリーフ	41,400	688.00	28,483,200	
クロス・マーケティングＧ	500	766.00	383,000	貸付株式数　400株
デジタルハーツ HLDGS	7,300	819.00	5,978,700	
メディアドゥ	4,600	1,402.00	6,449,200	貸付株式数　1,500株
じげん	25,700	489.00	12,567,300	貸付株式数　10,000株
ブイキューブ	13,900	200.00	2,780,000	貸付株式数　2,500株
エンカレッジ・テクノロジ	300	576.00	172,800	貸付株式数　200株
サイバーリンクス	500	766.00	383,000	貸付株式数　400株
ディー・エル・イー	4,300	130.00	559,000	
フィックスターズ	10,400	1,860.00	19,344,000	貸付株式数　4,000株
CARTA HOLDINGS	5,800	1,414.00	8,201,200	貸付株式数　2,200株
オプティム	10,700	704.00	7,532,800	貸付株式数　3,900株
セレス	4,600	3,340.00	15,364,000	貸付株式数　1,400株
ＳＨＩＦＴ	6,900	16,995.00	117,265,500	貸付株式数　2,500株
特種東海製紙	5,000	3,495.00	17,475,000	貸付株式数　1,200株
セック	1,800	4,430.00	7,974,000	
テクマトリックス	22,200	2,441.00	54,190,200	
プロシップ	4,500	1,569.00	7,060,500	貸付株式数　700株
ガンホー・オンライン・エンター	25,600	3,202.00	81,971,200	
GMOペイメントゲートウェイ	23,500	8,168.00	191,948,000	貸付株式数　8,600株
ザッパラス	200	365.00	73,000	貸付株式数　100株
システムリサーチ	7,000	1,445.00	10,115,000	貸付株式数　700株
インターネットイニシアティブ	56,300	3,019.00	169,969,700	
さくらインターネット	16,100	4,355.00	70,115,500	貸付株式数　6,300株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
GMO グローバルサイン HD	3,100	2,464.00	7,638,400	貸付株式数 1,100 株
SRA ホールディングス	5,900	4,320.00	25,488,000	
システムインテグレータ	400	304.00	121,600	
朝日ネット	11,100	651.00	7,226,100	
ｅＢＡＳＥ	14,500	643.00	9,323,500	貸付株式数 5,600 株
アバントグループ	13,000	2,007.00	26,091,000	
アドソル日進	4,300	2,126.00	9,141,800	
ODK ソリューションズ	300	562.00	168,600	貸付株式数 200 株
フリービット	4,500	1,434.00	6,453,000	
コムチュア	13,600	2,287.00	31,103,200	
アステリア	8,100	519.00	4,203,900	貸付株式数 3,000 株
アイル	5,800	2,713.00	15,735,400	貸付株式数 2,200 株
王子ホールディングス	390,000	588.90	229,671,000	
日本製紙	53,500	848.00	45,368,000	貸付株式数 21,400 株
三菱製紙	1,500	473.00	709,500	貸付株式数 1,400 株
北越コーポレーション	57,800	1,546.00	89,358,800	貸付株式数 22,600 株
中越パルプ	500	1,451.00	725,500	貸付株式数 300 株
巴川コーポレーション	400	694.00	277,600	貸付株式数 300 株
大王製紙	51,900	820.00	42,558,000	
阿波製紙	300	452.00	135,600	貸付株式数 200 株
マークラインズ	6,100	2,129.00	12,986,900	
メディカル・データ・ビジ	12,200	383.00	4,672,600	貸付株式数 4,700 株
ｇｕｍｉ	16,800	460.00	7,728,000	貸付株式数 6,500 株
ショーケース	100	274.00	27,400	
モバイルファクトリー	300	922.00	276,600	貸付株式数 200 株
テラスカイ	4,000	2,116.00	8,464,000	貸付株式数 1,500 株
デジタル・インフォメーション	5,400	2,179.00	11,766,600	
PCI ホールディングス	400	890.00	356,000	貸付株式数 100 株
アイビーシー	200	665.00	133,000	
ネオジャパン	2,700	1,739.00	4,695,300	
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	2,100	1,673.00	3,513,300	貸付株式数 800 株
ラクス	48,800	1,918.50	93,622,800	
ランドコンピュータ	500	658.00	329,000	貸付株式数 200 株
ダブルスタンダード	3,700	1,592.00	5,890,400	貸付株式数 1,000 株
オープンドア	7,200	659.00	4,744,800	貸付株式数 2,800 株
マイネット	400	333.00	133,200	貸付株式数 100 株
アカツキ	5,000	2,783.00	13,915,000	
ベネフィットジャパン	100	1,074.00	107,400	
UBICOM ホールディングス	3,300	1,239.00	4,088,700	
カナミックネットワーク	12,900	501.00	6,462,900	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	122.00	146,400	
レンゴー	93,700	847.90	79,448,230	
トーモク	5,900	2,181.00	12,867,900	貸付株式数 700 株
ザ・パック	7,600	3,550.00	26,980,000	貸付株式数 3,000 株
チェンジホールディングス	25,600	1,471.00	37,657,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
シンクロ・フード	700	349.00	244,300	貸付株式数 200株
オークネット	4,800	2,677.00	12,849,600	貸付株式数 1,800株
キャピタル・アセット・プラン	200	747.00	149,400	
セグエグループ	1,000	628.00	628,000	貸付株式数 900株
エイトレッド	200	1,509.00	301,800	
マクロミル	19,400	1,225.00	23,765,000	
ビーグリー	200	1,695.00	339,000	
オロ	4,300	2,453.00	10,547,900	貸付株式数 1,600株
ユーザーローカル	4,400	1,881.00	8,276,400	貸付株式数 1,600株
テモナ	300	187.00	56,100	貸付株式数 200株
ニーズウェル	1,200	389.00	466,800	貸付株式数 900株
マネーフォワード	25,300	5,033.00	127,334,900	
サインポスト	500	411.00	205,500	貸付株式数 400株
レゾナック・ホールディング	92,400	4,082.00	377,176,800	
住友化学	828,400	341.50	282,898,600	
住友精化	4,900	4,620.00	22,638,000	
日産化学	53,000	4,832.00	256,096,000	
ラサ工業	3,700	2,707.00	10,015,900	
クレハ	21,300	2,749.00	58,553,700	貸付株式数 3,500株
多木化学	4,000	3,535.00	14,140,000	貸付株式数 1,500株
テイカ	7,500	1,595.00	11,962,500	貸付株式数 1,000株
石原産業	17,100	1,463.00	25,017,300	
片倉コープアグリ	300	949.00	284,700	貸付株式数 200株
日本曹達	21,900	2,798.00	61,276,200	
東ソー	137,500	2,042.00	280,775,000	
トクヤマ	33,300	2,563.00	85,347,900	
セントラル硝子	13,000	3,210.00	41,730,000	
東亜合成	49,500	1,493.50	73,928,250	
大阪ソーダ	35,900	1,963.00	70,471,700	貸付株式数 9,600株
関東電化	22,100	1,008.00	22,276,800	貸付株式数 8,600株
SUN ASTERISK	7,400	691.00	5,113,400	貸付株式数 2,800株
デンカ	37,500	2,130.00	79,875,000	
イビデン	59,600	4,366.00	260,213,600	貸付株式数 23,000株
信越化学	923,600	5,201.00	4,803,643,600	
日本カーバイド	5,400	1,705.00	9,207,000	
電算システムＨＤ	4,600	2,425.00	11,155,000	貸付株式数 1,500株
堺 化 学	7,200	2,564.00	18,460,800	
第一稀元素化学工	11,200	671.00	7,515,200	貸付株式数 4,400株
エア・ウォーター	97,200	1,844.50	179,285,400	
日本酸素HLDGS	99,900	4,359.00	435,464,100	
日本化学工業	3,800	2,321.00	8,819,800	
東邦アセチレン	1,100	365.00	401,500	
日本パーカライジング	45,900	1,260.00	57,834,000	
高圧ガス	14,800	789.00	11,677,200	貸付株式数 4,600株
チタン工業	200	815.00	163,000	貸付株式数 100株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
四国化成ホールディンク	11,600	2,063.00	23,930,800	
戸田工業	2,300	1,189.00	2,734,700	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	5,600	4,040.00	22,624,000	
保土谷化学	3,200	3,705.00	11,856,000	
日本触媒	66,000	1,873.50	123,651,000	貸付株式数 4,800株
大日精化	7,200	2,928.00	21,081,600	
カネカ	25,400	3,636.00	92,354,400	
協和キリン	121,300	2,382.00	288,936,600	
APPIER GROUP	31,400	1,434.00	45,027,600	貸付株式数 600株
三菱瓦斯化学	83,600	2,698.00	225,552,800	貸付株式数 32,300株
三井化学	92,700	3,341.00	309,710,700	貸付株式数 21,600株
東京応化工業	49,100	3,507.00	172,193,700	
大阪有機化学	8,600	2,826.00	24,303,600	貸付株式数 2,000株
三菱ケミカルグループ	752,900	770.10	579,808,290	
ＫＨネオケム	18,600	2,015.00	37,479,000	貸付株式数 7,100株
ビジョナル	12,200	8,333.00	101,662,600	貸付株式数 4,600株
ダイセル	117,200	1,362.00	159,626,400	
住友ベークライト	32,500	3,754.00	122,005,000	
積水化学	205,100	2,391.00	490,394,100	
日本ゼオン	79,400	1,424.50	113,105,300	
アイカ工業	26,000	3,217.00	83,642,000	
ＵＢＥ	53,100	2,329.50	123,696,450	貸付株式数 12,000株
積水樹脂	14,100	2,160.00	30,456,000	貸付株式数 2,000株
旭有機材	6,900	4,445.00	30,670,500	貸付株式数 2,600株
ニチバン	6,400	1,987.00	12,716,800	
リケンテクノス	19,300	1,052.00	20,303,600	
大倉工業	4,800	3,000.00	14,400,000	貸付株式数 1,800株
積水化成品	14,400	348.00	5,011,200	貸付株式数 5,400株
群栄化学	2,400	2,622.00	6,292,800	
タイガース ポリマー	600	701.00	420,600	
ミライアル	400	1,315.00	526,000	貸付株式数 300株
ダイキアクシス	500	726.00	363,000	貸付株式数 300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	22,600	611.00	13,808,600	
竹本容器	400	859.00	343,600	
森六ホールディングス	5,700	1,968.00	11,217,600	
恵和	6,700	999.00	6,693,300	貸付株式数 2,500株
日本化薬	72,100	1,270.00	91,567,000	貸付株式数 4,800株
カーリット	10,200	1,266.00	12,913,200	貸付株式数 3,900株
ソルクシーズ	900	330.00	297,000	貸付株式数 600株
CLホールディングス	2,500	653.00	1,632,500	貸付株式数 900株
プレステージ・インター	49,500	687.00	34,006,500	
フェイス	300	1,218.00	365,400	
プロトコーポレーション	11,300	1,302.00	14,712,600	
ハイマックス	3,200	1,373.00	4,393,600	
アミューズ	6,500	1,432.00	9,308,000	貸付株式数 2,400株
野村総合研究所	223,500	4,616.00	1,031,676,000	貸付株式数 86,400株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ドリームインキュベータ	2,600	3,330.00	8,658,000	貸付株式数 900株
クイック	7,300	2,265.00	16,534,500	
ＴＡＣ	500	200.00	100,000	貸付株式数 300株
ＣＥホールディングス	500	549.00	274,500	
日本システム技術	9,500	2,003.00	19,028,500	貸付株式数 3,700株
電通グループ	112,400	3,916.00	440,158,400	
インテージホールディングス	11,700	1,633.00	19,106,100	貸付株式数 4,500株
テイクアンドギヴニーズ	5,000	916.00	4,580,000	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	4,800	1,387.00	6,657,600	
ぴあ	3,600	3,105.00	11,178,000	貸付株式数 1,300株
イオンファンタジー	4,600	2,935.00	13,501,000	貸付株式数 1,700株
ソースネクスト	52,300	178.00	9,309,400	貸付株式数 20,100株
シーティーエス	14,600	929.00	13,563,400	
NEXYZ.GROUP	400	761.00	304,400	
メディカルシステムネットワーク	10,600	418.00	4,430,800	
日本精化	6,800	2,298.00	15,626,400	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	9,600	3,500.00	33,600,000	
トリケミカル	11,200	2,740.00	30,688,000	
シンプレクスＨＤ	20,200	2,509.00	50,681,800	
ＨＥＲＯＺ	4,000	918.00	3,672,000	貸付株式数 1,600株
ラクスル	25,000	1,343.00	33,575,000	
メルカリ	50,400	1,839.00	92,685,600	貸付株式数 19,400株
ＩＰＳ	3,000	2,507.00	7,521,000	
ＦＩＧ	1,300	300.00	390,000	貸付株式数 1,200株
システムサポート	4,000	1,753.00	7,012,000	
ＡＤＥＫＡ	36,000	2,784.00	100,224,000	
日油	121,200	2,182.50	264,519,000	
ミヨシ油脂	400	1,565.00	626,000	貸付株式数 100株
新日本理化	1,600	194.00	310,400	貸付株式数 1,500株
ハリマ化成グループ	8,000	866.00	6,928,000	
イーソル	6,900	619.00	4,271,100	貸付株式数 2,600株
東海ソフト	200	1,378.00	275,600	
ウイングアーク 1ST	10,700	3,570.00	38,199,000	
ヒト・コミュニケーションズ HD	3,500	814.00	2,849,000	貸付株式数 1,200株
サーバーワークス	1,800	2,362.00	4,251,600	貸付株式数 700株
東名	200	2,389.00	477,800	
ヴィッツ	100	930.00	93,000	
トビラシステムズ	300	794.00	238,200	
Ｓａｎｓａｎ	34,000	2,426.00	82,484,000	貸付株式数 12,800株
LINK-U グループ	200	410.00	82,000	
ギフティ	9,100	1,340.00	12,194,000	貸付株式数 2,800株
花 王	250,800	6,527.00	1,636,971,600	
第一工業製薬	3,700	3,915.00	14,485,500	
石原ケミカル	4,500	2,376.00	10,692,000	貸付株式数 1,600株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日華化学	500	1,141.00	570,500	貸付株式数 100株
ニイタカ	200	2,007.00	401,400	貸付株式数 100株
三洋化成	6,400	3,980.00	25,472,000	
メドレー	11,300	3,895.00	44,013,500	貸付株式数 3,700株
ベース	5,100	2,973.00	15,162,300	貸付株式数 1,000株
ＪＭＤＣ	12,600	3,992.00	50,299,200	貸付株式数 6,000株
武田薬品	917,600	4,097.00	3,759,407,200	
アステラス製薬	904,600	1,509.50	1,365,493,700	
住友ファーマ	91,800	579.00	53,152,200	
塩野義製薬	342,100	2,167.50	741,501,750	
わかもと製薬	1,300	229.00	297,700	貸付株式数 500株
日本新薬	27,000	4,189.00	113,103,000	
中外製薬	322,800	6,813.00	2,199,236,400	
科研製薬	17,700	4,303.00	76,163,100	
エーザイ	136,800	4,350.00	595,080,000	
理研ビタミン	8,700	2,438.00	21,210,600	
ロート製薬	109,000	2,677.50	291,847,500	
小野薬品	211,000	1,630.50	344,035,500	
久光製薬	22,900	4,111.00	94,141,900	貸付株式数 8,400株
有機合成薬品	900	263.00	236,700	
持田製薬	13,000	3,450.00	44,850,000	
参天製薬	196,000	1,556.00	304,976,000	
扶桑薬品	4,000	2,576.00	10,304,000	
日本ケミファ	100	1,514.00	151,400	
ツムラ	35,400	4,792.00	169,636,800	
テ ル モ	687,800	3,025.00	2,080,595,000	貸付株式数 86,500株
ＨＵグループＨＤ	30,900	2,575.00	79,567,500	貸付株式数 9,400株
キッセイ薬品工業	17,100	3,510.00	60,021,000	
生化学工業	19,800	793.00	15,701,400	
栄研化学	16,300	2,156.00	35,142,800	貸付株式数 6,400株
鳥居薬品	5,500	4,415.00	24,282,500	
ＪＣＲファーマ	34,900	615.00	21,463,500	
東和薬品	13,900	2,745.00	38,155,500	
富士製薬工業	7,600	1,532.00	11,643,200	
ゼリア新薬工業	16,400	2,407.00	39,474,800	貸付株式数 3,900株
ネクセラファーマ	48,400	1,044.00	50,529,600	貸付株式数 18,900株
第一三共	973,300	4,343.00	4,227,041,900	
杏林製薬	22,400	1,453.00	32,547,200	貸付株式数 8,700株
大幸薬品	23,300	322.00	7,502,600	貸付株式数 7,500株
ダイト	7,700	2,010.00	15,477,000	
大塚ホールディングス	257,400	8,609.00	2,215,956,600	
ペプチドリーム	50,000	2,617.50	130,875,000	貸付株式数 4,000株
大日本塗料	11,400	1,132.00	12,904,800	
日本ペイントHOLD	455,700	1,042.00	474,839,400	
関西ペイント	86,300	2,183.00	188,392,900	
神東塗料	900	129.00	116,100	貸付株式数 800株
中国塗料	23,300	2,278.00	53,077,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本特殊塗料	800	1,250.00	1,000,000	
藤倉化成	13,000	508.00	6,604,000	
太陽ホールディングス	18,000	3,940.00	70,920,000	
ＤＩＣ	36,600	3,632.00	132,931,200	
サカタインクス	22,900	1,641.00	37,578,900	貸付株式数 8,800 株
ARTIENCE	18,400	3,020.00	55,568,000	
アルプス技研	9,200	2,624.00	24,140,800	貸付株式数 3,600 株
サニックス	14,800	248.00	3,670,400	貸付株式数 5,900 株
日本空調サービス	11,400	1,005.00	11,457,000	
オリエンタルランド	629,300	3,304.00	2,079,207,200	
フォーカスシステムズ	6,900	1,115.00	7,693,500	
ダスキン	23,100	3,677.00	84,938,700	
パーク２４	78,900	2,123.50	167,544,150	
明光ネットワークジャパン	12,900	722.00	9,313,800	貸付株式数 4,400 株
ファルコホールディングス	4,200	2,323.00	9,756,600	
クレスコ	16,900	1,189.00	20,094,100	
フジ・メディア・HD	99,000	1,735.50	171,814,500	
秀英予備校	200	263.00	52,600	
田谷	200	315.00	63,000	
ラウンドワン	99,700	1,338.00	133,398,600	
リゾートトラスト	41,800	3,137.00	131,126,600	貸付株式数 11,000 株
オービック	191,500	4,784.00	916,136,000	
ジャストシステム	14,800	3,585.00	53,058,000	
ＴＤＣソフト	17,400	1,441.00	25,073,400	
ＬＩＮＥヤフー	1,649,700	438.00	722,568,600	
ビー・エム・エル	13,000	2,943.00	38,259,000	
トレンドマイクロ	54,200	8,405.00	455,551,000	
ID ホールディングス	6,900	1,582.00	10,915,800	
リソー教育	66,100	300.00	19,830,000	
日本オラクル	19,700	14,610.00	287,817,000	貸付株式数 3,800 株
早稲田アカデミー	5,800	1,824.00	10,579,200	貸付株式数 2,100 株 (900 株)
アルファシステムズ	3,200	3,585.00	11,472,000	
フューチャー	25,700	1,892.00	48,624,400	
CAC HOLDINGS	6,300	1,680.00	10,584,000	
トーセ	400	614.00	245,600	貸付株式数 200 株
ユー・エス・エス	217,400	1,347.50	292,946,500	
オービックビジネスＣ	17,400	7,087.00	123,313,800	貸付株式数 5,500 株
アイティフォー	12,100	1,444.00	17,472,400	
東京個別指導学院	12,500	360.00	4,500,000	貸付株式数 400 株
東計電算	2,900	4,330.00	12,557,000	貸付株式数 1,100 株
サイバーエージェント	233,600	1,125.50	262,916,800	
楽天グループ	744,700	996.80	742,316,960	貸付株式数 297,500 株
エックスネット	200	1,510.00	302,000	貸付株式数 100 株
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,533.00	8,124,900	
SBI グローバルアセット	20,800	654.00	13,603,200	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
テー・オー・ダブリュー	20,600	312.00	6,427,200	
大塚商会	116,900	3,650.00	426,685,000	
サイボウズ	14,200	2,142.00	30,416,400	
山田コンサルティングGP	5,300	1,883.00	9,979,900	
セントラルスポーツ	4,000	2,410.00	9,640,000	貸付株式数 1,400株
パラカ	3,200	1,804.00	5,772,800	
電通総研	10,000	5,850.00	58,500,000	
ＡＣＣＥＳＳ	10,700	898.00	9,608,600	貸付株式数 4,100株
デジタルガレージ	16,500	3,725.00	61,462,500	
イーエムシステムズ	17,200	782.00	13,450,400	
ウェザーニューズ	6,400	3,265.00	20,896,000	
ＣＩＪ	25,700	461.00	11,847,700	
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,595.00	8,628,000	貸付株式数 900株
日本エンタープライズ	1,100	130.00	143,000	貸付株式数 400株
WOWOW	7,700	999.00	7,692,300	貸付株式数 2,900株
スカラ	9,400	394.00	3,703,600	貸付株式数 3,600株
インテリジェント ウェイブ	600	1,133.00	679,800	
フルキャストホールディングス	8,700	1,451.00	12,623,700	
エン・ジャパン	17,200	2,129.00	36,618,800	貸付株式数 5,900株
セルソース	6,900	861.00	5,940,900	貸付株式数 2,600株
あすか製薬ＨＤ	9,400	2,048.00	19,251,200	貸付株式数 3,100株
サワイグループHD	60,700	2,008.00	121,885,600	貸付株式数 14,200株
富士フイルムHLDGS	621,800	3,372.00	2,096,709,600	
コニカミノルタ	231,900	678.10	157,251,390	
資 生 堂	215,300	2,767.50	595,842,750	
ライオン	131,300	1,818.00	238,703,400	
高砂香料	7,000	5,670.00	39,690,000	
マンダム	20,500	1,302.00	26,691,000	
ミルボン	16,600	3,505.00	58,183,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
コーセー	21,000	6,919.00	145,299,000	
コタ	10,500	1,597.00	16,768,500	
シーボン	200	1,073.00	214,600	
ポーラ・オルビスHD	52,900	1,451.50	76,784,350	貸付株式数 20,700株
ノエビアホールディングス	9,200	4,845.00	44,574,000	貸付株式数 2,700株
アジュバンホールディング	400	810.00	324,000	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,900	1,924.00	11,351,600	貸付株式数 2,100株
アクシージア	6,700	528.00	3,537,600	貸付株式数 2,500株
エステー	8,500	1,531.00	13,013,500	
アグロカネショウ	3,400	1,895.00	6,443,000	
コ ニ シ	32,500	1,256.00	40,820,000	貸付株式数 12,700株
長谷川香料	19,700	3,095.00	60,971,500	貸付株式数 1,700株
小林製薬	27,000	5,945.00	160,515,000	
荒川化学工業	9,500	1,109.00	10,535,500	
メック	8,500	3,285.00	27,922,500	貸付株式数 3,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本高純度化学	2,600	3,165.00	8,229,000	
タカラバイオ	32,500	1,004.00	32,630,000	
ＪＣＵ	11,400	3,830.00	43,662,000	
新田ゼラチン	800	726.00	580,800	貸付株式数 700株
ＯＡＴアグリオ	4,300	2,036.00	8,754,800	貸付株式数 1,600株
デクセリアルズ	90,300	2,495.00	225,298,500	貸付株式数 14,700株
アース製薬	9,400	5,570.00	52,358,000	貸付株式数 3,600株
北興化学	9,200	1,328.00	12,217,600	
大成ラミック	2,900	2,459.00	7,131,100	
クミアイ化学	41,000	730.00	29,930,000	貸付株式数 14,400株
日本農薬	15,700	670.00	10,519,000	
富士興産	300	1,405.00	421,500	
ニチレキグループ	11,100	2,479.00	27,516,900	
ユシロ化学	5,300	2,160.00	11,448,000	
ビーピー・カストロール	600	891.00	534,600	貸付株式数 400株
富士石油	27,000	285.00	7,695,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	400	1,280.00	512,000	
出光興産	481,900	1,014.00	488,646,600	
ENEOSホールディングス	1,749,200	789.00	1,380,118,800	
コスモエネルギーHLDGS	34,000	6,599.00	224,366,000	
テスホールディングス	21,500	265.00	5,697,500	貸付株式数 8,000株
インフロニアＨＤ	105,600	1,148.00	121,228,800	
横浜ゴム	52,100	3,211.00	167,293,100	
TOYO TIRE	59,300	2,448.00	145,166,400	
ブリヂストン	301,900	5,243.00	1,582,861,700	
住友ゴム	101,100	1,785.50	180,514,050	
藤倉コンポジット	9,900	1,513.00	14,978,700	
オカモト	5,500	5,650.00	31,075,000	
アキレス	5,600	1,441.00	8,069,600	貸付株式数 2,100株
フ コ ク	6,100	1,715.00	10,461,500	貸付株式数 2,400株
ニッタ	10,100	3,640.00	36,764,000	
クリエートメディック	400	929.00	371,600	
住友理工	20,000	1,601.00	32,020,000	
三ツ星ベルト	14,400	3,975.00	57,240,000	貸付株式数 5,600株
バンドー化学	15,300	1,829.00	27,983,700	
ＡＧＣ	100,300	4,561.00	457,468,300	
日本板硝子	52,700	360.00	18,972,000	貸付株式数 20,600株
石塚硝子	200	2,244.00	448,800	貸付株式数 100株
有沢製作所	15,500	1,420.00	22,010,000	
日本山村硝子	500	1,554.00	777,000	
日本電気硝子	38,300	3,357.00	128,573,100	
オハラ	4,900	1,096.00	5,370,400	貸付株式数 1,900株
住友大阪セメント	18,500	3,244.00	60,014,000	貸付株式数 6,100株
太平洋セメント	63,600	3,633.00	231,058,800	
リソルホールディングス	200	5,040.00	1,008,000	
日本ヒューム	9,100	1,313.00	11,948,300	貸付株式数 3,200株
日本コンクリート	20,300	363.00	7,368,900	貸付株式数 7,800株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
三谷セキサン	4,300	5,570.00	23,951,000	貸付株式数 1,300株
アジアパイルＨＤ	14,800	776.00	11,484,800	
東海カーボン	95,100	886.40	84,296,640	
日本カーボン	5,900	4,470.00	26,373,000	貸付株式数 2,300株
東洋炭素	7,300	4,305.00	31,426,500	貸付株式数 2,800株 (800株)
ノリタケ	11,400	3,780.00	43,092,000	貸付株式数 2,100株
ＴＯＴＯ	74,800	3,888.00	290,822,400	貸付株式数 25,000株
日本碍子	120,000	1,923.00	230,760,000	
日本特殊陶業	84,300	4,709.00	396,968,700	
ダントーホールディングス	400	318.00	127,200	貸付株式数 200株
ＭＡＲＵＷＡ	4,300	45,420.00	195,306,000	貸付株式数 1,400株
品川リフラクトリーズ	12,700	1,671.00	21,221,700	貸付株式数 3,500株
黒崎播磨	7,000	2,380.00	16,660,000	
ヨータイ	5,200	1,560.00	8,112,000	
東京窯業	1,300	408.00	530,400	
ニッカトー	500	507.00	253,500	
フジミインコーポレーテッド	27,700	2,396.00	66,369,200	
クニミネ工業	500	1,005.00	502,500	貸付株式数 300株
エーアンドエーマテリアル	300	1,247.00	374,100	
ニチアス	26,100	5,808.00	151,588,800	
日本製鉄	537,200	2,997.00	1,609,988,400	
神戸製鋼所	213,300	1,485.50	316,857,150	貸付株式数 60,300株
中山製鋼所	21,800	708.00	15,434,400	貸付株式数 8,500株
合同製鐵	5,900	3,705.00	21,859,500	貸付株式数 2,300株
ＪＦＥホールディングス	319,600	1,665.00	532,134,000	
東京製鐵	29,600	1,460.00	43,216,000	貸付株式数 10,700株
共英製鋼	10,300	1,760.00	18,128,000	
大和工業	20,000	7,301.00	146,020,000	
東京鐵鋼	4,700	6,320.00	29,704,000	貸付株式数 1,700株
大阪製鐵	4,900	2,979.00	14,597,100	貸付株式数 1,800株
淀川製鋼所	9,800	5,440.00	53,312,000	貸付株式数 2,300株
中部鋼鈑	7,000	2,306.00	16,142,000	貸付株式数 2,700株
丸一鋼管	32,300	3,398.00	109,755,400	
モリ工業	2,700	4,675.00	12,622,500	
大同特殊鋼	66,800	1,112.50	74,315,000	
日本高周波	500	350.00	175,000	貸付株式数 400株
日本冶金工	7,100	3,750.00	26,625,000	
山陽特殊製鋼	10,500	1,771.00	18,595,500	
愛知製鋼	6,100	4,820.00	29,402,000	
日本金属	300	648.00	194,400	貸付株式数 200株
ミガロホールディングス	400	1,518.00	607,200	貸付株式数 300株
大平洋金属	9,800	1,417.00	13,886,600	貸付株式数 3,800株
新日本電工	63,300	280.00	17,724,000	
栗本鉄工所	4,900	4,030.00	19,747,000	
虹 技	200	1,204.00	240,800	貸付株式数 100株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本鋳鉄管	200	1,023.00	204,600	貸付株式数 100株
日本製鋼所	31,500	6,300.00	198,450,000	
三菱製鋼	7,800	1,384.00	10,795,200	
日亜鋼業	1,100	299.00	328,900	
日本精線	8,400	1,267.00	10,642,800	
エンビプロＨＤ	10,400	395.00	4,108,000	貸付株式数 3,900株 (1,400株)
大紀アルミニウム	15,200	1,038.00	15,777,600	貸付株式数 5,900株
日本軽金属ＨＤ	31,000	1,496.00	46,376,000	
三井金属	26,500	4,545.00	120,442,500	
東邦亜鉛	8,300	740.00	6,142,000	貸付株式数 3,200株
三菱マテリアル	75,800	2,305.00	174,719,000	
住友鉱山	134,200	3,495.00	469,029,000	貸付株式数 34,700株
DOWAホールディングス	28,600	4,396.00	125,725,600	
古河機金	14,000	1,521.00	21,294,000	
エス・サイエンス	6,800	21.00	142,800	貸付株式数 6,400株
大阪チタニウム	18,400	1,773.00	32,623,200	貸付株式数 7,200株
東邦チタニウム	21,900	1,016.00	22,250,400	貸付株式数 8,600株
ＵＡＣＪ	14,900	5,270.00	78,523,000	
ＣＫサンエツ	2,600	3,790.00	9,854,000	貸付株式数 500株
古河電工	35,300	6,774.00	239,122,200	
住友電工	366,400	2,861.50	1,048,453,600	
フジクラ	113,800	6,248.00	711,022,400	
ＳＷＣＣ	14,200	7,510.00	106,642,000	貸付株式数 5,400株
カナレ電気	200	1,431.00	286,200	
平河ヒューテック	6,800	1,539.00	10,465,200	貸付株式数 1,500株
いよぎんホールディンク	132,600	1,499.50	198,833,700	
しずおかフィナンシャルク	223,100	1,301.50	290,364,650	
ちゅうぎんフィナンシャ	85,300	1,660.00	141,598,000	
楽天銀行	47,000	4,400.00	206,800,000	貸付株式数 9,300株
京都フィナンシャルＧ	127,500	2,234.00	284,835,000	貸付株式数 33,000株
リョービ	11,300	2,190.00	24,747,000	貸付株式数 4,400株
アーレステイ	1,200	537.00	644,400	貸付株式数 400株
AREホールディングス	42,900	1,670.00	71,643,000	
東洋製罐グループHD	67,600	2,441.50	165,045,400	
ホッカンホールディングス	5,700	1,637.00	9,330,900	
コロナ	5,800	962.00	5,579,600	
横河ブリッジHLDGS	18,400	2,780.00	51,152,000	
駒井ハルテック	300	1,538.00	461,400	
高田機工	400	1,016.00	406,400	
三和ホールディングス	104,700	4,527.00	473,976,900	
文化シヤツター	27,700	1,850.00	51,245,000	貸付株式数 9,500株
三協立山	13,300	652.00	8,671,600	貸付株式数 3,500株
アルインコ	8,000	1,033.00	8,264,000	貸付株式数 1,100株
東洋シヤツター	300	767.00	230,100	
ＬＩＸＩＬ	154,600	1,707.50	263,979,500	
日本フイルコン	800	500.00	400,000	貸付株式数 700株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ノーリツ	14,900	1,679.00	25,017,100	
長府製作所	11,800	1,871.00	22,077,800	
リンナイ	56,400	3,168.00	178,675,200	貸付株式数 20,800株
ユニプレス	18,400	1,073.00	19,743,200	貸付株式数 7,200株
ダイニチ工業	600	620.00	372,000	
日東精工	15,400	634.00	9,763,600	
三洋工業	100	2,824.00	282,400	
岡 部	18,700	762.00	14,249,400	
ジーテクト	11,800	1,592.00	18,785,600	
東 プ レ	18,700	1,967.00	36,782,900	貸付株式数 2,300株
高周波熱錬	16,000	964.00	15,424,000	貸付株式数 3,500株
東京製綱	6,300	1,241.00	7,818,300	貸付株式数 2,400株
サンコール	11,600	280.00	3,248,000	貸付株式数 4,600株
モリテックスチル	1,000	158.00	158,000	貸付株式数 400株
パイオラックス	14,200	2,567.00	36,451,400	貸付株式数 700株
エイチワン	10,900	985.00	10,736,500	
日本発条	93,800	1,930.00	181,034,000	貸付株式数 36,200株
中央発條	6,900	1,291.00	8,907,900	
アドバネクス	100	984.00	98,400	
三浦工業	48,200	3,951.00	190,438,200	
タ ク マ	35,100	1,628.00	57,142,800	
テクノプロ・ホールディング	61,400	2,914.50	178,950,300	
アトラグループ	400	137.00	54,800	貸付株式数 200株
アイ・アールジャパンHD	5,500	723.00	3,976,500	貸付株式数 2,000株
ＫｅｅＰｅｒ技研	6,500	4,705.00	30,582,500	貸付株式数 2,500株
楽待	400	697.00	278,800	貸付株式数 300株
三機サービス	200	984.00	196,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,400	679.00	5,703,600	貸付株式数 300株
デザインワン・ジャパン	600	112.00	67,200	貸付株式数 200株
イー・ガーディアン	5,000	1,953.00	9,765,000	
リブセンス	600	145.00	87,000	貸付株式数 500株
ジャパンマテリアル	32,300	1,675.00	54,102,500	
ベクトル	14,400	1,029.00	14,817,600	
ウチヤマホールディングス	600	310.00	186,000	貸付株式数 500株 (400株)
チャームケアコーポレーション	8,800	1,273.00	11,202,400	貸付株式数 3,400株
キャリアリンク	3,900	2,403.00	9,371,700	貸付株式数 800株
ＩＢＪ	8,100	595.00	4,819,500	貸付株式数 2,200株
アサンテ	5,200	1,642.00	8,538,400	貸付株式数 1,800株
バリューＨＲ	9,500	1,793.00	17,033,500	貸付株式数 3,700株 (400株)
M&Aキャピタルパートナー	8,600	2,758.00	23,718,800	
ライドオンエクスプレスHD	4,300	998.00	4,291,400	
ERIホールディングス	400	2,087.00	834,800	貸付株式数 300株
アビスト	200	3,030.00	606,000	貸付株式数 100株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
シグマクシス・ホールディンク	30,800	897.00	27,627,600	貸付株式数 5,600株
ウィルグループ	8,800	968.00	8,518,400	
エスクローＡＪ	1,400	139.00	194,600	
メドピア	8,400	459.00	3,855,600	貸付株式数 3,200株
レアジョブ	300	367.00	110,100	
リクルートホールディングス	824,700	11,080.00	9,137,676,000	※
エラン	13,900	749.00	10,411,100	
ツ ガ ミ	22,100	1,385.00	30,608,500	
オークマ	18,200	3,215.00	58,513,000	
芝浦機械	13,400	3,540.00	47,436,000	貸付株式数 5,100株
アマダ	144,300	1,469.50	212,048,850	
アイダエンジニア	23,300	791.00	18,430,300	貸付株式数 6,700株
ＦＵＪＩ	45,200	2,236.50	101,089,800	
牧野フライス	11,500	7,270.00	83,605,000	
オーエスジー	45,800	1,748.50	80,081,300	
ダイジェット	200	699.00	139,800	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	26,000	815.00	21,190,000	
DMG森精機	65,500	2,449.00	160,409,500	
ソディツク	27,300	731.00	19,956,300	
ディスコ	50,000	43,360.00	2,168,000,000	
日東工器	4,000	2,533.00	10,132,000	貸付株式数 1,700株
日進工具	8,600	733.00	6,303,800	
パンチ工業	1,200	398.00	477,600	貸付株式数 1,100株
冨士ダイス	7,700	781.00	6,013,700	貸付株式数 1,300株
土木管理総合試験	500	305.00	152,500	
日本郵政	1,183,700	1,491.00	1,764,896,700	
ベルシステム24HLDGS	11,300	1,243.00	14,045,900	
鎌倉新書	9,000	503.00	4,527,000	貸付株式数 3,400株 (1,700株)
ＳＭＮ	300	415.00	124,500	
一蔵	200	389.00	77,800	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	200	673.00	134,600	
エアトリ	7,800	1,178.00	9,188,400	貸付株式数 2,900株
アトラエ	7,400	812.00	6,008,800	貸付株式数 2,800株
ストライク	5,200	3,725.00	19,370,000	貸付株式数 1,800株
ソラスト	29,100	463.00	13,473,300	
セラク	3,200	1,272.00	4,070,400	貸付株式数 1,100株
インソース	22,900	1,130.00	25,877,000	
豊田自動織機	87,700	11,200.00	982,240,000	
豊和工業	700	1,240.00	868,000	貸付株式数 200株
石川製作所	300	1,354.00	406,200	貸付株式数 200株
リケンＮＰＲ	13,000	2,528.00	32,864,000	貸付株式数 5,000株
東洋機械金属	1,000	645.00	645,000	
津田駒工業	300	338.00	101,400	貸付株式数 200株
エンシュウ	300	557.00	167,100	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
島精機製作所	16,500	1,009.00	16,648,500	貸付株式数 5,400株
オプトラン	17,100	1,897.00	32,438,700	貸付株式数 6,600株
イワキポンプ	6,900	2,486.00	17,153,400	貸付株式数 2,700株
フリュー	9,800	1,091.00	10,691,800	
ヤマシンフィルタ	21,900	657.00	14,388,300	貸付株式数 8,200株
日阪製作所	12,600	1,061.00	13,368,600	
やまびこ	17,000	2,566.00	43,622,000	
野村マイクロ・サイエンス	17,200	1,601.00	27,537,200	貸付株式数 6,700株 (100株)
平田機工	5,000	5,270.00	26,350,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	11,400	428.00	4,879,200	
マルマエ	4,500	1,434.00	6,453,000	貸付株式数 1,700株
タツモ	7,400	2,245.00	16,613,000	貸付株式数 2,900株
ナブテスコ	65,200	2,757.00	179,756,400	
三井海洋開発	13,100	3,170.00	41,527,000	
レオン自動機	10,900	1,424.00	15,521,600	
ＳＭＣ	31,100	62,340.00	1,938,774,000	
ホソカワミクロン	7,300	4,305.00	31,426,500	貸付株式数 1,800株
ユニオンツール	4,600	4,950.00	22,770,000	
瑞 光	6,600	1,200.00	7,920,000	貸付株式数 2,600株
オイレス工業	14,100	2,485.00	35,038,500	
日精エーエスビー	3,500	4,920.00	17,220,000	
サトーホールディングス	12,900	2,221.00	28,650,900	
技研製作所	9,800	1,759.00	17,238,200	貸付株式数 3,600株
日本エアーテック	4,900	1,180.00	5,782,000	貸付株式数 1,900株
カ ワ タ	400	796.00	318,400	
日精樹脂工業	6,800	966.00	6,568,800	
オカダアイヨン	400	1,838.00	735,200	
ワイエイシイホールディングス	5,200	1,812.00	9,422,400	貸付株式数 1,800株
小松製作所	511,900	4,173.00	2,136,158,700	
住友重機械	61,500	3,183.00	195,754,500	
日立建機	41,400	3,436.00	142,250,400	貸付株式数 16,000株
日 工	15,400	707.00	10,887,800	
巴工業	4,000	3,750.00	15,000,000	
井関農機	9,700	912.00	8,846,400	貸付株式数 3,800株
ＴＯＷＡ	31,800	1,481.00	47,095,800	貸付株式数 12,600株
丸山製作所	200	1,990.00	398,000	
北川鉄工所	4,100	1,162.00	4,764,200	
シンニッタン	1,400	199.00	278,600	
ローツェ	54,300	1,552.50	84,300,750	貸付株式数 3,400株
タカキタ	400	372.00	148,800	貸付株式数 100株
クボタ	542,900	1,832.00	994,592,800	
荏原実業	5,000	4,135.00	20,675,000	
東洋エンジニア	14,800	684.00	10,123,200	貸付株式数 5,800株
三菱化工機	3,600	3,500.00	12,600,000	
月島ホールディングス	14,000	1,405.00	19,670,000	貸付株式数 5,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
帝国電機製作所	7,100	2,729.00	19,375,900	
東京機械	300	352.00	105,600	
新東工業	23,100	906.00	20,928,600	
渋谷工業	9,700	3,725.00	36,132,500	
アイチ コーポレーション	17,200	1,395.00	23,994,000	
小森コーポレーション	25,600	1,192.00	30,515,200	
鶴見製作所	7,900	3,120.00	24,648,000	貸付株式数 1,000株
日本ギア工業	500	495.00	247,500	貸付株式数 300株
酒井重工業	4,100	2,315.00	9,491,500	
荏原製作所	213,200	2,565.50	546,964,600	
酉島製作所	8,900	2,313.00	20,585,700	貸付株式数 3,500株
北越工業	10,400	1,696.00	17,638,400	貸付株式数 3,900株
ダイキン工業	135,200	17,925.00	2,423,460,000	
オルガノ	16,000	8,260.00	132,160,000	貸付株式数 600株
トーヨーカネツ	3,800	4,160.00	15,808,000	
栗田工業	58,100	5,539.00	321,815,900	貸付株式数 3,000株
椿本チエイン	47,100	1,872.00	88,171,200	
大同工業	500	755.00	377,500	
日 機 装	26,600	962.00	25,589,200	
木村化工機	7,900	903.00	7,133,700	
レイズネクスト	14,600	1,547.00	22,586,200	
アネスト岩田	17,600	1,417.00	24,939,200	
ダイフク	175,300	3,371.00	590,936,300	
サムコ	2,500	2,776.00	6,940,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	700	1,404.00	982,800	
油研工業	200	2,555.00	511,000	
タダノ	59,800	1,141.50	68,261,700	
フジテック	33,400	6,072.00	202,804,800	
ＣＫＤ	28,700	2,470.00	70,889,000	
平和	34,600	2,142.00	74,113,200	貸付株式数 12,700株
理想科学工業	8,300	3,200.00	26,560,000	貸付株式数 3,000株
ＳＡＮＫＹＯ	120,000	2,016.00	241,920,000	
日本金銭機械	12,500	980.00	12,250,000	貸付株式数 4,700株
マースグループ HLDGS	7,000	3,160.00	22,120,000	貸付株式数 2,200株
フクシマガリレイ	7,600	5,250.00	39,900,000	
オーイズミ	400	318.00	127,200	貸付株式数 100株
ダイコク電機	4,500	2,865.00	12,892,500	貸付株式数 1,800株
竹内製作所	18,900	4,855.00	91,759,500	貸付株式数 400株
ア マ ノ	29,500	4,308.00	127,086,000	貸付株式数 8,700株
ＪＵＫＩ	16,000	355.00	5,680,000	貸付株式数 5,500株
サンデン	2,000	143.00	286,000	貸付株式数 1,700株
ジャノメ	9,000	981.00	8,829,000	貸付株式数 3,300株
ブラザー工業	138,800	2,730.00	378,924,000	
マックス	12,800	3,360.00	43,008,000	貸付株式数 2,700株
モリタホールディングス	16,200	2,109.00	34,165,800	貸付株式数 1,900株
グローリー	27,200	2,618.00	71,209,600	貸付株式数 9,300株
新晃工業	31,300	1,212.00	37,935,600	貸付株式数 4,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
大和冷機工業	15,900	1,456.00	23,150,400	貸付株式数 6,200株
セガサミーホールディングス	92,700	2,614.00	242,317,800	貸付株式数 35,800株
ＴＰＲ	13,200	2,384.00	31,468,800	貸付株式数 1,000株
ツバキ・ナカシマ	25,500	478.00	12,189,000	貸付株式数 10,000株
ホシザキ	66,900	6,363.00	425,684,700	
大豊工業	9,000	570.00	5,130,000	貸付株式数 3,400株
日本精工	192,300	662.90	127,475,670	貸付株式数 10,600株
Ｎ Ｔ Ｎ	245,900	244.10	60,024,190	
ジェイテクト	92,500	1,120.00	103,600,000	
不 二 越	7,700	3,150.00	24,255,000	貸付株式数 1,300株
ミネベアミツミ	180,600	2,521.00	455,292,600	
日本トムソン	28,300	510.00	14,433,000	
Ｔ Ｈ Ｋ	59,900	3,659.00	219,174,100	
ユーシン精機	9,500	655.00	6,222,500	
前澤給装工業	7,300	1,294.00	9,446,200	
イーグル工業	11,500	1,998.00	22,977,000	貸付株式数 4,100株
前澤工業	700	1,208.00	845,600	
ＰＩＬＬＡＲ	9,600	4,210.00	40,416,000	
キッツ	34,800	1,105.00	38,454,000	
日 立	2,674,200	3,966.00	10,605,877,200	※
三菱電機	1,056,300	2,639.50	2,788,103,850	
富士電機	63,100	8,744.00	551,746,400	
東洋電機製造	400	1,095.00	438,000	
安川電機	112,800	3,939.00	444,319,200	
シンフォニア テクノロジー	10,300	6,630.00	68,289,000	
明 電 舎	17,500	4,335.00	75,862,500	
オリジン	200	1,139.00	227,800	
山洋電気	4,500	8,540.00	38,430,000	貸付株式数 1,700株
デンヨー	7,900	2,826.00	22,325,400	貸付株式数 3,100株
PHCホールディングス	19,400	932.00	18,080,800	貸付株式数 7,600株
KOKUSAI ELECTRIC	72,700	2,270.00	165,029,000	貸付株式数 28,500株
ソシオネクスト	103,500	2,860.50	296,061,750	貸付株式数 10,900株
ベイカレント	77,700	5,257.00	408,468,900	
ORCHESTRA HLDGS	2,300	772.00	1,775,600	
アイモバイル	13,400	543.00	7,276,200	
ディスラプターズ	700	162.00	113,400	貸付株式数 200株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	5,800	1,088.00	6,310,400	貸付株式数 500株
船場	300	1,378.00	413,400	
ジャパンエレベーターSHD	41,100	2,784.00	114,422,400	
フルテック	200	1,184.00	236,800	貸付株式数 100株 (100株)
グリーンズ	400	1,877.00	750,800	
ツナググループHLDGS	300	610.00	183,000	貸付株式数 100株
GAMEWITH	500	220.00	110,000	貸付株式数 400株
MS&CONSULTING	100	419.00	41,900	
エル・ティー・エス	1,400	2,322.00	3,250,800	貸付株式数 500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ミダックホールディングス	6,400	1,528.00	9,779,200	
キュービーネット HLDGS	6,000	1,002.00	6,012,000	貸付株式数 2,300 株
オープングループ	16,700	185.00	3,089,500	貸付株式数 5,200 株
三桜工業	14,300	713.00	10,195,900	貸付株式数 5,600 株
マキタ	129,200	4,741.00	612,537,200	
東芝テック	15,500	3,660.00	56,730,000	
芝浦メカトロニクス	7,500	7,870.00	59,025,000	貸付株式数 2,900 株
マブチモーター	45,600	2,228.00	101,596,800	
ニデック	458,600	2,820.00	1,293,252,000	
ユーエムシーエレクトロニクス	6,400	292.00	1,868,800	貸付株式数 2,200 株
トレックス・セミコンダクター	4,900	1,166.00	5,713,400	貸付株式数 1,500 株
東光高岳	5,600	2,047.00	11,463,200	貸付株式数 2,100 株
ダブル・スコープ	31,800	259.00	8,236,200	貸付株式数 12,400 株
宮越ホールディングス	4,600	1,913.00	8,799,800	貸付株式数 1,700 株
ダイヘン	9,800	7,630.00	74,774,000	
ヤーマン	20,200	727.00	14,685,400	貸付株式数 7,900 株 (200 株)
ＪＶＣケンウッド	82,000	1,769.50	145,099,000	
ミマキエンジニアリング	8,600	1,486.00	12,779,600	貸付株式数 3,400 株
Ｉ－ＰＥＸ	5,400	2,940.00	15,876,000	
大崎電気	22,200	801.00	17,782,200	
オムロン	95,200	5,034.00	479,236,800	貸付株式数 7,600 株
日東工業	14,000	2,825.00	39,550,000	貸付株式数 5,400 株
ＩＤＥＣ	15,300	2,351.00	35,970,300	貸付株式数 6,000 株
正興電機製作所	400	1,162.00	464,800	貸付株式数 100 株
不二電機工業	300	1,099.00	329,700	貸付株式数 200 株
ジーエス・ユアサ コーポ	46,400	2,550.00	118,320,000	貸付株式数 17,900 株
サクサ	300	2,781.00	834,300	貸付株式数 100 株
メルコホールディングス	2,300	2,088.00	4,802,400	
テクノメディカ	2,000	1,792.00	3,584,000	貸付株式数 900 株
ダイヤモンドエレクトリク HD	4,100	490.00	2,009,000	貸付株式数 1,400 株
日本電気	146,900	13,280.00	1,950,832,000	
富 士 通	955,600	2,763.00	2,640,322,800	
沖 電 気	50,300	1,057.00	53,167,100	
電気興業	4,200	1,616.00	6,787,200	
サンケン電気	10,600	6,120.00	64,872,000	貸付株式数 4,100 株
ナカヨ	200	1,134.00	226,800	
アイホン	6,200	2,682.00	16,628,400	
ルネサスエレクトロニクス	791,200	2,005.00	1,586,356,000	
セイコーエプソン	133,200	2,810.00	374,292,000	貸付株式数 49,100 株
ワコム	73,000	749.00	54,677,000	
アルバック	22,800	6,150.00	140,220,000	
アクセル	5,200	1,201.00	6,245,200	
ＥＩＺＯ	13,600	2,193.00	29,824,800	貸付株式数 5,300 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ジャパンディスプレイ	61,700	20.00	1,234,000	
日本信号	23,600	912.00	21,523,200	
京三製作所	24,100	517.00	12,459,700	
能美防災	14,000	3,205.00	44,870,000	
ホーチキ	6,600	2,435.00	16,071,000	貸付株式数 1,300株
星和電機	500	529.00	264,500	
エレコム	24,800	1,466.00	36,356,800	
パナソニック ホールディンク	1,226,900	1,585.50	1,945,249,950	
シャープ	150,000	995.00	149,250,000	貸付株式数 58,000株
アンリツ	73,200	1,251.50	91,609,800	貸付株式数 28,600株
富士通ゼネラル	29,400	2,248.00	66,091,200	
ソニーグループ	3,600,800	3,291.00	11,850,232,800	
ＴＤＫ	896,900	2,055.00	1,843,129,500	
帝国通信工業	4,500	2,550.00	11,475,000	貸付株式数 1,600株
タムラ製作所	41,400	499.00	20,658,600	貸付株式数 16,200株
アルプスアルパイン	84,300	1,588.00	133,868,400	貸付株式数 18,400株
池上通信機	400	629.00	251,600	
日本電波工業	9,700	844.00	8,186,800	貸付株式数 3,600株
鈴木	5,500	1,774.00	9,757,000	
メイコー	10,300	9,110.00	93,833,000	
日本トリム	2,300	3,530.00	8,119,000	
フオスター電機	10,600	1,517.00	16,080,200	
ＳＭＫ	2,500	2,440.00	6,100,000	
ヨコオ	9,200	1,736.00	15,971,200	
ティアック	1,700	78.00	132,600	貸付株式数 1,600株
ホシデン	25,900	2,318.00	60,036,200	貸付株式数 9,800株
ヒロセ電機	15,100	18,710.00	282,521,000	
日本航空電子	27,000	2,785.00	75,195,000	
ＴＯＡ	10,500	919.00	9,649,500	
マクセル	21,000	1,721.00	36,141,000	
古野電気	12,300	2,678.00	32,939,400	
スミダコーポレーション	14,000	885.00	12,390,000	
アイコム	4,000	2,622.00	10,488,000	貸付株式数 300株
リオン	4,300	2,556.00	10,990,800	
横河電機	113,600	3,448.00	391,692,800	
新電元工業	3,900	2,379.00	9,278,100	貸付株式数 1,500株
アズビル	282,900	1,239.50	350,654,550	
東亜ディーケーケー	500	725.00	362,500	
日本光電工業	92,000	2,141.00	196,972,000	貸付株式数 31,500株
チノー	4,200	2,180.00	9,156,000	貸付株式数 1,300株
共和電業	1,200	426.00	511,200	
日本電子材料	6,300	2,164.00	13,633,200	
堀場製作所	19,500	8,980.00	175,110,000	
アドバンテスト	324,000	8,760.00	2,838,240,000	
小野測器	500	580.00	290,000	貸付株式数 200株
エスペック	9,200	2,645.00	24,334,000	貸付株式数 2,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
キーエンス	102,900	64,420.00	6,628,818,000	
日置電機	5,400	7,590.00	40,986,000	貸付株式数 2,100株
シスメックス	266,200	2,946.00	784,225,200	
日本マイクロニクス	16,900	4,165.00	70,388,500	貸付株式数 2,900株
メガチップス	7,900	6,410.00	50,639,000	貸付株式数 3,100株
OBARA GROUP	6,400	4,055.00	25,952,000	貸付株式数 2,500株
IMAGICA GROUP	10,300	546.00	5,623,800	貸付株式数 3,400株
澤藤電機	100	903.00	90,300	
デンソー	1,090,700	2,083.50	2,272,473,450	
原田工業	600	518.00	310,800	
コーセル	11,000	1,153.00	12,683,000	貸付株式数 4,100株
イリソ電子工業	10,400	2,672.00	27,788,800	
オプテックスグループ	18,900	1,679.00	31,733,100	
千代田インテグレ	3,600	3,550.00	12,780,000	
レーザーテック	47,100	15,700.00	739,470,000	
スタンレー電気	64,400	2,564.50	165,153,800	貸付株式数 20,700株
ウシオ電機	45,500	2,058.50	93,661,750	
岡谷電機	900	222.00	199,800	貸付株式数 800株
ヘリオステクノＨ	1,200	941.00	1,129,200	
エノモト	400	1,458.00	583,200	
日本セラミック	9,400	2,612.00	24,552,800	貸付株式数 3,500株
遠藤照明	600	1,430.00	858,000	
古河電池	7,500	1,380.00	10,350,000	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,400	2,308.00	19,387,200	貸付株式数 1,300株
図 研	9,400	4,355.00	40,937,000	
日本電子	23,800	5,510.00	131,138,000	貸付株式数 9,500株
カ シ オ	82,300	1,289.00	106,084,700	
ファナック	497,600	4,051.00	2,015,777,600	
日本シイエムケイ	30,100	395.00	11,889,500	貸付株式数 11,800株
エンプラス	3,000	4,910.00	14,730,000	貸付株式数 1,000株 (100株)
大真空	12,400	536.00	6,646,400	貸付株式数 4,900株
ロ ー ム	186,300	1,435.00	267,340,500	貸付株式数 73,000株
浜松ホトニクス	165,000	1,788.00	295,020,000	貸付株式数 13,400株
三井ハイテック	45,500	873.00	39,721,500	貸付株式数 13,400株
新光電気工業	35,700	5,548.00	198,063,600	
京 セ ラ	638,900	1,519.00	970,489,100	
協栄産業	100	2,248.00	224,800	
太陽誘電	45,100	2,185.50	98,566,050	
村田製作所	918,500	2,467.50	2,266,398,750	
双葉電子工業	19,600	498.00	9,760,800	
日東電工	326,100	2,508.50	818,021,850	
北陸電気工業	400	1,596.00	638,400	
東海理化電機	29,000	2,173.00	63,017,000	
ニチコン	27,000	1,025.00	27,675,000	
日本ケミコン	12,700	945.00	12,001,500	貸付株式数 4,700株
Ｋ Ｏ Ａ	17,100	967.00	16,535,700	貸付株式数 6,700株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
三井Ｅ＆Ｓ	55,500	1,676.00	93,018,000	貸付株式数 21,500株
カナデビア	85,000	923.00	78,455,000	貸付株式数 19,300株
三菱重工業	1,816,100	2,257.00	4,098,937,700	
川崎重工業	77,500	6,364.00	493,210,000	
ＩＨＩ	83,300	8,200.00	683,060,000	
名村造船所	29,300	1,607.00	47,085,100	貸付株式数 11,500株
サノヤスホールディングス	1,600	157.00	251,200	貸付株式数 1,200株
スプリックス	300	891.00	267,300	貸付株式数 100株
マネジメントソリューションズ	5,200	1,674.00	8,704,800	貸付株式数 2,000株
プロレド・パートナーズ	2,500	426.00	1,065,000	貸付株式数 1,000株
AND FACTORY	300	216.00	64,800	
テノ.ホールディングス	100	467.00	46,700	
フロンティア・マネジメント	3,100	765.00	2,371,500	
ピアラ	200	229.00	45,800	
コプロ・ホールディングス	500	1,630.00	815,000	貸付株式数 200株
ギークス	300	384.00	115,200	
アンビスホールディングス	22,600	737.00	16,656,200	貸付株式数 8,800株
カーブスホールディングス	28,900	805.00	23,264,500	
フォーラムエンジニアリング	12,300	1,025.00	12,607,500	
FAST FITNESS JAP	3,600	1,390.00	5,004,000	
日本車輌	4,000	2,222.00	8,888,000	
三菱ロジスネクスト	16,100	1,983.00	31,926,300	貸付株式数 800株
近畿車輌	200	1,395.00	279,000	
一家ホールディングス	300	662.00	198,600	貸付株式数 200株
フルサト・マルカHD	8,700	2,281.00	19,844,700	貸付株式数 3,200株
ヤマエグループHD	11,700	1,898.00	22,206,600	貸付株式数 4,500株
ジャパンクラフトホールディ	900	140.00	126,000	貸付株式数 800株
ＦＰＧ	36,100	2,760.00	99,636,000	
島根銀行	300	505.00	151,500	貸付株式数 200株
じもとホールディングス	1,000	292.00	292,000	貸付株式数 900株
全国保証	26,500	5,410.00	143,365,000	
めぶきフィナンシャルG	508,400	656.50	333,764,600	貸付株式数 90,000株
ジャパンインベストメントA	16,400	1,016.00	16,662,400	貸付株式数 6,400株
東京きらぼしFG	13,000	4,440.00	57,720,000	貸付株式数 700株
九州フィナンシャルG	178,100	702.50	125,115,250	
かんぽ生命保険	117,800	2,877.50	338,969,500	
ゆうちょ銀行	834,600	1,480.50	1,235,625,300	
あんしん保証	500	153.00	76,500	貸付株式数 100株
富山第一銀行	32,100	1,086.00	34,860,600	貸付株式数 12,400株
コンコルディア・フィナンシャル	538,800	875.70	471,827,160	
ジェイリース	7,600	1,213.00	9,218,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
西日本フィナンシャルHD	62,300	2,029.00	126,406,700	
イントラスト	400	824.00	329,600	
日本モーゲージサービス	600	424.00	254,400	貸付株式数 100株
Ｃａｓａ	400	826.00	330,400	貸付株式数 300株
ＳＢＩアルヒ	10,300	813.00	8,373,900	貸付株式数 3,700株
プレミアグループ	17,100	2,501.00	42,767,100	
日産自動車	1,285,200	417.60	536,699,520	貸付株式数 503,900株
いすゞ自動車	317,600	2,125.00	674,900,000	
トヨタ自動車	5,466,000	2,726.50	14,903,049,000	※
日野自動車	154,700	473.10	73,188,570	
三菱自動車工業	401,000	487.20	195,367,200	貸付株式数 7,300株
エフテック	800	503.00	402,400	貸付株式数 700株
レシップホールディングス	600	474.00	284,400	
ＧＭＢ	300	997.00	299,100	貸付株式数 200株
ファルテック	200	432.00	86,400	
武蔵精密工業	25,200	4,145.00	104,454,000	
日産車体	15,600	1,104.00	17,222,400	
新明和工業	29,600	1,353.00	40,048,800	
極東開発工業	13,900	2,381.00	33,095,900	貸付株式数 2,700株
トピー工業	8,300	1,921.00	15,944,300	貸付株式数 3,200株
ティラド	2,300	3,565.00	8,199,500	
タチエス	19,000	1,719.00	32,661,000	貸付株式数 7,400株
Ｎ Ｏ Ｋ	40,000	2,445.00	97,800,000	貸付株式数 15,000株
フタバ産業	31,000	690.00	21,390,000	貸付株式数 11,200株
カヤバ	17,500	2,815.00	49,262,500	
市光工業	18,500	392.00	7,252,000	
大同メタル工業	20,000	472.00	9,440,000	
プレス工業	40,100	528.00	21,172,800	貸付株式数 7,700株
ミクニ	1,400	313.00	438,200	
太平洋工業	23,600	1,292.00	30,491,200	貸付株式数 9,200株
河西工業	1,900	158.00	300,200	貸付株式数 1,700株
アイシン	217,800	1,729.00	376,576,200	
マ ツ ダ	315,800	1,011.00	319,273,800	
今仙電機製作所	700	498.00	348,600	貸付株式数 600株
本田技研	2,436,200	1,244.50	3,031,850,900	
スズキ	830,900	1,783.00	1,481,494,700	
SUBARU	310,000	2,574.50	798,095,000	
安永	600	469.00	281,400	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	434,200	1,376.00	597,459,200	貸付株式数 38,300株
小糸製作所	106,500	2,003.50	213,372,750	
ＴＢＫ	1,300	261.00	339,300	貸付株式数 500株
エクセディ	16,800	4,620.00	77,616,000	
ミツバ	19,200	885.00	16,992,000	
豊田合成	29,500	2,750.00	81,125,000	
愛三工業	19,500	1,585.00	30,907,500	
盟和産業	200	1,290.00	258,000	
日本プラスト	900	351.00	315,900	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ヨ ロ ズ	10,600	1,161.00	12,306,600	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	18,000	3,190.00	57,420,000	
新家工業	200	4,910.00	982,000	
シマノ	44,700	20,900.00	934,230,000	
テイ・エス テック	41,900	1,751.00	73,366,900	貸付株式数 900株
３３ＦＧ	9,100	2,199.00	20,010,900	貸付株式数 3,500株
第四北越フィナンシャルＧ	31,800	2,870.00	91,266,000	貸付株式数 2,400株
ひろぎんHLDGS	142,500	1,160.00	165,300,000	貸付株式数 53,700株
マーキュリアホールディングス	500	828.00	414,000	貸付株式数 300株 (300株)
おきなわＦＧ	8,000	2,620.00	20,960,000	
ダイレクトマケティングミクス	12,800	281.00	3,596,800	
ポピンズ	1,900	1,222.00	2,321,800	
LITALICO	9,600	870.00	8,352,000	貸付株式数 700株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,554.00	310,800	貸付株式数 100株
十六ＦＧ	14,200	4,275.00	60,705,000	
北國ＦＨＤ	9,900	5,330.00	52,767,000	貸付株式数 3,800株
ネットプロＨＤ	33,800	510.00	17,238,000	貸付株式数 300株
プロクレアホールディングス	11,600	1,694.00	19,650,400	貸付株式数 4,500株
あいちフィナンシャルグル	18,900	2,396.00	45,284,400	貸付株式数 6,600株
ジャムコ	6,200	1,471.00	9,120,200	貸付株式数 2,400株
小 野 建	11,900	1,451.00	17,266,900	貸付株式数 4,600株
はるやまHLDGS	500	610.00	305,000	貸付株式数 400株
南 陽	500	1,093.00	546,500	
ノ ジ マ	35,500	2,264.00	80,372,000	貸付株式数 11,300株
佐鳥電機	7,600	1,725.00	13,110,000	
カッパ・クリエイト	17,100	1,601.00	27,377,100	貸付株式数 6,700株
エコートレーディング	300	916.00	274,800	貸付株式数 100株
伯東	6,200	4,170.00	25,854,000	貸付株式数 2,300株
コンドーテック	8,200	1,339.00	10,979,800	貸付株式数 1,000株
中山福	600	361.00	216,600	
ライトオン	900	181.00	162,900	
ナガイレーベン	13,800	2,114.00	29,173,200	貸付株式数 5,400株
三菱食品	10,100	4,890.00	49,389,000	
良品計画	129,600	3,410.00	441,936,000	
パリミキホールディングス	1,600	286.00	457,600	
松田産業	8,300	3,095.00	25,688,500	
第一興商	42,100	1,839.50	77,442,950	
メディパルHD	118,000	2,369.00	279,542,000	
アドヴァングループ	9,200	933.00	8,583,600	貸付株式数 3,500株
ＳＰＫ	4,400	2,060.00	9,064,000	
萩原電気HLDGS	4,700	3,110.00	14,617,000	
アルビス	3,600	2,619.00	9,428,400	
アズワン	33,700	2,758.50	92,961,450	貸付株式数 5,800株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スズデン	4,600	1,821.00	8,376,600	
尾家産業	300	2,000.00	600,000	
シモジマ	7,300	1,296.00	9,460,800	
ドウシシャ	10,100	2,153.00	21,745,300	貸付株式数 2,400株
小津産業	300	1,650.00	495,000	貸付株式数 200株
コナカ	1,400	226.00	316,400	
高速	6,500	2,356.00	15,314,000	
ハウス ローゼ	200	1,439.00	287,800	
G-7ホールディングス	11,900	1,421.00	16,909,900	
たけびし	4,600	2,000.00	9,200,000	貸付株式数 1,700株
イオン北海道	26,400	897.00	23,680,800	貸付株式数 10,500株
コ ジ マ	21,000	1,110.00	23,310,000	貸付株式数 8,100株 (2,100株)
ヒマラヤ	400	848.00	339,200	貸付株式数 300株
コーナン商事	12,000	3,540.00	42,480,000	
ネットワンシステムズ	41,800	4,480.00	187,264,000	
エコス	4,000	2,024.00	8,096,000	貸付株式数 1,400株
ワタミ	13,100	958.00	12,549,800	貸付株式数 4,400株
マルシェ	400	201.00	80,400	貸付株式数 300株
リックス	2,500	2,795.00	6,987,500	
システムソフト	35,200	57.00	2,006,400	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	219,700	4,218.00	926,694,600	
丸文	9,700	1,028.00	9,971,600	
西松屋チェーン	24,100	2,277.00	54,875,700	貸付株式数 8,200株
ゼンショーホールディングス	61,800	9,343.00	577,397,400	
ハピネット	8,300	4,735.00	39,300,500	貸付株式数 3,400株
幸楽苑	8,000	1,042.00	8,336,000	貸付株式数 3,100株
ハークスレイ	400	676.00	270,400	
橋本総業HLDGS	4,200	1,275.00	5,355,000	貸付株式数 1,500株
日本ライフライン	29,100	1,330.00	38,703,000	
サイゼリヤ	16,100	5,560.00	89,516,000	
タカショー	8,700	448.00	3,897,600	貸付株式数 3,300株
ＶＴホールディングス	42,400	491.00	20,818,400	
アルゴグラフィックス	9,500	5,120.00	48,640,000	
魚力	3,800	2,440.00	9,272,000	貸付株式数 1,300株
ＩＤＯＭ	37,000	1,096.00	40,552,000	
日本エム・ディ・エム	8,100	587.00	4,754,700	
ポプラ	400	206.00	82,400	貸付株式数 300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,900	2,114.00	10,358,600	
ユナイテッドアローズ	11,600	2,655.00	30,798,000	
進和	6,600	2,908.00	19,192,800	貸付株式数 2,300株
エスケイジャパン	300	704.00	211,200	
ダイトロン	4,700	2,711.00	12,741,700	
ハイデイ日高	17,600	2,768.00	48,716,800	貸付株式数 5,900株
シークス	15,500	1,128.00	17,484,000	貸付株式数 5,800株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
京都きもの友禅HD	600	84.00	50,400	貸付株式数 200株
コロワイド	61,400	1,713.50	105,208,900	貸付株式数 24,000株
田中商事	300	677.00	203,100	
オーハシテクニカ	5,200	2,014.00	10,472,800	
壱番屋	43,000	1,008.00	43,344,000	貸付株式数 16,800株
白銅	3,100	2,389.00	7,405,900	貸付株式数 1,000株
トップカルチャー	400	138.00	55,200	貸付株式数 200株
ＰＬＡＮＴ	300	1,579.00	473,700	貸付株式数 200株
スギホールディングス	58,300	2,490.00	145,167,000	
ダイコー通産	100	1,330.00	133,000	
薬王堂ホールディングス	5,300	1,978.00	10,483,400	
島津製作所	148,000	4,460.00	660,080,000	貸付株式数 100株
Ｊ Ｍ Ｓ	9,300	430.00	3,999,000	
クボテック	400	212.00	84,800	貸付株式数 300株
長野計器	6,700	2,472.00	16,562,400	貸付株式数 2,600株
ブイ・テクノロジー	5,000	2,229.00	11,145,000	貸付株式数 1,900株
スター精密	17,500	1,881.00	32,917,500	
東京計器	7,200	3,220.00	23,184,000	貸付株式数 2,800株
愛知時計	4,800	1,984.00	9,523,200	
インターアクション	6,200	984.00	6,100,800	
オーバル	1,100	350.00	385,000	貸付株式数 1,000株
東京精密	21,100	7,317.00	154,388,700	
マニー	41,200	1,781.50	73,397,800	貸付株式数 15,900株
ニコン	162,200	1,649.00	267,467,800	
トプコン	58,400	2,794.00	163,169,600	
オリンパス	588,700	2,348.50	1,382,561,950	
理研計器	14,500	3,880.00	56,260,000	貸付株式数 5,700株
SCREENホールディングス	43,000	9,230.00	396,890,000	
キヤノン電子	9,700	2,464.00	23,900,800	
タムロン	14,200	4,370.00	62,054,000	
ＨＯＹＡ	200,900	20,140.00	4,046,126,000	
シ ー ド	900	458.00	412,200	
ノーリツ鋼機	9,700	4,875.00	47,287,500	
A&Dホロンホールディングス	12,800	2,005.00	25,664,000	
朝日インテック	125,300	2,510.50	314,565,650	
キヤノン	512,800	5,024.00	2,576,307,200	
リ コ ー	270,800	1,762.50	477,285,000	
シチズン時計	94,600	904.00	85,518,400	
リズム	300	3,795.00	1,138,500	貸付株式数 200株
大研医器	1,000	516.00	516,000	
メニコン	38,300	1,465.00	56,109,500	貸付株式数 15,000株
シンシア	100	531.00	53,100	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	1,600	164.00	262,400	
中本パックス	400	1,770.00	708,000	
パラマウントベッドHD	23,700	2,640.00	62,568,000	貸付株式数 3,700株
トランザクション	6,800	2,206.00	15,000,800	貸付株式数 2,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
粧美堂	300	509.00	152,700	貸付株式数 200株
ニホンフラッシュ	8,500	796.00	6,766,000	貸付株式数 2,000株
前田工繊	18,300	1,788.00	32,720,400	
永大産業	1,300	206.00	267,800	
アートネイチャー	10,500	810.00	8,505,000	
フルヤ金属	9,800	3,520.00	34,496,000	貸付株式数 3,800株
バンダイナムコHLDGS	279,100	3,713.00	1,036,298,300	
アイフィスジャパン	300	562.00	168,600	貸付株式数 100株
ＳＨＯＥＩ	28,900	2,254.00	65,140,600	貸付株式数 100株
フランスベッドHLDGS	14,700	1,276.00	18,757,200	貸付株式数 5,800株
マーベラス	19,300	579.00	11,174,700	
パイロットコーポレーション	16,100	4,775.00	76,877,500	貸付株式数 6,200株
萩原工業	6,900	1,637.00	11,295,300	貸付株式数 2,200株
エイベックス	19,400	1,478.00	28,673,200	
フジシールインターナショナル	23,200	2,511.00	58,255,200	貸付株式数 1,800株
タカラトミー	43,200	4,590.00	198,288,000	貸付株式数 16,500株
広済堂ホールディングス	38,700	511.00	19,775,700	貸付株式数 12,800株
エステールホールディングス	200	601.00	120,200	
レック	13,200	1,268.00	16,737,600	貸付株式数 5,100株
タカノ	400	694.00	277,600	
三光合成	12,900	587.00	7,572,300	
プロネクサス	10,600	1,284.00	13,610,400	
ホクシン	900	101.00	90,900	
ウッドワン	400	874.00	349,600	貸付株式数 300株
き も と	1,800	278.00	500,400	
TOPPANホールディングス	134,800	4,182.00	563,733,600	
大日本印刷	209,000	2,236.50	467,428,500	
共同印刷	2,900	3,930.00	11,397,000	
ＮＩＳＳＨＡ	17,600	1,554.00	27,350,400	
光村印刷	100	1,403.00	140,300	
ＺＡＣＲＯＳ	8,100	4,080.00	33,048,000	貸付株式数 3,000株
ヴィア・ホールディングス	2,300	131.00	301,300	貸付株式数 900株
TAKARA & COMPANY	6,100	2,965.00	18,086,500	
前澤化成工業	7,200	1,732.00	12,470,400	貸付株式数 2,700株
未来工業	3,700	3,705.00	13,708,500	貸付株式数 1,400株
アシックス	379,600	3,045.00	1,155,882,000	
ツ ツ ミ	2,400	2,100.00	5,040,000	
ウェーブロックHLDGS	400	645.00	258,000	
ジェイ エス ピー	8,500	2,092.00	17,782,000	貸付株式数 3,300株
ニ チ ハ	12,900	2,928.00	37,771,200	貸付株式数 5,000株
ローランド	7,600	3,960.00	30,096,000	
エフピコ	22,800	2,861.00	65,230,800	
小松ウオール工業	7,500	1,503.00	11,272,500	貸付株式数 2,600株
ヤマハ	187,900	1,069.50	200,959,050	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
河合楽器	3,100	2,966.00	9,194,600	
クリナップ	9,900	655.00	6,484,500	
ピジョン	65,500	1,472.00	96,416,000	
天馬	8,600	2,973.00	25,567,800	貸付株式数 2,100株
キングジム	9,100	870.00	7,917,000	貸付株式数 3,400株 (200株)
象印マホービン	30,700	1,816.00	55,751,200	貸付株式数 12,000株
リンテック	20,600	3,025.00	62,315,000	貸付株式数 5,300株
信越ポリマー	22,200	1,573.00	34,920,600	
東 リ	2,900	464.00	1,345,600	
イトーキ	20,500	1,660.00	34,030,000	
任 天 堂	649,200	9,265.00	6,014,838,000	
三菱鉛筆	14,200	2,406.00	34,165,200	貸付株式数 2,500株
松 風	10,300	2,129.00	21,928,700	
タカラスタンダード	23,600	1,668.00	39,364,800	
コ ク ヨ	51,400	2,759.00	141,812,600	
ナカバヤシ	11,000	507.00	5,577,000	
ニ フ コ	38,600	3,768.00	145,444,800	
立川ブラインド	4,700	1,320.00	6,204,000	貸付株式数 1,800株
グローブライド	10,200	1,876.00	19,135,200	貸付株式数 3,000株
オカムラ	31,000	2,057.00	63,767,000	
バルカー	7,900	3,170.00	25,043,000	
MUTOHホールディングス	200	2,435.00	487,000	
伊 藤 忠	731,300	7,623.00	5,574,699,900	
丸 紅	894,000	2,235.00	1,998,090,000	
スクロール	16,300	1,073.00	17,489,900	
高 島	800	1,237.00	989,600	貸付株式数 600株
ヨンドシーホールディングス	10,400	1,857.00	19,312,800	貸付株式数 3,800株
三陽商会	5,300	2,816.00	14,924,800	
長瀬産業	48,600	3,153.00	153,235,800	
ナイガイ	400	231.00	92,400	貸付株式数 300株
蝶 理	5,800	3,845.00	22,301,000	貸付株式数 1,900株
豊田通商	326,700	2,598.50	848,929,950	
オンワードホールディングス	66,800	555.00	37,074,000	
三共生興	14,100	583.00	8,220,300	
兼 松	45,500	2,563.50	116,639,250	
美 津 濃	10,200	9,120.00	93,024,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,074.00	214,800	
ルックホールディングス	3,300	2,446.00	8,071,800	貸付株式数 1,200株
三井物産	1,598,400	3,171.00	5,068,526,400	
日本紙パルプ	51,900	668.00	34,669,200	
東京エレクトロン	217,600	23,785.00	5,175,616,000	
カメイ	11,500	1,901.00	21,861,500	
東都水産	100	5,500.00	550,000	
OUGホールディングス	200	2,616.00	523,200	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スターゼン	7,500	2,947.00	22,102,500	
セイコーグループ	15,900	4,760.00	75,684,000	
山 善	36,600	1,366.00	49,995,600	貸付株式数 13,600株
椿本興業	6,000	2,023.00	12,138,000	貸付株式数 2,400株
住友商事	652,000	3,286.00	2,142,472,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	34,800	4,621.00	160,810,800	
内田洋行	4,400	6,570.00	28,908,000	
三菱商事	2,010,600	2,505.00	5,036,553,000	※
第一実業	10,200	2,770.00	28,254,000	貸付株式数 3,200株
キヤノンマーケティングJPN	21,400	5,118.00	109,525,200	
西華産業	5,100	4,875.00	24,862,500	貸付株式数 2,000株
佐藤商事	7,500	1,405.00	10,537,500	
東京産業	10,900	710.00	7,739,000	貸付株式数 3,200株
ユアサ商事	9,300	4,250.00	39,525,000	
神鋼商事	2,400	6,100.00	14,640,000	
トルク	800	230.00	184,000	
阪和興業	17,900	4,725.00	84,577,500	
正栄食品	7,200	3,970.00	28,584,000	貸付株式数 2,800株 (1,100株)
カナデン	8,100	1,459.00	11,817,900	
ＲＹＯＤＥＮ	8,800	2,376.00	20,908,800	
ニプロ	85,700	1,439.00	123,322,300	貸付株式数 29,900株
岩谷産業	108,100	1,764.50	190,742,450	貸付株式数 41,800株
ナイス	2,500	1,610.00	4,025,000	
ニチモウ	400	1,942.00	776,800	
極東貿易	6,500	1,556.00	10,114,000	貸付株式数 2,500株
アステナホールディングス	20,500	472.00	9,676,000	
三愛オブリ	25,400	1,825.00	46,355,000	
稲畑産業	29,400	3,190.00	93,786,000	
ＧＳＩクレオス	5,800	2,152.00	12,481,600	貸付株式数 2,100株
明和産業	15,500	633.00	9,811,500	
クワザワホールディングス	400	668.00	267,200	貸付株式数 300株
ゴールドウイン	18,200	8,342.00	151,824,400	貸付株式数 3,100株
ユニ・チヤーム	214,800	3,925.00	843,090,000	
キ ン グ	400	719.00	287,600	
ワ キ タ	16,000	1,587.00	25,392,000	貸付株式数 6,200株
ヤマトインターナシヨナル	1,000	331.00	331,000	貸付株式数 300株
東邦ホールディングス	29,400	4,232.00	124,420,800	貸付株式数 300株
サンゲツ	27,300	2,788.00	76,112,400	
ミツウロコグループ	13,800	1,765.00	24,357,000	
シナネンホールディングス	3,000	6,350.00	19,050,000	貸付株式数 1,200株
伊藤忠エネクス	26,900	1,609.00	43,282,100	
サンリオ	88,400	5,031.00	444,740,400	貸付株式数 500株
サンワ テクノス	4,900	2,158.00	10,574,200	
新光商事	14,600	944.00	13,782,400	貸付株式数 5,700株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
トーホー	4,700	2,839.00	13,343,300	貸付株式数 1,800株 (100株)
三信電気	4,300	1,863.00	8,010,900	
東陽テクニカ	10,000	1,409.00	14,090,000	
モスフード サービス	16,000	3,730.00	59,680,000	貸付株式数 4,000株
加賀電子	22,100	2,870.00	63,427,000	貸付株式数 2,500株
都築電気	6,200	2,749.00	17,043,800	
ソーダニツカ	10,600	1,161.00	12,306,600	
立花エレテック	6,500	2,577.00	16,750,500	
木曽路	16,500	2,114.00	34,881,000	貸付株式数 6,200株
SRSホールディングス	17,900	1,173.00	20,996,700	貸付株式数 7,000株
千 趣 会	22,000	298.00	6,556,000	貸付株式数 900株
タカキユー	900	126.00	113,400	貸付株式数 700株
リテールパートナーズ	16,000	1,263.00	20,208,000	貸付株式数 6,300株
上新電機	10,800	2,263.00	24,440,400	貸付株式数 4,200株
日本瓦斯	52,000	2,130.00	110,760,000	
ロイヤルホールディングス	19,200	2,404.00	46,156,800	貸付株式数 7,500株
東 天 紅	100	855.00	85,500	
チヨダ	10,400	1,355.00	14,092,000	
ライフコーポレーション	11,300	3,420.00	38,646,000	
リンガーハツト	14,100	2,226.00	31,386,600	貸付株式数 5,300株
ＭｒＭａｘＨＤ	13,700	691.00	9,466,700	
テンアライド	1,900	273.00	518,700	貸付株式数 1,600株
AOKIホールディングス	23,400	1,269.00	29,694,600	貸付株式数 6,200株
オークワ	17,100	895.00	15,304,500	貸付株式数 6,500株
コメリ	14,700	3,280.00	48,216,000	
青山商事	23,300	2,263.00	52,727,900	
しまむら	25,600	8,530.00	218,368,000	貸付株式数 3,100株
はせがわ	600	302.00	181,200	
高 島 屋	151,000	1,252.00	189,052,000	
松 屋	18,300	972.00	17,787,600	貸付株式数 7,200株
エイチ・ツー・オーリテイリング	52,900	2,166.00	114,581,400	貸付株式数 20,400株
近鉄百貨店	6,100	2,169.00	13,230,900	貸付株式数 2,400株
丸井グループ	72,200	2,522.50	182,124,500	
クレディセゾン	64,200	3,538.00	227,139,600	貸付株式数 8,100株
アクシアル リテイリング	29,200	890.00	25,988,000	
井 筒 屋	500	430.00	215,000	貸付株式数 200株
イオン	402,200	3,730.00	1,500,206,000	
イ ズ ミ	16,400	3,180.00	52,152,000	
フオーバル	4,300	1,358.00	5,839,400	貸付株式数 1,000株
平 和 堂	17,700	2,287.00	40,479,900	貸付株式数 6,500株
フ ジ	19,800	2,053.00	40,649,400	貸付株式数 7,500株
ヤオコー	12,800	9,196.00	117,708,800	貸付株式数 3,800株
ゼビオホールディングス	14,800	1,140.00	16,872,000	
ケーズホールディングス	73,100	1,377.50	100,695,250	貸付株式数 21,200株
ＰＡＬＴＡＣ	17,000	4,305.00	73,185,000	貸付株式数 3,900株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
三谷産業	18,800	320.00	6,016,000	
OLYMPIC グループ	600	459.00	275,400	貸付株式数 500 株
日産東京販売ＨＤ	1,700	497.00	844,900	
あおぞら銀行	69,900	2,397.00	167,550,300	貸付株式数 27,400 株
三菱 UFJ フィナンシャル G	6,641,600	1,812.50	12,037,900,000	
りそなホールディングス	1,250,700	1,148.50	1,436,428,950	
三井住友トラストグルー	360,600	3,696.00	1,332,777,600	
三井住友フィナンシャル G	2,112,700	3,659.00	7,730,369,300	
千葉銀行	313,600	1,223.00	383,532,800	
群馬銀行	175,900	1,100.00	193,490,000	貸付株式数 46,700 株
武蔵野銀行	15,400	2,978.00	45,861,200	貸付株式数 1,400 株
千葉興業銀行	23,900	1,378.00	32,934,200	貸付株式数 9,400 株
筑波銀行	44,400	244.00	10,833,600	貸付株式数 17,200 株
七十七銀行	32,400	4,542.00	147,160,800	
秋田銀行	6,800	2,199.00	14,953,200	
山形銀行	11,200	969.00	10,852,800	貸付株式数 1,900 株
岩手銀行	6,400	2,667.00	17,068,800	
東邦銀行	87,600	285.00	24,966,000	貸付株式数 32,900 株
東北銀行	600	1,153.00	691,800	
ふくおかフィナンシャル G	88,200	4,012.00	353,858,400	
スルガ銀行	63,000	1,108.00	69,804,000	
八十二銀行	237,000	1,010.00	239,370,000	
山梨中央銀行	11,300	1,811.00	20,464,300	
大垣共立銀行	19,300	1,859.00	35,878,700	
福井銀行	9,000	1,797.00	16,173,000	貸付株式数 2,600 株
清水銀行	4,000	1,436.00	5,744,000	貸付株式数 1,600 株
富山銀行	200	1,536.00	307,200	貸付株式数 100 株
滋賀銀行	15,300	3,780.00	57,834,000	
南都銀行	15,200	3,225.00	49,020,000	貸付株式数 3,500 株
百五銀行	95,400	616.00	58,766,400	貸付株式数 37,300 株
紀陽銀行	36,300	2,110.00	76,593,000	
ほくほくフィナンシャル G	57,000	1,919.50	109,411,500	貸付株式数 22,000 株
山陰合同銀行	63,300	1,238.00	78,365,400	貸付株式数 7,000 株
鳥取銀行	400	1,210.00	484,000	貸付株式数 100 株
百十四銀行	9,900	3,265.00	32,323,500	
四国銀行	14,900	1,103.00	16,434,700	
阿波銀行	14,200	2,704.00	38,396,800	
大分銀行	6,100	3,110.00	18,971,000	
宮崎銀行	6,600	3,030.00	19,998,000	
佐賀銀行	5,900	2,137.00	12,608,300	
琉球銀行	23,200	1,032.00	23,942,400	貸付株式数 9,000 株
セブン銀行	362,900	315.70	114,567,530	
みずほフィナンシャルＧ	1,367,000	3,779.00	5,165,893,000	
高知銀行	400	808.00	323,200	
山口フィナンシャルＧ	99,300	1,622.00	161,064,600	貸付株式数 12,700 株
芙蓉総合リース	9,300	11,400.00	106,020,000	貸付株式数 3,300 株
みずほリース	76,100	1,003.00	76,328,300	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東京センチュリー	75,700	1,532.00	115,972,400	貸付株式数 9,800株
SBIホールディングス	163,000	4,056.00	661,128,000	
日本証券金融	37,200	2,074.00	77,152,800	貸付株式数 7,600株
アイフル	167,800	322.00	54,031,600	
日本アジア投資	700	205.00	143,500	貸付株式数 600株
名古屋銀行	6,300	6,310.00	39,753,000	
北洋銀行	138,100	467.00	64,492,700	貸付株式数 44,700株
大光銀行	400	1,426.00	570,400	貸付株式数 200株
愛媛銀行	14,800	1,096.00	16,220,800	貸付株式数 4,200株
トマト銀行	400	1,186.00	474,400	貸付株式数 100株
京葉銀行	45,600	801.00	36,525,600	貸付株式数 6,100株
栃木銀行	46,400	283.00	13,131,200	
北日本銀行	3,600	2,764.00	9,950,400	
東和銀行	18,600	632.00	11,755,200	
福島銀行	1,200	220.00	264,000	貸付株式数 1,100株
大東銀行	600	719.00	431,400	貸付株式数 100株
リコーリース	9,600	5,110.00	49,056,000	貸付株式数 3,700株
イオンフィナンシャルサービス	58,200	1,254.50	73,011,900	
ア コ ム	241,200	379.40	91,511,280	
ジャックス	12,100	3,635.00	43,983,500	貸付株式数 4,700株
オ リ コ	33,100	806.00	26,678,600	貸付株式数 12,900株
オリックス	607,300	3,311.00	2,010,770,300	
三菱HCキャピタル	507,600	1,006.50	510,899,400	
ジャフコ グループ	30,200	2,194.00	66,258,800	貸付株式数 10,800株
九州 リースサービス	400	1,019.00	407,600	
トモニホールディングス	96,900	441.00	42,732,900	貸付株式数 4,400株
大和証券Ｇ本社	724,200	1,020.50	739,046,100	
野村ホールディングス	1,703,100	904.00	1,539,602,400	
岡三証券グループ	80,100	636.00	50,943,600	貸付株式数 17,200株
丸三証券	33,700	986.00	33,228,200	貸付株式数 13,200株
東洋証券	30,200	561.00	16,942,200	
東海東京ＨＤ	120,400	482.00	58,032,800	
光世証券	300	426.00	127,800	貸付株式数 200株
水戸証券	27,800	571.00	15,873,800	
いちよし証券	20,500	994.00	20,377,000	貸付株式数 800株
松井証券	69,900	811.00	56,688,900	
SOMPOホールディングス	495,000	4,111.00	2,034,945,000	
日本取引所グループ	602,500	1,796.50	1,082,391,250	
マネックスＧ	99,200	985.00	97,712,000	
極東証券	12,600	1,429.00	18,005,400	貸付株式数 4,800株
岩井コスモホールディング	11,600	2,296.00	26,633,600	
アイザワ証券グループ	14,600	1,722.00	25,141,200	貸付株式数 5,500株
フィデアホール	10,400	1,367.00	14,216,800	貸付株式数 4,100株
池田泉州ＨＤ	140,500	396.00	55,638,000	貸付株式数 32,900株
アニコム ホールディングス	34,100	645.00	21,994,500	
ＭＳ＆ＡＤ	742,000	3,347.00	2,483,474,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スパークス・グループ	11,300	1,495.00	16,893,500	
小林洋行	500	278.00	139,000	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	476,200	4,169.00	1,985,277,800	
東京海上ＨＤ	988,600	5,452.00	5,389,847,200	
アドバンテッジリスクマネ	600	642.00	385,200	貸付株式数 200株
イー・ギャランティ	16,600	1,764.00	29,282,400	貸付株式数 3,800株
アサックス	400	701.00	280,400	貸付株式数 100株
NECキャピタルソリューション	5,000	3,750.00	18,750,000	
T&Dホールディングス	271,800	2,750.50	747,585,900	
アドバンスクリエイト	7,800	474.00	3,697,200	貸付株式数 3,100株
三井不動産	1,405,400	1,239.50	1,741,993,300	
三菱地所	586,500	2,120.00	1,243,380,000	
平和不動産	16,400	4,185.00	68,634,000	
東京建物	88,500	2,501.00	221,338,500	
京阪神ビルディング	17,000	1,605.00	27,285,000	
住友不動産	164,700	4,693.00	772,937,100	
太平洋興発	400	705.00	282,000	貸付株式数 200株
テーオーシー	18,000	645.00	11,610,000	
スターツコーポレーション	16,300	3,645.00	59,413,500	
フジ住宅	12,600	758.00	9,550,800	
空港施設	14,100	569.00	8,022,900	
明和地所	8,100	1,005.00	8,140,500	貸付株式数 2,800株
ゴールドクレスト	6,900	3,300.00	22,770,000	貸付株式数 1,500株
リログループ	58,800	1,888.50	111,043,800	
エスリード	4,800	4,360.00	20,928,000	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	16,100	520.00	8,372,000	貸付株式数 5,200株
日本エスコン	26,500	932.00	24,698,000	貸付株式数 10,400株
MIRARTHホールディング	59,300	496.00	29,412,800	
ＡＶＡＮＴＩＡ	600	781.00	468,600	貸付株式数 500株
イオンモール	61,200	2,019.00	123,562,800	
毎日コムネット	400	717.00	286,800	貸付株式数 100株
ファースト住建	500	1,007.00	503,500	貸付株式数 400株
ランド	652,400	8.00	5,219,200	貸付株式数 256,200株
カチタス	27,200	2,165.00	58,888,000	
東祥	8,800	625.00	5,500,000	
トーセイ	16,800	2,522.00	42,369,600	貸付株式数 2,700株
穴吹興産	300	1,994.00	598,200	貸付株式数 200株
サンフロンティア不動産	16,900	1,871.00	31,619,900	
インテリックス	300	770.00	231,000	
ランドビジネス	400	214.00	85,600	貸付株式数 300株
サンネクスタグループ	400	1,017.00	406,800	貸付株式数 100株
グランディハウス	9,300	559.00	5,198,700	貸付株式数 2,900株
東武鉄道	108,300	2,454.00	265,768,200	
相鉄ホールディングス	34,000	2,436.50	82,841,000	貸付株式数 8,200株
東急	288,300	1,684.50	485,641,350	
京浜急行	127,200	1,269.50	161,480,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
小田急電鉄	170,000	1,403.50	238,595,000	貸付株式数 65,700 株
京王電鉄	54,400	3,855.00	209,712,000	
京成電鉄	59,700	4,112.00	245,486,400	貸付株式数 24,400 株
富士急行	12,700	2,235.00	28,384,500	貸付株式数 500 株
東日本旅客鉄道	567,000	2,777.50	1,574,842,500	
西日本旅客鉄道	262,700	2,750.00	722,425,000	
東海旅客鉄道	396,100	2,882.50	1,141,758,250	
東京地下鉄	171,900	1,583.50	272,203,650	
西武ホールディングス	111,900	3,347.00	374,529,300	貸付株式数 22,000 株
鴻池運輸	17,500	2,954.00	51,695,000	貸付株式数 1,600 株
西日本鉄道	29,800	2,160.50	64,382,900	貸付株式数 11,400 株
ハマキョウレックス	35,200	1,304.00	45,900,800	
サカイ引越センター	13,000	2,437.00	31,681,000	
近鉄グループ HLDGS	110,000	3,188.00	350,680,000	
阪急阪神 HLDGS	136,900	4,077.00	558,141,300	
南海電鉄	45,800	2,373.50	108,706,300	貸付株式数 10,300 株
京阪ホールディングス	56,600	3,303.00	186,949,800	貸付株式数 7,500 株
神戸電鉄	2,800	2,311.00	6,470,800	貸付株式数 1,000 株
名古屋鉄道	113,500	1,695.50	192,439,250	貸付株式数 33,000 株
山陽電鉄	7,700	2,009.00	15,469,300	貸付株式数 2,700 株
トランコム	1,200	10,270.00	12,324,000	
ヤマトホールディングス	124,800	1,764.50	220,209,600	
山 九	24,800	5,341.00	132,456,800	
日 新	7,000	4,435.00	31,045,000	
丸 運	700	419.00	293,300	貸付株式数 600 株
丸全昭和運輸	6,400	5,930.00	37,952,000	貸付株式数 2,100 株
センコーグループ HLDGS	60,400	1,517.00	91,626,800	
トナミホールディングス	2,300	5,840.00	13,432,000	貸付株式数 800 株
ニッコンホールディングス	58,400	2,006.00	117,150,400	
日石輸送	100	2,767.00	276,700	
福山通運	11,000	3,680.00	40,480,000	
セイノーホールディングス	50,500	2,400.50	121,225,250	貸付株式数 21,800 株
神奈川中央交通	2,900	3,765.00	10,918,500	
AZ-COM 丸和ホールディ	31,900	1,119.00	35,696,100	貸付株式数 12,200 株
日本郵船	212,700	5,030.00	1,069,881,000	
商船三井	195,200	5,231.00	1,021,091,200	
川崎汽船	233,600	2,092.50	488,808,000	貸付株式数 91,600 株
NS ユナイテッド海運	6,500	3,870.00	25,155,000	貸付株式数 2,400 株
明海グループ	1,200	676.00	811,200	貸付株式数 900 株
飯野海運	37,700	1,120.00	42,224,000	貸付株式数 1,800 株
共栄タンカー	200	1,038.00	207,600	貸付株式数 100 株
九州旅客鉄道	78,600	3,887.00	305,518,200	
SG ホールディングス	172,400	1,478.00	254,807,200	貸付株式数 9,100 株
NIPPON EXPRESS	36,800	7,265.00	267,352,000	
ID&E ホールディングス	6,000	6,480.00	38,880,000	
日本航空	235,400	2,548.50	599,916,900	
ANA ホールディングス	279,300	2,917.00	814,718,100	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ビーウィズ	2,200	1,486.00	3,269,200	貸付株式数 800株
TRE ホールディングス	24,200	1,497.00	36,227,400	
人・夢・技術グループ	4,300	1,375.00	5,912,500	貸付株式数 1,700株
西本 WISMETTAC HD	6,300	1,927.00	12,140,100	
シルバーライフ	2,900	708.00	2,053,200	貸付株式数 500株
ヤマシタヘルスケア HLDGS	100	2,379.00	237,900	
GENKY DRUGSTORES	9,500	3,160.00	30,020,000	貸付株式数 1,500株
コーア商事 HLDGS	8,000	599.00	4,792,000	貸付株式数 2,100株
KPP グループホールディン	22,500	624.00	14,040,000	
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,334.00	266,800	貸付株式数 100株
ブックオフＧＨＤ	7,900	1,487.00	11,747,300	貸付株式数 3,000株
ギフトホールディングス	5,400	3,290.00	17,766,000	貸付株式数 1,500株
三菱倉庫	107,200	1,169.00	125,316,800	
三井倉庫 HOLD	10,600	7,250.00	76,850,000	
住友倉庫	30,500	2,753.00	83,966,500	
渋沢倉庫	4,700	3,035.00	14,264,500	
ヤマタネ	4,400	3,870.00	17,028,000	貸付株式数 1,500株
東陽倉庫	300	1,407.00	422,100	
乾汽船	13,000	1,614.00	20,982,000	貸付株式数 5,100株
日本トランスシティ	20,600	1,025.00	21,115,000	
ケイヒン	200	2,015.00	403,000	
中央倉庫	6,100	1,543.00	9,412,300	貸付株式数 2,100株
川西倉庫	200	1,056.00	211,200	貸付株式数 100株
安田倉庫	7,000	1,745.00	12,215,000	貸付株式数 2,300株
ファイズホールディングス	200	947.00	189,400	
ＮＩＳＳＯＨＤ	9,100	750.00	6,825,000	貸付株式数 3,400株
大栄環境	23,000	2,885.00	66,355,000	貸付株式数 8,900株
日本管財ホールディンク	11,100	2,601.00	28,871,100	
東洋埠頭	300	1,258.00	377,400	
上 組	47,400	3,386.00	160,496,400	
サンリツ	300	789.00	236,700	
キムラユニティー	500	1,444.00	722,000	
キユーソー流通システム	6,800	2,130.00	14,484,000	貸付株式数 2,600株
東海運	600	335.00	201,000	貸付株式数 500株
エーアイテイー	6,500	1,710.00	11,115,000	
内外トランスライン	4,100	2,711.00	11,115,100	貸付株式数 1,500株
ショーエイコーポ	400	571.00	228,400	貸付株式数 300株
日本コンセプト	3,700	1,850.00	6,845,000	貸付株式数 1,400株
TBS ホールディングス	51,900	3,889.00	201,839,100	貸付株式数 19,100株
日本テレビ HLDS	91,300	2,615.50	238,795,150	貸付株式数 29,500株
朝日放送グループ HD	9,600	624.00	5,990,400	貸付株式数 3,100株
テレビ朝日ＨＤ	25,000	2,268.00	56,700,000	
スカパーJSATHD	80,100	889.00	71,208,900	
テレビ東京ＨＤ	6,300	3,005.00	18,931,500	貸付株式数 2,400株
日本ＢＳ放送	400	891.00	356,400	貸付株式数 300株
ビジョン	15,400	1,312.00	20,204,800	貸付株式数 5,800株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スマートバリュー	300	323.00	96,900	貸付株式数 200株
U-NEXT HOLDINGS	34,700	1,707.00	59,232,900	貸付株式数 12,300株
ワイヤレスゲート	500	219.00	109,500	
日本通信	83,200	128.00	10,649,600	貸付株式数 33,900株
クロップス	100	1,010.00	101,000	
日本電信電話	30,674,900	154.90	4,751,542,010	
ＫＤＤＩ	758,500	4,949.00	3,753,816,500	
ソフトバンク	16,501,100	197.30	3,255,667,030	
光通信	11,900	35,020.00	416,738,000	
エムティーアイ	7,100	1,238.00	8,789,800	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	33,600	2,728.00	91,660,800	
ファイバーゲート	5,500	898.00	4,939,000	貸付株式数 2,100株
アイドママーケティングコミュ	300	233.00	69,900	貸付株式数 200株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	54,500	4,355.00	237,347,500	貸付株式数 9,300株
学研ホールディングス	18,900	995.00	18,805,500	
ゼンリン	17,600	817.00	14,379,200	
昭文社ホールディングス	500	392.00	196,000	
インプレスホールディングス	1,100	148.00	162,800	貸付株式数 1,000株
東京電力ＨＤ	864,700	462.30	399,750,810	貸付株式数 326,500株
中部電力	378,200	1,588.00	600,581,600	
関西電力	505,600	1,716.00	867,609,600	
中国電力	178,300	884.10	157,635,030	
北陸電力	104,800	855.50	89,656,400	貸付株式数 38,700株
東北電力	270,500	1,171.50	316,890,750	
四国電力	95,300	1,202.00	114,550,600	貸付株式数 30,300株
九州電力	236,700	1,405.00	332,563,500	
北海道電力	107,400	831.70	89,324,580	貸付株式数 42,200株
沖縄電力	25,700	931.00	23,926,700	
電源開発	77,200	2,539.50	196,049,400	
エフオン	7,300	385.00	2,810,500	
イーレックス	19,900	602.00	11,979,800	貸付株式数 7,600株
レノバ	27,900	702.00	19,585,800	貸付株式数 10,700株
東京瓦斯	194,300	4,354.00	845,982,200	
大阪瓦斯	201,900	3,262.00	658,597,800	
東邦瓦斯	40,400	4,057.00	163,902,800	貸付株式数 15,600株
北海道瓦斯	30,300	540.00	16,362,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	21,300	374.00	7,966,200	
西部ガスHLDGS	10,500	1,703.00	17,881,500	貸付株式数 4,200株
静岡ガス	23,200	1,014.00	23,524,800	貸付株式数 8,800株
メタウォーター	14,100	1,769.00	24,942,900	
アイネット	6,200	1,612.00	9,994,400	貸付株式数 2,300株
松 竹	5,900	11,420.00	67,378,000	貸付株式数 2,300株
東 宝	64,500	6,716.00	433,182,000	
エイチ・アイ・エス	33,800	1,595.00	53,911,000	貸付株式数 13,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東 映	17,000	6,260.00	106,420,000	貸付株式数 4,600株
ラックランド	4,400	1,783.00	7,845,200	貸付株式数 1,700株
NTTデータグループ	269,600	3,017.00	813,383,200	
共立メンテナンス	33,200	2,849.00	94,586,800	貸付株式数 12,800株 (600株)
イチネンホールディングス	10,200	1,855.00	18,921,000	
建設技術研究所	5,400	5,100.00	27,540,000	貸付株式数 1,600株
スペース	7,600	1,155.00	8,778,000	
アインホールディングス	15,000	4,291.00	64,365,000	貸付株式数 4,300株
燦ホールディングス	8,800	1,173.00	10,322,400	
ピー・シー・エー	6,800	2,107.00	14,327,600	
スバル興業	4,100	3,120.00	12,792,000	貸付株式数 600株
東京テアトル	400	1,070.00	428,000	貸付株式数 200株
タナベコンサルティンググル	4,500	1,232.00	5,544,000	
ビジネスＢ太田昭和	4,400	2,088.00	9,187,200	
ナ ガ ワ	2,800	6,450.00	18,060,000	貸付株式数 1,100株
東京都競馬	7,800	4,350.00	33,930,000	貸付株式数 3,000株
カナモト	16,400	3,270.00	53,628,000	
ＤＴＳ	18,700	4,225.00	79,007,500	
スクウェア・エニックス・HD	51,800	6,132.00	317,637,600	
シーイーシー	13,000	1,967.00	25,571,000	貸付株式数 4,900株
カプコン	205,000	3,433.00	703,765,000	
ニシオホールディングス	8,700	4,270.00	37,149,000	
アイ・エス・ビー	4,800	1,368.00	6,566,400	貸付株式数 1,200株
アゴーラ ホスピタリティーG	7,200	47.00	338,400	貸付株式数 6,800株
日本空港ビルデング	35,800	4,940.00	176,852,000	貸付株式数 8,300株
トランス・コスモス	13,500	3,390.00	45,765,000	
乃村工藝社	46,200	840.00	38,808,000	
ＳＣＳＫ	84,200	3,270.00	275,334,000	
藤田観光	4,700	7,940.00	37,318,000	貸付株式数 1,000株
KNT-CTホールディングス	6,300	1,177.00	7,415,100	貸付株式数 1,000株
トーカイ	9,400	2,286.00	21,488,400	
白 洋 舎	200	2,237.00	447,400	貸付株式数 100株
セコム	215,300	5,276.00	1,135,922,800	
ＮＳＷ	4,600	3,065.00	14,099,000	
セントラル警備保障	5,700	2,880.00	16,416,000	
アイネス	8,000	1,837.00	14,696,000	
丹青社	22,300	1,004.00	22,389,200	
メイテックグループホールデ	39,000	2,843.00	110,877,000	
ＴＫＣ	18,400	3,930.00	72,312,000	貸付株式数 3,500株
富士ソフト	26,300	9,771.00	256,977,300	
応用地質	9,900	2,448.00	24,235,200	
船井総研ホールディン	21,200	2,431.00	51,537,200	貸付株式数 8,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ＮＳＤ	39,700	3,420.00	135,774,000	貸付株式数 9,400株
進学会ホールディングス	400	202.00	80,800	貸付株式数 200株 (200株)
丸紅建材リース	100	3,075.00	307,500	
オ オ バ	800	972.00	777,600	
コナミグループ	38,600	15,065.00	581,509,000	
いであ	300	2,442.00	732,600	
学 究 社	4,200	2,012.00	8,450,400	
イオンディライト	11,300	4,325.00	48,872,500	
ナック	10,800	575.00	6,210,000	貸付株式数 2,400株
福井コンピュータHLDS	7,200	3,115.00	22,428,000	
ダイセキ	25,500	3,825.00	97,537,500	貸付株式数 2,600株
ステップ	3,900	2,131.00	8,310,900	
泉州電業	7,500	5,130.00	38,475,000	貸付株式数 2,800株
GENKI GLOBAL DIN	6,100	3,475.00	21,197,500	貸付株式数 200株
トラスコ中山	22,800	2,321.00	52,918,800	
ヤマダホールディングス	334,800	442.10	148,015,080	
オートバックスセブン	37,900	1,432.00	54,272,800	
モリト	8,700	1,508.00	13,119,600	
アークランズ	32,400	1,663.00	53,881,200	貸付株式数 12,600株
ニトリホールディングス	39,600	19,740.00	781,704,000	
グルメ杵屋	8,800	1,051.00	9,248,800	貸付株式数 2,500株
愛 眼	1,100	142.00	156,200	
ケーユーホールディングス	6,400	1,099.00	7,033,600	
吉野家ホールディングス	42,600	3,168.00	134,956,800	貸付株式数 16,400株 (4,400株)
加藤産業	13,500	4,540.00	61,290,000	
北恵	300	794.00	238,200	貸付株式数 100株
イノテック	7,400	1,362.00	10,078,800	
イエローハット	19,200	2,672.00	51,302,400	貸付株式数 5,400株
松屋フーズHLDGS	5,100	6,760.00	34,476,000	
JBCCホールディングス	6,800	4,515.00	30,702,000	
JKホールディングス	8,200	1,036.00	8,495,200	
サガミホールディングス	17,500	1,770.00	30,975,000	貸付株式数 5,400株 (5,400株)
日 伝	6,200	3,040.00	18,848,000	貸付株式数 2,400株
ミロク情報サービス	9,400	1,927.00	18,113,800	貸付株式数 900株
北沢産業	800	352.00	281,600	貸付株式数 700株
杉本商事	9,600	1,392.00	13,363,200	貸付株式数 1,500株
因幡電機産業	30,400	3,906.00	118,742,400	
王将フードサービス	21,500	3,045.00	65,467,500	貸付株式数 4,400株
ミニストップ	8,900	1,692.00	15,058,800	貸付株式数 3,400株 (1,200株)
アークス	18,100	2,593.00	46,933,300	貸付株式数 2,000株
バローホールディングス	20,500	2,127.00	43,603,500	
東 テ ク	10,900	2,638.00	28,754,200	
ミスミグループ本社	164,400	2,414.50	396,943,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
アルテック	600	213.00	127,800	
ベ ル ク	5,400	6,650.00	35,910,000	
大 庄	6,500	1,067.00	6,935,500	貸付株式数 2,400株 (300株)
タキヒヨー	300	1,231.00	369,300	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	61,200	52,490.00	3,212,388,000	
ソフトバンクグループ	508,700	9,434.00	4,799,075,800	
蔵王産業	200	2,434.00	486,800	
スズケン	35,900	4,679.00	167,976,100	貸付株式数 6,800株
サンドラッグ	36,600	3,937.00	144,094,200	
サックスバーホールディング	10,300	968.00	9,970,400	貸付株式数 3,000株
ジェコス	6,400	999.00	6,393,600	
ヤマザワ	200	1,180.00	236,000	
や ま や	300	2,868.00	860,400	貸付株式数 100株
ベルーナ	26,200	776.00	20,331,200	貸付株式数 6,600株
合計			400,098,341,150	

（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。

リクルートホールディングス	35,000株
日 立	80,000株
トヨタ自動車	60,000株
三菱商事	60,000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12月18日現在 金　額（円）	2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,877,453,939	1,666,500,509
コール・ローン	10,490,926,784	16,316,826,115
株式	389,010,712,465	656,595,315,530
投資証券	8,581,493,156	12,506,235,965
派生商品評価勘定	263,383,037	336,584,772
未収入金	3,481,831	4,596,994
未収配当金	438,781,439	523,072,149
差入委託証拠金	8,488,313,058	9,094,372,389
流動資産合計	419,154,545,709	697,043,504,423
資産合計	419,154,545,709	697,043,504,423
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	316,522,472	91,801,958
未払解約金	109,420,000	345,686,100
流動負債合計	425,942,472	437,488,058
負債合計	425,942,472	437,488,058
純資産の部		
元本等		
元本　※1	79,048,744,098	97,471,314,337
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	339,679,859,139	599,134,702,028
元本等合計	418,728,603,237	696,606,016,365
純資産合計	418,728,603,237	696,606,016,365
負債純資産合計	419,154,545,709	697,043,504,423

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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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。
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

区分	自 2023 年 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 日
	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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1.　※1　期首	2022 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 19 日
期首元本額	69,638,060,038 円	79,048,744,098 円
期中追加設定元本額	13,935,683,680 円	26,368,558,518 円
期中一部解約元本額	4,524,999,620 円	7,945,988,279 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	252,201,357 円	216,835,107 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,398,033 円	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)	25,425,788 円	15,640,386 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,173,336 円	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)	130,046,867 円	85,662,411 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）	101,924,857 円	114,845,246 円
ダイワバランスファンド 2023-01（適格機関投資家専用）	89,930,302 円	77,052,001 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	8,670,747,397 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）	730,644,158 円	763,141,440 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）	4,665,956,172 円	6,049,980,216 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）	560,421,539 円	570,811,387 円
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国株式インデックス	20,707,782 円	15,964,093 円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	53,190,442円	45,602,828円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	7,628,470,875円	9,804,220,171円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,483,678,196円	1,523,216,776円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	322,769,357円	347,680,301円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	2,911,681円	18,710,984円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	47,632,499,577円	51,367,234,653円
ダイワ・ライフ・バランス３０	500,377,466円	433,707,038円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,067,785,681円	1,018,865,470円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,025,339,397円	997,600,353円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	2,015,691,298円	1,098,357,050円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,498,122円	9,588,199円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	13,060,578円	11,192,828円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,142,692,877円	2,863,091,211円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,057,594円	1,774,665円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,504,278円	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,295,411円	13,195,933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）	11,578,719円	16,128,054円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	52,676,509円	40,010,033円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	33,932,785円	28,225,334円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	900,545,333円	629,488,881円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	48,117,622円	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）	140,109,625円	122,278,441円
スタイル９（4資産分散・保守型）	36,916円	330,995円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	62,672円	2,357,489円
スタイル９（4資産分散・積極型）	88,640円	3,464,255円
スタイル９（6資産分散・保守型）	31,336円	136,863円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	55,374円	4,334,111円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
スタイル９（6資産分散・積極型）	88,833円	5,039,343円
スタイル９（8資産分散・保守型）	28,073円	192,325円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	47,882円	3,078,619円
スタイル９（8資産分散・積極型）	84,991円	9,781,176円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,390,103,806円	1,191,855,722円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	433,076,574円	426,013,289円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,336,572,680円	5,254,796,860円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,037,904,988円	3,267,571,895円
ダイワライフスタイル２５	8,563,694円	6,633,135円
ダイワライフスタイル５０	38,800,537円	31,382,448円
ダイワライフスタイル７５	32,426,160円	27,178,582円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	89,157,328円	76,831,150円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	−円	74,807,979円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	−円	73,610,332円
計	79,048,744,098円	97,471,314,337円
2. 期末日における受益権の総数	79,048,744,098口	97,471,314,337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12月19日 至2024年12月18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。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。

区分	自 2023 年 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 日
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 12 月 18 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 12 月 18 日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024 年 12 月 18 日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	13,600,937,161	2,626,177,855
投資証券	605,967,111	△738,328,149
合計	14,206,904,272	1,887,849,706

（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 12 月 18 日現在				2024 年 12 月 18 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								

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
買建	21,247,150,443	－	21,504,373,808	257,223,365	27,573,598,772	－	27,491,378,576	△82,220,196
合計	21,247,150,443	－	21,504,373,808	257,223,365	27,573,598,772	－	27,491,378,576	△82,220,196

（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12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	10,824,965,810	－	10,514,603,010	△310,362,800	15,762,598,220	－	16,089,601,230	327,003,010
アメリカ・ドル	6,537,435,720	－	6,344,549,120	△192,886,600	9,734,075,170	－	9,978,085,320	244,010,150
イギリス・ポンド	368,829,410	－	359,306,400	△9,523,010	1,175,821,140	－	1,207,703,580	31,882,440
オーストラリア・ドル	660,238,240	－	646,463,080	△13,775,160	659,684,120	－	659,957,680	273,560
カナダ・ドル	996,957,150	－	974,235,840	△22,721,310	1,716,631,230	－	1,725,598,000	8,966,770
スイス・フラン	825,467,070	－	799,299,270	△26,167,800	1,308,759,250	－	1,326,447,430	17,688,180
ユーロ	1,436,038,220	－	1,390,749,300	△45,288,920	1,167,627,310	－	1,191,809,220	24,181,910
合計	10,824,965,810	－	10,514,603,010	△310,362,800	15,762,598,220	－	16,089,601,230	327,003,010

（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12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.2971円 (52,971円)	7.1468円 (71,468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	7,600	229.690	1,745,644.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	42,000	201.240	8,452,080.000	
	FIRST SOLAR INC	6,600	188.270	1,242,582.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,200	166.300	1,862,560.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,400	135.800	1,140,720.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	25,500	67.190	1,713,345.000	
	ABBOTT LABORATORIES	111,966	113.290	12,684,628.140	
	HOWMET AEROSPACE INC	24,983	111.930	2,796,347.190	
	VERISK ANALYTICS INC	9,200	280.220	2,578,024.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	23,700	53.640	1,271,268.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	77,600	74.260	5,762,576.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,200	628.220	2,010,304.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,100	83.170	2,919,267.000	
	QORVO INC	6,020	70.950	427,119.000	
	AFLAC INC	34,300	102.750	3,524,325.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	7,600	165.460	1,257,496.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	10,400	137.860	1,433,744.000	
	ADOBE INC	28,320	455.230	12,892,113.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,500	86.680	996,820.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	7,200	390.590	2,812,248.000	
	GARMIN LTD	9,900	210.890	2,087,811.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,400	304.710	4,387,824.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41,800	233.130	9,744,834.000	
	WR BERKLEY CORP	19,613	58.850	1,154,225.050	
	AUTOZONE INC	1,120	3,319.110	3,717,403.200	
	DOLLAR TREE INC	13,171	70.110	923,418.810	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	76,900	20.880	1,605,672.000	
	CELANESE CORP	7,050	68.410	482,290.500	
	DR HORTON INC	18,916	146.710	2,775,166.360	
	AUTODESK INC	13,900	302.820	4,209,198.000	
	MOODY'S CORP	10,600	485.630	5,147,678.000	
	DEVON ENERGY CORP	40,300	32.170	1,296,451.000	
	ALBEMARLE CORP	7,600	97.550	741,380.000	
	ATMOS ENERGY CORP	10,100	141.380	1,427,938.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	16,600	59.570	988,862.000	
	CITIGROUP INC	122,773	71.120	8,731,615.760	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,300	295.570	7,773,491.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,300	91.920	3,152,856.000	
	DOMINO'S PIZZA INC	2,230	446.740	996,230.200	
	HESS CORP	17,900	134.410	2,405,939.000	
	DAVITA INC	2,950	147.570	435,331.500	
	DANAHER CORP	41,850	233.530	9,773,230.500	
	FORTIVE CORP	22,600	75.730	1,711,498.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	37,000	152.790	5,653,230.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31,000	51.490	1,596,190.000	
	APPLE INC	980,500	253.480	248,537,140.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,200	173.880	2,816,856.000	
	BOEING CO/THE	46,900	173.030	8,115,107.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,115	147.800	1,494,997.000	
	BECTON DICKINSON AND CO	18,599	225.640	4,196,678.360	
	LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	150.140	1,246,162.000	
	NISOURCE INC	28,900	36.210	1,046,469.000	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,600	108.880	827,488.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	47,571	78.450	3,731,944.950	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	270,904	40.780	11,047,465.120	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	85,350	455.660	38,890,581.000	
	ANSYS INC	5,700	343.070	1,955,499.000	
	TRUIST FINANCIAL CORP	86,217	45.130	3,890,973.210	
	BLACKSTONE GROUP INC/THE	46,400	183.110	8,496,304.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	130,500	57.650	7,523,325.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	183,070	238.360	43,636,565.200	
	T ROWE PRICE GROUP INC	14,400	117.890	1,697,616.000	
	LKQ CORP	16,700	36.610	611,387.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,812	42.740	504,844.880	
	CADENCE DESIGN SYS INC	17,700	311.350	5,510,895.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,400	541.860	3,467,904.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	14,200	76.000	1,079,200.000	
	SERVICENOW INC	13,300	1,114.720	14,825,776.000	
	CATERPILLAR INC	31,200	375.800	11,724,960.000	
	BROWN & BROWN INC	15,700	103.180	1,619,926.000	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	16,800	37.990	638,232.000	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	3,400	189.330	643,722.000	
	CMS ENERGY CORP	19,300	67.040	1,293,872.000	
	MOSAIC CO/THE	20,100	25.440	511,344.000	
	DELTA AIR LINES INC	10,400	60.810	632,424.000	
	CORNING INC	52,400	47.760	2,502,624.000	
	CISCO SYSTEMS INC	256,750	58.520	15,025,010.000	
	MORGAN STANLEY	78,152	127.740	9,983,136.480	
	DECKERS OUTDOOR CORP	9,900	210.370	2,082,663.000	
	MSCI INC	5,100	611.500	3,118,650.000	
	FAIR ISAAC CORP	1,600	2,138.180	3,421,088.000	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	2,100	657.590	1,380,939.000	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,000	295.060	1,180,240.000	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,300	76.030	1,087,229.000	
	BROADCOM INC	285,620	240.230	68,614,492.600	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	2,800	379.690	1,063,132.000	
	CNH INDUSTRIAL NV	56,500	11.600	655,400.000	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,800	225.970	858,686.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,300	246.580	2,046,614.000	
	DTE ENERGY COMPANY	13,400	120.700	1,617,380.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CENTENE CORP	33,907	57.810	1,960,163.670	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,800	198.080	1,346,944.000	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	28,900	44.740	1,292,986.000	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,100	282.910	3,989,031.000	
	GARTNER INC	5,050	497.420	2,511,971.000	
	DOMINION ENERGY INC	54,041	53.590	2,896,057.190	
	MONSTER BEVERAGE CORP	47,300	51.950	2,457,235.000	
	SMITH (A.O.) CORP	7,800	70.810	552,318.000	
	DEERE & CO	16,800	443.590	7,452,312.000	
	QUANTA SERVICES INC	9,500	336.430	3,196,085.000	
	POOL CORP	2,500	358.550	896,375.000	
	GLOBAL PAYMENTS INC	16,384	114.700	1,879,244.800	
	BURLINGTON STORES INC	4,100	291.220	1,194,002.000	
	NASDAQ INC	27,800	79.610	2,213,158.000	
	TARGA RESOURCES CORP	13,400	181.220	2,428,348.000	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	137.910	634,386.000	
	WESTLAKE CORP	2,500	117.540	293,850.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	22,300	90.840	2,025,732.000	
	TELEFLEX INC	3,100	178.280	552,668.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,300	177.310	939,743.000	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,700	334.260	1,571,022.000	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,300	337.850	439,205.000	
	CATALENT INC	11,700	63.480	742,716.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,900	226.410	2,241,459.000	
	MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	291.780	1,108,764.000	
	CARLISLE COS INC	3,000	404.630	1,213,890.000	
	IDEX CORP	4,900	222.190	1,088,731.000	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	50,000	93.490	4,674,500.000	
	ROLLINS INC	18,707	48.220	902,051.540	
	AECOM	8,600	110.400	949,440.000	
	WATSCO INC	2,300	508.470	1,169,481.000	
	GRACO INC	10,900	86.210	939,689.000	
	AMETEK INC	14,900	186.710	2,781,979.000	
	TORO CO	6,500	85.310	554,515.000	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	15,800	105.800	1,671,640.000	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,450	53.940	563,673.000	
	HEICO CORP	2,900	259.800	753,420.000	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,500	488.810	1,222,025.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,800	75.440	1,267,392.000	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	2,800	607.940	1,702,232.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	28,560	982.080	28,048,204.800	
	EPAM SYSTEMS INC	3,700	247.920	917,304.000	
	RPM INTERNATIONAL INC	8,300	131.420	1,090,786.000	
	RELIANCE INC	3,600	280.070	1,008,252.000	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	88,200	64.290	5,670,378.000	
	CUMMINS INC	8,900	361.230	3,214,947.000	
	CDW CORP/DE	8,600	176.660	1,519,276.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	COSTAR GROUP INC	26,400	73.130	1,930,632.000	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	12,400	198.980	2,467,352.000	
	MERCADOLIBRE INC	2,990	1,809.120	5,409,268.800	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,700	177.670	835,049.000	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,916	250.270	3,983,297.320	
	DEXCOM INC	25,800	77.800	2,007,240.000	
	NORDSON CORP	3,590	224.010	804,195.900	
	COPART INC	55,800	60.670	3,385,386.000	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	12,300	160.140	1,969,722.000	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,600	228.810	1,052,526.000	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,900	329.400	1,614,060.000	
	TRANSDIGM GROUP INC	3,690	1,274.240	4,701,945.600	
	BIO-TECHNE CORP	10,220	75.270	769,259.400	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,500	136.690	888,485.000	
	KINDER MORGAN INC	128,781	26.610	3,426,862.410	
	HCA HEALTHCARE INC	12,500	307.780	3,847,250.000	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,500	234.900	587,250.000	
	COTERRA ENERGY INC	47,600	24.520	1,167,152.000	
	T-MOBILE US INC	33,827	220.710	7,465,957.170	
	ZILLOW GROUP INC - C	9,950	80.770	803,661.500	
	EMCOR GROUP INC	3,000	476.900	1,430,700.000	
	COCA-COLA CO/THE	263,550	63.400	16,709,070.000	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,200	77.550	1,023,660.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	9,150	115.920	1,060,668.000	
	FRANKLIN RESOURCES INC	18,200	21.340	388,388.000	
	CSX CORP	124,700	32.930	4,106,371.000	
	EXPEDIA GROUP INC	8,025	180.640	1,449,636.000	
	AMAZON.COM INC	608,200	231.150	140,585,430.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	38,800	74.120	2,875,856.000	
	EXXON MOBIL CORP	285,809	108.010	30,870,230.090	
	AES CORP	45,800	12.870	589,446.000	
	EVEREST GROUP LTD	2,800	355.060	994,168.000	
	EOG RESOURCES INC	36,600	123.150	4,507,290.000	
	EQT CORP	36,400	44.200	1,608,880.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	9,800	97.360	954,128.000	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	2,107.940	1,475,558.000	
	CENCORA INC	11,500	227.640	2,617,860.000	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,500	136.460	2,524,510.000	
	FORD MOTOR CO	251,223	9.970	2,504,693.310	
	EXACT SCIENCES CORP	11,900	60.370	718,403.000	
	ENTEGRIS INC	9,800	109.360	1,071,728.000	
	MICROSTRATEGY INC-CL A	11,900	386.420	4,598,398.000	
	AERCAP HOLDINGS NV	12,200	95.110	1,160,342.000	
	FORTINET INC	41,900	97.620	4,090,278.000	
	MARKEL CORP	820	1,710.140	1,402,314.800	
	NEXTERA ENERGY INC	132,280	72.270	9,559,875.600	
	FREEPORT-MCMORAN INC	92,508	40.620	3,757,674.960	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	INSULET CORP	4,600	263.350	1,211,410.000	
	US BANCORP	100,500	49.980	5,022,990.000	
	UNITED RENTALS INC	4,300	758.390	3,261,077.000	
	F5 NETWORKS INC	3,800	259.800	987,240.000	
	SUPER MICRO COMPUTER INC	34,000	33.800	1,149,200.000	
	FASTENAL CO	36,900	77.640	2,864,916.000	
	FISERV INC	37,033	204.150	7,560,286.950	
	GENERAL ELECTRIC CO	69,806	165.800	11,573,834.800	
	AXON ENTERPRISE INC	4,700	635.760	2,988,072.000	
	GENERAL MOTORS CO	72,300	51.150	3,698,145.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	15,100	265.220	4,004,822.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,350	574.680	11,694,738.000	
	ALPHABET INC-CL A	377,000	195.420	73,673,340.000	
	ALPHABET INC-CL C	323,440	197.120	63,756,492.800	
	OWENS CORNING	5,600	183.210	1,025,976.000	
	GENERAL MILLS INC	35,800	65.930	2,360,294.000	
	FIRSTENERGY CORP	35,218	39.840	1,403,085.120	
	GENUINE PARTS CO	9,050	118.490	1,072,334.500	
	FIFTH THIRD BANCORP	43,600	45.050	1,964,180.000	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,250	218.450	2,676,012.500	
	HALLIBURTON CO	56,800	27.190	1,544,392.000	
	HOME DEPOT INC	63,950	408.470	26,121,656.500	
	ASSURANT INC	3,350	213.120	713,952.000	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,500	16.940	1,583,890.000	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,610	193.490	505,008.900	
	HERSHEY CO/THE	9,500	177.630	1,687,485.000	
	HUMANA INC	7,800	233.890	1,824,342.000	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	16,400	219.020	3,591,928.000	
	HENRY SCHEIN INC	8,100	73.180	592,758.000	
	HP INC	62,000	33.840	2,098,080.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	83,600	21.540	1,800,744.000	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	24,300	90.530	2,199,879.000	
	KRAFT HEINZ CO/THE	58,403	31.250	1,825,093.750	
	ENPHASE ENERGY INC	8,600	73.400	631,240.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	59,300	228.970	13,577,921.000	
	HUBBELL INC	3,500	439.530	1,538,355.000	
	INTERNATIONAL PAPER CO	21,300	55.240	1,176,612.000	
	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,900	73.800	583,020.000	
	ZOETIS INC	29,200	170.790	4,987,068.000	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,599	391.790	5,719,742.210	
	CHENIERE ENERGY INC	14,600	210.680	3,075,928.000	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	157.640	457,156.000	
	ALLEGION PLC	5,650	136.640	772,016.000	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,500	160.120	1,200,900.000	
	WASTE CONNECTIONS INC	16,637	176.260	2,932,437.620	
	JUNIPER NETWORKS INC	16,900	37.660	636,454.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	JM SMUCKER CO/THE	6,900	114.560	790,464.000	
	JOHNSON & JOHNSON	155,000	146.410	22,693,550.000	
	ABBVIE INC	113,672	175.380	19,935,795.360	
	HOLOGIC INC	15,000	72.260	1,083,900.000	
	KIMBERLY-CLARK CORP	21,700	131.140	2,845,738.000	
	KROGER CO	44,300	61.170	2,709,831.000	
	KLA CORP	8,700	654.880	5,697,456.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	13,800	490.610	6,770,418.000	
	CORPAY INC	4,300	352.100	1,514,030.000	
	LOWE'S COS INC	36,500	257.750	9,407,875.000	
	ELI LILLY & CO	51,985	778.620	40,476,560.700	
	LAM RESEARCH CORP	83,400	77.810	6,489,354.000	
	LOEWS CORP	12,000	83.640	1,003,680.000	
	MCDONALD'S CORP	46,150	296.080	13,664,092.000	
	3M CO	35,390	128.050	4,531,689.500	
	META PLATFORMS INC CLASS A	140,700	619.440	87,155,208.000	
	S&P GLOBAL INC	20,639	500.510	10,330,025.890	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,000	544.780	2,179,120.000	
	PHILLIPS 66	27,000	115.830	3,127,410.000	
	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	10,300	269.790	2,778,837.000	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,750	35.370	521,707.500	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,300	80.310	1,309,053.000	
	METLIFE INC	38,300	81.250	3,111,875.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	55,800	112.250	6,263,550.000	
	ARISTA NETWORKS INC	68,800	112.950	7,770,960.000	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,798	461.750	4,985,976.500	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,400	1,246.880	1,745,632.000	
	BAKER HUGHES CO	63,923	41.410	2,647,051.430	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	7,300	293.490	2,142,477.000	
	MERCK & CO. INC.	163,121	100.060	16,321,887.260	
	DUPONT DE NEMOURS INC	26,951	80.130	2,159,583.630	
	MASCO CORP	14,100	76.580	1,079,778.000	
	M & T BANK CORP	10,799	196.150	2,118,223.850	
	MARSH & MCLENNAN COS	31,670	213.180	6,751,410.600	
	HEICO CORP-CLASS A	4,920	202.340	995,512.800	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,402	289.440	4,457,954.880	
	WORKDAY INC-CLASS A	13,800	278.010	3,836,538.000	
	BLOCK INC CLASS A	35,812	94.550	3,386,024.600	
	TRANSUNION	12,600	98.250	1,237,950.000	
	VISTRA CORP	22,100	139.770	3,088,917.000	
	NETAPP INC	13,200	122.490	1,616,868.000	
	NIKE INC -CL B	76,600	78.000	5,974,800.000	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	14,600	242.470	3,540,062.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34,600	58.290	2,016,834.000	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,605	157.900	1,990,329.500	
	ALLY FINANCIAL INC	17,700	36.590	647,643.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	9,000	480.290	4,322,610.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	APTIV PLC	17,100	57.860	989,406.000	
	NEWMONT CORP	73,611	39.800	2,929,717.800	
	MCKESSON CORP	8,400	562.780	4,727,352.000	
	XYLEM INC	15,700	120.770	1,896,089.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,100	126.040	12,616,604.000	
	NUCOR CORP	15,300	120.980	1,850,994.000	
	SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,400	474.370	4,933,448.000	
	GODADDY INC - CLASS A	9,100	207.460	1,887,886.000	
	EVERGY INC	14,850	61.500	913,275.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,724	46.560	1,896,109.440	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,650	424.340	700,161.000	
	OKTA INC	10,500	85.420	896,910.000	
	WIX.COM LTD	3,610	218.980	790,517.800	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	20,400	46.570	950,028.000	
	KKR & CO INC	40,000	151.230	6,049,200.000	
	PAYCHEX INC	20,900	140.280	2,931,852.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	1,246.080	4,735,104.000	
	ALTRIA GROUP INC	109,800	54.130	5,943,474.000	
	P G & E CORP	130,700	19.710	2,576,097.000	
	PFIZER INC	364,713	26.430	9,639,364.590	
	CIGNA CORP	18,000	265.590	4,780,620.000	
	DELL TECHNOLOGIES -C	20,601	118.280	2,436,686.280	
	XCEL ENERGY INC	35,900	68.080	2,444,072.000	
	STERIS PLC	6,400	209.510	1,340,864.000	
	SEA LTD-ADR	25,100	115.790	2,906,329.000	
	FOX CORP - CLASS B	9,133	46.470	424,410.510	
	FOX CORP - CLASS A	14,499	49.070	711,465.930	
	STRYKER CORP	22,080	370.810	8,187,484.800	
	DOW INC	45,118	40.570	1,830,437.260	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,500	133.290	999,675.000	
	ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	16,100	84.600	1,362,060.000	
	PARKER HANNIFIN CORP	8,300	665.990	5,527,717.000	
	UBER TECHNOLOGIES INC	121,800	61.030	7,433,454.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	151,167	170.330	25,748,275.110	
	EXELON CORP	64,422	36.520	2,352,691.440	
	INGERSOLL-RAND INC	26,008	97.550	2,537,080.400	
	NVR INC	200	8,468.490	1,693,698.000	
	CONOCOPHILLIPS	83,803	98.260	8,234,482.780	
	TWILIO INC - A	9,800	109.760	1,075,648.000	
	DOCUSIGN INC	13,100	98.170	1,286,027.000	
	PAYCOM SOFTWARE INC	3,400	232.970	792,098.000	
	DAYFORCE INC	10,200	77.460	790,092.000	
	PURE STORAGE INC - CLASS A	20,100	65.760	1,321,776.000	
	PEPSICO INC	88,300	156.140	13,787,162.000	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,020	317.820	959,816.400	
	MONGODB INC	4,800	265.100	1,272,480.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SNAP INC - A	67,900	11.180	759,122.000	
	CORTEVA INC	44,568	58.570	2,610,347.760	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,000	118.890	2,734,470.000	
	AMCOR PLC	93,100	9.730	905,863.000	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,000	376.420	5,646,300.000	
	ROKU INC	8,200	83.390	683,798.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,600	129.180	1,627,668.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	40,300	357.300	14,399,190.000	
	PENTAIR PLC	10,675	105.490	1,126,105.750	
	QUALCOMM INC	71,700	157.920	11,322,864.000	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,900	77.540	1,155,346.000	
	DATADOG INC - CLASS A	18,100	156.910	2,840,071.000	
	PINTEREST INC- CLASS A	38,900	31.000	1,205,900.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	7,000	740.010	5,180,070.000	
	REPUBLIC SERVICES INC	14,200	205.620	2,919,804.000	
	BOOKING HOLDINGS INC	2,200	5,154.960	11,340,912.000	
	ROSS STORES INC	21,400	150.850	3,228,190.000	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	5,830	232.550	1,355,766.500	
	RESMED INC	9,500	242.620	2,304,890.000	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	7,230	155.490	1,124,192.700	
	MODERNA INC	21,100	40.760	860,036.000	
	HUBSPOT INC	3,180	741.670	2,358,510.600	
	REVVITY INC	8,000	114.750	918,000.000	
	CARRIER GLOBAL CORP	52,287	70.280	3,674,730.360	
	OTIS WORLDWIDE CORP	25,838	96.340	2,489,232.920	
	AVANTOR INC	43,800	21.980	962,724.000	
	CARLYLE GROUP INC/THE	14,700	51.780	761,166.000	
	DYNATRACE INC	19,300	55.500	1,071,150.000	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	29,000	135.020	3,915,580.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	58,885	24.610	1,449,159.850	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	24,100	25.120	605,392.000	
	MATCH GROUP INC	15,800	31.580	498,964.000	
	CHEVRON CORP	111,818	148.110	16,561,363.980	
	ZSCALER INC	5,900	200.450	1,182,655.000	
	EDISON INTERNATIONAL	24,900	80.500	2,004,450.000	
	TESLA INC	185,050	479.860	88,798,093.000	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,500	170.810	3,330,795.000	
	GEN DIGITAL INC	35,300	29.380	1,037,114.000	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	10,002	82.210	822,264.420	
	SYNOPSYS INC	9,900	511.870	5,067,513.000	
	CARVANA CO	7,800	253.700	1,978,860.000	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,600	117.560	2,304,176.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,005	371.030	2,228,035.150	
	VIATRIS INC	76,821	12.590	967,176.390	
	DOORDASH INC - A	19,850	177.000	3,513,450.000	
	ROBLOX CORP -CLASS A	30,900	61.250	1,892,625.000	
	AIRBNB INC-CLASS A	28,400	132.240	3,755,616.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CBRE GROUP INC - A	19,800	135.830	2,689,434.000	
	SOUTHERN CO/THE	70,500	83.280	5,871,240.000	
	SYSCO CORP	31,600	78.030	2,465,748.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	14,703	243.640	3,582,238.920	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,900	86.180	336,102.000	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	7,000	85.120	595,840.000	
	STEEL DYNAMICS INC	9,450	118.580	1,120,581.000	
	SCHLUMBERGER LTD	91,352	38.930	3,556,333.360	
	AT&T INC	461,491	22.830	10,535,839.530	
	APA CORP	23,300	21.050	490,465.000	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	9,750	32.810	319,897.500	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	27,600	67.740	1,869,624.000	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,500	362.790	5,623,245.000	
	SEMPRA ENERGY	40,800	86.960	3,547,968.000	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,300	48.540	499,962.000	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	131,100	74.390	9,752,529.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,650	94.490	1,289,788.500	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,500	311.640	3,895,500.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	58,800	188.120	11,061,456.000	
	SALESFORCE.COM INC	61,566	350.970	21,607,819.020	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	25,709	176.320	4,533,010.880	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	43,034	81.850	3,522,332.900	
	TERADYNE INC	10,600	128.010	1,356,906.000	
	UNION PACIFIC CORP	39,280	229.880	9,029,686.400	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,488	137.990	2,965,129.120	
	RTX CORP	85,679	117.420	10,060,428.180	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,200	127.320	6,009,504.000	
	IQVIA HOLDINGS INC	11,804	196.640	2,321,138.560	
	AMEREN CORPORATION	17,200	88.680	1,525,296.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	59,466	485.520	28,871,932.320	
	APPLOVIN CORP CLASS A	13,400	337.890	4,527,726.000	
	TOAST INC CLASS A	25,400	38.180	969,772.000	
	VERISIGN INC	5,700	195.210	1,112,697.000	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	48,400	14.700	711,480.000	
	ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	34,400	41.630	1,432,072.000	
	VALERO ENERGY CORP	20,642	124.890	2,577,979.380	
	ULTA BEAUTY INC	3,100	423.570	1,313,067.000	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	16,788	58.330	979,244.040	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,830	182.600	699,358.000	
	ELEVANCE HEALTH INC	15,000	366.300	5,494,500.000	
	WALT DISNEY CO/THE	116,762	113.020	13,196,441.240	
	WELLS FARGO & CO	218,822	70.810	15,494,785.820	
	WASTE MANAGEMENT INC	25,900	209.000	5,413,100.000	
	WILLIAMS COS INC	78,500	53.690	4,214,665.000	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,000	275.210	1,926,470.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WALMART INC	284,500	95.420	27,146,990.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,100	108.060	1,415,586.000	
	WYNN RESORTS LTD	6,400	91.960	588,544.000	
	GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	143,300	5.140	736,562.000	
	WABTEC CORP	11,311	198.190	2,241,727.090	
	TJX COMPANIES INC	72,600	123.060	8,934,156.000	
	WATERS CORP	3,900	373.720	1,457,508.000	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,400	395.000	1,343,000.000	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	47,300	9.970	471,581.000	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,563	310.530	2,038,008.390	
	WILLIAMS-SONOMA INC	8,200	198.210	1,625,322.000	
	WESTERN DIGITAL CORP	22,400	64.640	1,447,936.000	
	WEC ENERGY GROUP INC	20,400	94.710	1,932,084.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,100	85.450	2,742,945.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	107,850	318.300	34,328,655.000	
	PPL CORP	47,500	32.260	1,532,350.000	
	CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	20,124	234.240	4,713,845.760	
	PULTEGROUP INC	13,350	115.890	1,547,131.500	
	WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	149,953	11.350	1,701,966.550	
	PPG INDUSTRIES INC	15,100	122.060	1,843,106.000	
	NORTHERN TRUST CORP	13,000	104.710	1,361,230.000	
	NVIDIA CORP	1,580,200	130.390	206,042,278.000	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	25,613	198.300	5,079,057.900	
	DRAFTKINGS INC CLASS A	28,200	40.720	1,148,304.000	
	ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,900	249.250	473,575.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	18,400	59.400	1,092,960.000	
	NETFLIX INC	27,690	919.130	25,450,709.700	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,600	528.840	13,009,464.000	
	NRG ENERGY INC	13,350	91.420	1,220,457.000	
	TEXTRON INC	12,000	80.070	960,840.000	
	NEWS CORP - CLASS A	24,487	28.250	691,757.750	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,203.660	1,624,941.000	
	OMNICOM GROUP	12,600	88.970	1,121,022.000	
	JACOBS SOLUTIONS INC	8,020	134.660	1,079,973.200	
	ORACLE CORP	107,033	169.710	18,164,570.430	
	MASTERCARD INC - A	53,100	531.010	28,196,631.000	
	ONEOK INC	37,600	101.780	3,826,928.000	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	6,900	536.750	3,703,575.000	
	U HAUL NON VOTING SERIES N	6,300	65.960	415,548.000	
	ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	12,200	178.330	2,175,626.000	
	EXPAND ENERGY CORP	13,500	96.750	1,306,125.000	
	HF SINCLAIR CORP	10,500	35.760	375,480.000	
	OVINTIV INC	17,000	38.980	662,660.000	
	YUM! BRANDS INC	18,100	134.730	2,438,613.000	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	11,400	185.930	2,119,602.000	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,700	59.250	693,225.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BANK OF AMERICA CORP	449,301	45.050	20,241,010.050	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,100	470.660	1,459,046.000	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,300	67.190	826,437.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	36,600	301.340	11,029,044.000	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	29,535	79.250	2,340,648.750	
	LINDE PLC	30,746	430.200	13,226,929.200	
	ANALOG DEVICES INC	31,991	213.820	6,840,315.620	
	ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	24,300	19.320	469,476.000	
	MONDAYCOM LTD	2,600	251.800	654,680.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	104,227	125.020	13,030,459.540	
	COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	29.990	515,828.000	
	LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	13,600	94.900	1,290,640.000	
	KENVUE INC	123,300	22.040	2,717,532.000	
	GLOBAL E ONLINE LTD	6,800	56.820	386,376.000	
	VERALTO CORP	15,916	103.460	1,646,669.360	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,372	71.220	2,946,513.840	
	BUNGE GLOBAL LTD	9,200	81.270	747,684.000	
	VERTIV HOLDINGS CLASS A	23,000	120.690	2,775,870.000	
	NUTANIX INC CLASS A	17,100	66.140	1,130,994.000	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,300	90.740	934,622.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,800	242.070	3,824,706.000	
	AVERY DENNISON CORP	5,230	191.460	1,001,335.800	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	31,900	81.030	2,584,857.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	36,900	128.080	4,726,152.000	
	AON PLC-CLASS A	12,600	358.880	4,521,888.000	
	AMGEN INC	34,600	265.950	9,201,870.000	
	SAMSARA INC CLASS A	14,100	46.780	659,598.000	
	EATON CORP PLC	25,636	347.080	8,897,742.880	
	COOPER INC	12,900	94.490	1,218,921.000	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,600	233.090	2,470,754.000	
	APPLIED MATERIALS INC	53,100	170.340	9,045,054.000	
	CME GROUP INC	23,200	235.990	5,474,968.000	
	ECOLAB INC	16,500	246.170	4,061,805.000	
	EQUIFAX INC	8,000	273.670	2,189,360.000	
	GILEAD SCIENCES INC	80,200	92.800	7,442,560.000	
	KEURIG DR PEPPER INC	74,500	33.040	2,461,480.000	
	HORMEL FOODS CORP	19,500	32.150	626,925.000	
	STATE STREET CORP	19,013	98.700	1,876,583.100	
	SOLVENTUM CORP	9,472	68.600	649,779.200	
	GE VERNOVA	17,726	328.340	5,820,154.840	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	103,340	76.760	7,932,378.400	
	CRH PUBLIC LIMITED PLC	44,000	97.230	4,278,120.000	
	LABCORP HOLDINGS	5,500	230.950	1,270,225.000	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	32,900	29.640	975,156.000	
	SMURFIT WESTROCK PLC	33,500	53.930	1,806,655.000	
	FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,000	185.050	2,405,650.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,500	273.250	3,142,375.000	
	THE CAMPBELL S COMPANY	12,500	43.050	538,125.000	
	CROWN HOLDINGS INC	7,780	85.370	664,178.600	
	TE CONNECTIVITY LTD	19,595	147.950	2,899,080.250	
	BLACKROCK INC	9,600	1,049.220	10,072,512.000	
	CARDINAL HEALTH INC	15,600	115.820	1,806,792.000	
	FEDEX CORP	15,000	277.430	4,161,450.000	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,654	181.180	4,466,811.720	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16,513	86.770	1,432,833.010	
	INTEL CORP	275,300	20.440	5,627,132.000	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	24,200	29.170	705,914.000	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,850	109.050	2,055,592.500	
	ILLINOIS TOOL WORKS	19,100	267.880	5,116,508.000	
	ILLUMINA INC	10,300	143.120	1,474,136.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	22,900	545.160	12,484,164.000	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,050	187.710	1,135,645.500	
	SNAP-ON INC	3,400	348.820	1,185,988.000	
	CARMAX INC	10,000	83.120	831,200.000	
	DUKE ENERGY CORP	49,728	107.890	5,365,153.920	
	TARGET CORP	29,700	131.600	3,908,520.000	
	DOVER CORP	8,900	196.540	1,749,206.000	
	WW GRAINGER INC	2,900	1,120.310	3,248,899.000	
	JABIL INC	7,300	133.960	977,908.000	
	CINTAS CORP	23,400	208.380	4,876,092.000	
	CONAGRA BRANDS INC	30,800	27.880	858,704.000	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	9,100	82.320	749,112.000	
	CLOROX COMPANY	8,000	163.320	1,306,560.000	
	ENTERGY CORP	27,600	74.840	2,065,584.000	
	MICROSOFT CORP	454,400	454.460	206,506,624.000	
	INCYTE CORP	10,600	69.400	735,640.000	
	CVS HEALTH CORP	80,969	44.040	3,565,874.760	
	MEDTRONIC PLC	82,598	81.370	6,720,999.260	
	MICRON TECHNOLOGY INC	71,400	108.600	7,754,040.000	
	CENTERPOINT ENERGY INC	42,000	31.710	1,331,820.000	
	KELLOGG CO	17,800	80.590	1,434,502.000	
	KEYCORP	60,700	17.800	1,080,460.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	86,011	61.340	5,275,914.740	
	CHUBB LTD	24,699	276.690	6,833,966.310	
	ALLSTATE CORP	17,000	193.400	3,287,800.000	
	EBAY INC	31,400	64.230	2,016,822.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	62,450	90.860	5,674,207.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	7,600	95.350	724,660.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,100	78.180	1,180,518.000	
	TRIMBLE INC	15,800	72.890	1,151,662.000	
	LENNAR CORP-A	15,400	151.470	2,332,638.000	
	PROGRESSIVE CORP	37,700	247.530	9,331,881.000	
	PACCAR INC	33,755	111.660	3,769,083.300	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BIOGEN INC	9,400	150.640	1,416,016.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	5,300	427.090	2,263,577.000	
	STARBUCKS CORP	73,000	92.090	6,722,570.000	
	PTC INC	7,800	196.900	1,535,820.000	
	EVERSOURCE ENERGY	23,100	58.510	1,351,581.000	
	INTUIT INC	18,080	677.770	12,254,081.600	
	BEST BUY CO INC	13,150	87.480	1,150,362.000	
	BALL CORP	19,504	57.750	1,126,356.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	94,797	90.430	8,572,492.710	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,200	154.790	2,507,598.000	
	VULCAN MATERIALS CO	8,500	272.650	2,317,525.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,700	469.240	7,836,308.000	
	CARNIVAL CORP	67,000	25.720	1,723,240.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	248,490	38.800	9,641,412.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,900	41.370	450,933.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	74,900	4.410	330,309.000	
アメリカ・ドル 小計				3,377,555,666.740 (519,265,408,205)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	383,106	24.135	9,246,263.310	
	HALEON PLC	478,287	3.847	1,839,970.080	
	WISE PLC CLASS A	41,324	9.910	409,520.840	
	BP PLC	998,128	3.801	3,793,884.520	
	UNILEVER PLC	153,476	46.520	7,139,703.520	
	BARCLAYS PLC	894,022	2.645	2,365,135.200	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	525,954	5.810	3,055,792.740	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	139,100	3.889	540,959.900	
	PRUDENTIAL PLC	166,101	6.362	1,056,734.560	
	NATWEST GROUP PLC	439,038	3.993	1,753,078.730	
	BAE SYSTEMS PLC	186,884	11.700	2,186,542.800	
	AVIVA PLC	165,520	4.676	773,971.520	
	GSK	256,394	13.335	3,419,013.990	
	INFORMA PLC	82,266	8.158	671,126.020	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	79,673	5.380	428,640.740	
	AUTO TRADER GROUP PLC	54,168	8.072	437,244.090	
	DCC PLC	6,000	53.150	318,900.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,537	70.200	318,497.400	
	HALMA PLC	23,492	27.830	653,782.360	
	ENTAIN PLC	37,644	7.520	283,082.880	
	JD SPORTS FASHION PLC	157,238	0.962	151,325.850	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,485	5.040	219,164.400	
	M&G PLC	140,210	1.944	272,638.340	
	ENDEAVOUR MINING PLC	11,149	14.470	161,326.030	
	RELX PLC	115,161	37.070	4,269,018.270	
	DIAGEO PLC	137,617	25.360	3,489,967.120	
	RIO TINTO PLC	69,763	48.200	3,362,576.600	
	STANDARD CHARTERED PLC	129,547	9.900	1,282,515.300	
	TESCO PLC	423,328	3.740	1,583,246.720	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SMITH & NEPHEW PLC	54,049	9.802	529,788.290	
	GLENCORE PLC	641,359	3.627	2,326,209.090	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,583	10.940	236,118.020	
	SMITHS GROUP PLC	21,328	17.440	371,960.320	
	PEARSON PLC	36,465	12.760	465,293.400	
	SAINSBURY (J) PLC	110,288	2.750	303,292.000	
	NEXT PLC	7,260	98.060	711,915.600	
	TAYLOR WIMPEY PLC	219,530	1.246	273,644.140	
	WHITBREAD PLC	11,175	29.160	325,863.000	
	BUNZL PLC	20,780	33.560	697,376.800	
	VODAFONE GROUP PLC	1,369,469	0.676	925,761.040	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,048	33.710	271,298.080	
	KINGFISHER PLC	111,437	2.527	281,601.290	
	WPP PLC	66,707	8.564	571,278.740	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	41,285	10.700	441,749.500	
	SEVERN TRENT PLC	16,741	25.740	430,913.340	
	RENTOKIL INITIAL PLC	156,167	4.052	632,788.680	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	42,667	48.430	2,066,362.810	
	SCHRODERS PLC	50,139	3.124	156,634.230	
	SSE PLC	68,310	16.170	1,104,572.700	
	BARRATT REDROW PLC	83,251	4.358	362,807.850	
	ASTRAZENECA PLC	95,878	105.060	10,072,942.680	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	360,719	2.266	817,389.250	
	3I GROUP PLC	60,243	36.170	2,178,989.310	
	ASHTEAD GROUP PLC	27,078	50.860	1,377,187.080	
	SAGE GROUP PLC/THE	62,153	13.050	811,096.650	
	NATIONAL GRID PLC	302,654	9.366	2,834,657.360	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,778,874	0.542	2,048,905.480	
	IMPERIAL BRANDS PLC	49,174	25.470	1,252,461.780	
	CENTRICA PLC	317,757	1.265	401,962.600	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	6,307	39.320	247,991.240	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	123,236	29.440	3,628,067.840	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,360	20.720	421,859.200	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,123,966	7.577	8,516,290.380	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,545	24.300	1,908,643.500	
	MONDI PLC	27,400	11.850	324,690.000	
	COMPASS GROUP PLC	104,878	26.720	2,802,340.160	
	PERSIMMON PLC	19,842	12.390	245,842.380	
	BT GROUP PLC	400,162	1.474	589,838.780	
	COCA-COLA HBC AG-DI	13,456	27.020	363,581.120	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,766	99.420	970,935.720	
	INTERTEK GROUP PLC	9,770	47.420	463,293.400	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,546	115.400	3,409,608.400	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,116	19.150	193,721.400	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,763	26.070	410,941.410	
	ANTOFAGASTA PLC	23,883	16.425	392,278.270	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EXPERIAN PLC	56,849	35.910	2,041,447.590	
イギリス・ポンド 小計				117,697,815.730 (23,000,507,152)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	83,833	24.610	2,063,130.130	
	AZRIELI GROUP LTD	2,916	292.500	852,930.000	
	ICL GROUP LTD	52,523	17.750	932,283.250	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,818	927.800	1,686,740.400	
	BANK HAPOALIM BM	85,712	42.700	3,659,902.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	102,278	42.530	4,349,883.340	
	NICE LTD	4,254	671.900	2,858,262.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,481	160.000	1,676,960.000	
イスラエル・シュケル 小計				18,080,092.120 (771,844,556)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	130,838	5.150	673,815.700	
	TELSTRA GROUP LTD	243,639	4.000	974,556.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	179,129	29.420	5,269,975.180	
	SGH LTD	11,606	46.280	537,125.680	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	161,885	3.780	611,925.300	
	BHP GROUP LTD	305,712	40.240	12,301,850.880	
	SOUTH32 LTD	272,748	3.400	927,343.200	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	114,396	23.520	2,690,593.920	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,972	18.670	1,903,817.240	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	185,047	38.190	7,066,944.930	
	WESTPAC BANKING CORP	206,888	32.640	6,752,824.320	
	SANTOS LTD	195,603	6.430	1,257,727.290	
	RIO TINTO LTD	22,336	118.510	2,647,039.360	
	ORIGIN ENERGY LTD	103,789	10.440	1,083,557.160	
	XERO LTD	8,695	171.110	1,487,801.450	
	PRO MEDICUS LTD	3,466	257.240	891,593.840	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,391	35.020	503,972.820	
	COLES GROUP LTD	80,744	18.800	1,517,987.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	11,166	120.600	1,346,619.600	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	69,302	16.080	1,114,376.160	
	REECE LTD	13,293	23.740	315,575.820	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	92,025	4.230	389,265.750	
	SEEK LTD	20,978	24.010	503,681.780	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	49,025	11.550	566,238.750	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	100,813	161.130	16,243,998.690	
	ORICA LTD	29,452	17.410	512,759.320	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	90,688	18.980	1,721,258.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	73,541	30.820	2,266,533.620	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	9.070	402,091.240	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	25,870	53.690	1,388,960.300	
	MACQUARIE GROUP LTD	21,855	227.430	4,970,482.650	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,067	69.250	2,359,139.750	
	CSL LTD	29,205	278.920	8,145,858.600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WESFARMERS LTD	68,356	74.300	5,078,850.800	
	COCHLEAR LTD	3,939	298.290	1,174,964.310	
	BLUESCOPE STEEL LTD	26,558	20.150	535,143.700	
	SUNCORP GROUP LTD	76,617	19.350	1,482,538.950	
	ASX LTD	11,659	67.200	783,484.800	
	COMPUTERSHARE LTD	31,960	33.170	1,060,113.200	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	142,734	8.590	1,226,085.060	
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,610	28.060	774,736.600	
	BRAMBLES LTD	83,864	19.320	1,620,252.480	
	CARSALES.COM LTD	22,876	38.150	872,719.400	
	MINERAL RESOURCES LTD	10,688	34.690	370,766.720	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,801	36.470	393,912.470	
	REA GROUP LTD	3,200	243.250	778,400.000	
オーストラリア・ドル 小計				107,499,260.230 (10,462,902,999)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	44,400	80.110	3,556,884.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	20,881	82.810	1,729,155.610	
	IMPERIAL OIL LTD	10,800	94.210	1,017,468.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,200	4,656.930	5,588,316.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	18,087	96.580	1,746,842.460	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,600	85.550	2,275,630.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,450	260.080	2,717,836.000	
	BCE INC	4,130	33.790	139,552.700	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,300	170.310	1,924,503.000	
	SUNCOR ENERGY INC	73,830	51.350	3,791,170.500	
	METRO INC/CN	12,300	91.540	1,125,942.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	20,000	132.580	2,651,600.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	72,600	78.370	5,689,662.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	55,300	94.120	5,204,836.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	102,500	75.210	7,709,025.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	16,500	47.370	781,605.000	
	MEG ENERGY CORP	15,100	23.190	350,169.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	82,950	177.070	14,687,956.500	
	TOURMALINE OIL CORP	20,900	61.520	1,285,768.000	
	TC ENERGY CORP	60,850	65.900	4,010,015.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	34,029	53.000	1,803,537.000	
	BARRICK GOLD CORP	102,700	23.250	2,387,775.000	
	CAE INC	18,800	33.730	634,124.000	
	THOMSON REUTERS CORP	9,241	237.980	2,199,173.180	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,600	44.390	337,364.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,200	125.670	402,144.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,850	73.990	654,811.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	23,900	28.440	679,716.000	
	HYDRO ONE LTD	19,400	44.190	857,286.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,960	192.140	1,721,574.400	
	STANTEC INC	6,600	116.160	766,656.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WSP GLOBAL INC	7,700	248.060	1,910,062.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,900	112.300	550,270.000	
	PARKLAND CORP	8,300	34.330	284,939.000	
	QUEBECOR INC -CL B	9,200	31.140	286,488.000	
	EMERA INC	17,000	54.170	920,890.000	
	TFI INTERNATIONAL INC	4,800	214.580	1,029,984.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,500	35.150	263,625.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	21,100	45.340	956,674.000	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	44,400	17.640	783,216.000	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	29,517	117.000	3,453,489.000	
	AIR CANADA	10,200	22.590	230,418.000	
	KINROSS GOLD CORP	72,100	13.700	987,770.000	
	BANK OF MONTREAL	42,800	140.480	6,012,544.000	
	POWER CORP OF CANADA	33,000	45.900	1,514,700.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	71,100	170.880	12,149,568.000	
	NUTRIEN LTD	29,019	66.360	1,925,700.840	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	8,000	41.870	334,960.000	
	CAMECO CORP	25,600	76.480	1,957,888.000	
	FIRSTSERVICE CORP	2,400	267.000	640,800.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,500	63.800	861,300.000	
	TELUS CORP	10,800	20.110	217,188.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	26,700	60.220	1,607,874.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,100	154.760	479,756.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	123,800	43.800	5,422,440.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	1,993.680	2,591,784.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	15,700	62.310	978,267.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,537	228.750	809,088.750	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	21,400	31.470	673,458.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,100	170.750	870,825.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,900	85.220	2,888,958.000	
	ENBRIDGE INC	127,700	59.240	7,564,948.000	
	BROOKFIELD CORP	80,225	84.440	6,774,199.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	102,900	44.020	4,529,658.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	54,720	105.190	5,755,996.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,400	132.450	715,230.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	69.370	575,771.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,350	147.400	4,620,990.000	
	CGI INC - CLASS A	12,000	157.090	1,885,080.000	
	ONEX CORPORATION	3,600	112.740	405,864.000	
	IGM FINANCIAL INC	4,700	46.620	219,114.000	
	TMX GROUP LTD	16,400	44.430	728,652.000	
	OPEN TEXT CORP	15,400	40.960	630,784.000	
	SAPUTO INC	15,000	25.580	383,700.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,700	18.810	765,567.000	
	FORTIS INC	29,100	59.990	1,745,709.000	
	RB GLOBAL INC	10,800	133.920	1,446,336.000	
	LUNDIN MINING CORP	38,900	12.290	478,081.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CENOVUS ENERGY INC	79,700	21.130	1,684,061.000	
	DOLLARAMA INC	16,500	141.650	2,337,225.000	
	ALTAGAS LTD	17,600	32.150	565,840.000	
	KEYERA CORP	13,500	42.920	579,420.000	
	ARC RESOURCES LTD	34,200	24.380	833,796.000	
カナダ・ドル 小計				179,249,044.240 (19,253,139,841)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	158,800	2.610	414,468.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	85,800	36.700	3,148,860.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	135,140	44.210	5,974,539.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,975	6.390	645,230.250	
	KEPPEL CORP LTD	98,800	6.800	671,840.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	175,200	2.820	494,064.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	229,600	16.950	3,891,720.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	410,000	0.760	311,600.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	503,950	3.130	1,577,363.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	105,900	4.520	478,668.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	60,600	5.400	327,240.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	58,200	12.310	716,442.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,300	3.040	396,112.000	
シンガポール・ドル 小計				19,048,147.150 (2,170,155,404)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	24,336	37.060	901,892.160	
	GALDERMA GROUP N AG	3,485	94.940	330,865.900	
	AVOLTA AG	5,344	36.680	196,017.920	
	UBS GROUP AG-REG	195,634	28.170	5,511,009.780	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,953	273.000	533,169.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	398	621.500	247,357.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,081	22.660	228,435.460	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	41,826	257.800	10,782,742.800	
	SIKA AG-REG	9,038	226.200	2,044,395.600	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	97,800.000	684,600.000	
	ABB LTD-REG	94,086	51.880	4,881,181.680	
	SWISS RE AG	17,985	131.950	2,373,120.750	
	NESTLE SA-REG	155,813	75.220	11,720,253.860	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,313	1,267.000	1,663,571.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,459	257.600	633,438.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,239	58.480	715,736.720	
	SGS SA-REG	8,915	90.520	806,985.800	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,361	250.500	340,930.500	
	TEMENOS AG - REG	3,332	64.650	215,413.800	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,158	145.000	312,910.000	
	VAT GROUP AG	1,568	351.400	550,995.200	
	BKW AG	1,274	148.400	189,061.600	
	ALCON INC	29,765	76.320	2,271,664.800	
	SIG GROUP N AG	17,784	17.830	317,088.720	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,680	160.850	270,228.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,683	551.200	4,786,069.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	163.600	429,286.400	
	CLARIANT AG-REG	12,962	10.180	131,953.160	
	NOVARTIS AG-REG	117,237	88.720	10,401,266.640	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	1,253.000	265,636.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,976	64.050	126,562.800	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	31,964	137.350	4,390,255.400	
	SWISSCOM AG-REG	1,501	507.000	761,007.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,706	82.700	141,086.200	
	GEBERIT AG-REG	2,037	533.800	1,087,350.600	
	GIVAUDAN-REG	532	4,061.000	2,160,452.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,672	118.550	790,965.600	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,042	297.300	904,386.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,027	74.860	675,761.220	
	LONZA GROUP AG-REG	4,286	541.400	2,320,440.400	
	HOLCIM LTD	31,012	88.860	2,755,726.320	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,665	692.000	1,152,180.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,908	202.600	589,160.800	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,478	97.350	435,933.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	9,915.000	584,985.000	
スイス・フラン 小計				83,613,531.490 (14,408,283,746)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	14,863	227.600	3,382,818.800	
	ERICSSON LM-B SHS	188,367	89.860	16,926,658.620	
	VOLVO AB-B SHS	107,747	275.700	29,705,847.900	
	SKF AB-B SHARES	23,083	215.400	4,972,078.200	
	TELE2 AB-B SHS	37,061	112.900	4,184,186.900	
	GETINGE AB-B SHS	15,558	171.400	2,666,641.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	107,545	153.850	16,545,798.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	98,755	113.400	11,198,817.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,604	216.200	12,453,984.800	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,431	152.150	5,847,276.650	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	41,123	140.350	5,771,613.050	
	SKANSKA AB-B SHS	23,045	235.000	5,415,575.000	
	SANDVIK AB	72,305	205.400	14,851,447.000	
	INVESTOR AB-B SHS	117,358	295.450	34,673,421.100	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	182,109	176.800	32,196,871.200	
	VOLVO AB-A SHS	13,595	276.400	3,757,658.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,187	413.200	2,143,268.400	
	SECURITAS AB-B SHS	33,354	137.250	4,577,836.500	
	TELIA CO AB	159,946	30.420	4,865,557.320	
	ALFA LAVAL AB	19,616	465.400	9,129,286.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	105,851	155.600	16,470,415.600	
	ASSA ABLOY AB-B	67,924	338.800	23,012,651.200	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,434	389.200	5,617,712.800	
	SAAB AB-B	21,739	223.700	4,863,014.300	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,245	356.200	2,936,869.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	44,935	78.060	3,507,626.100	
	INDUTRADE AB	18,567	281.800	5,232,180.600	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,243	310.600	4,113,275.800	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,174	507.500	2,625,805.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,085	276.900	2,792,536.500	
	LIFCO AB-B SHS	15,838	334.600	5,299,394.800	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	102,777	42.680	4,386,522.360	
	BEIJER REF AB	26,093	169.300	4,417,544.900	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	41,334	297.800	12,309,265.200	
	BOLIDEN AB	18,584	321.400	5,972,897.600	
	EPIROC AB-A	44,685	203.400	9,088,929.000	
	EPIROC AB-B	26,397	179.900	4,748,820.300	
	EQT AB	25,224	317.900	8,018,709.600	
	EVOLUTION AB	11,473	923.200	10,591,873.600	
	HEXAGON AB-B SHS	140,739	105.500	14,847,964.500	
	ADDTECH AB-B SHARES	17,593	316.000	5,559,388.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	356.000	3,865,804.000	
スウェーデン・クローナ 小計				385,545,843.050 (5,413,063,636)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	213,987	769.900	164,748,591.300	
	DANSKE BANK A/S	46,742	203.600	9,516,671.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	187	11,120.000	2,079,440.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68,428	94.400	6,459,603.200	
	CARLSBERG AS-B	6,514	702.200	4,574,130.800	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	23,918	412.700	9,870,958.600	
	COLOPLAST-B	8,571	816.200	6,995,650.200	
	DSV PANALPINA A/S	13,856	1,516.500	21,012,624.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	599	2,604.000	1,559,796.000	
	DEMANT A/S	6,039	259.000	1,564,101.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	301	11,540.000	3,473,540.000	
	TRYG A/S	22,999	151.800	3,491,248.200	
	PANDORA A/S	5,558	1,258.000	6,991,964.000	
	GENMAB A/S	4,267	1,427.500	6,091,142.500	
	ZEALAND PHARMA A/S	4,339	799.000	3,466,861.000	
	ORSTED A/S	11,406	339.200	3,868,915.200	
デンマーク・クローネ 小計				255,765,237.200 (5,534,759,733)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	88,421	5.740	507,536.540	
	MERCURY NZ LTD	47,473	5.945	282,226.980	
	INFRATIL LTD	62,300	12.380	771,274.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	102,597	8.240	845,399.280	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,694	38.240	1,517,898.560	
ニュージーランド・ドル 小計				3,924,335.360 (347,146,706)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	60,750	229.100	13,917,825.000	
	NORSK HYDRO ASA	95,339	63.860	6,088,348.540	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ORKLA ASA	47,532	98.600	4,686,655.200	
	TELENOR ASA	41,757	128.400	5,361,598.800	
	EQUINOR ASA	56,779	253.300	14,382,120.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,226	314.900	3,535,067.400	
	MOWI ASA	31,524	199.250	6,281,157.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,578	202.200	2,745,471.600	
	AKER BP ASA	21,464	216.500	4,646,956.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,949	1,276.000	7,590,924.000	
	SALMAR ASA	4,513	561.500	2,534,049.500	
ノルウェー・クローネ 小計				71,770,173.740 (985,404,486)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	51,857	24.900	1,291,239.300	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,125	37.270	1,160,028.750	
	EXOR NV	6,288	89.250	561,204.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,168	59.480	426,352.640	
	DSM FIRMENICH AG	11,673	100.050	1,167,883.650	
	FERROVIAL	29,720	40.740	1,210,792.800	
	LOTUS BAKERIES NV	25	10,780.000	269,500.000	
	SYENSQO SA	4,547	72.610	330,157.670	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	14,400	21.800	313,920.000	
	COVESTRO V AG	11,566	58.000	670,828.000	
	BAYER AG-REG	61,899	19.330	1,196,507.670	
	EVONIK INDUSTRIES AG	15,701	16.875	264,954.370	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	119,323	16.790	2,003,433.170	
	COMMERZBANK AG	59,422	15.380	913,910.360	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,012	86.660	1,127,619.920	
	SIEMENS AG-REG	47,898	192.920	9,240,482.160	
	E.ON SE	141,342	11.320	1,599,991.440	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,111	78.360	1,419,177.960	
	GEA GROUP AG	9,811	48.700	477,795.700	
	CONTINENTAL AG	6,941	65.200	452,553.200	
	BASF SE	56,200	43.630	2,452,006.000	
	ALLIANZ SE-REG	24,668	299.100	7,378,198.800	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	10,655	84.700	902,478.500	
	RHEINMETALL AG	2,761	612.800	1,691,940.800	
	RWE AG	39,781	28.330	1,126,995.730	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,885	6.436	243,827.860	
	BRENNTAG SE	7,967	58.160	463,360.720	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	26,647	34.050	907,330.350	
	SAP SE	65,778	239.050	15,724,230.900	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,384	514.200	4,311,052.800	
	ZALANDO SE	14,145	33.930	479,939.850	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,557	123.200	1,054,222.400	
	RATIONAL AG	306	844.500	258,417.000	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	81.800	310,840.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,607	217.300	349,201.100	
	TALANX AG	3,951	82.650	326,550.150	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,387	35.690	335,022.030	
	DELIVERY HERO SE	11,722	29.200	342,282.400	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,594	47.760	123,889.440	
	BECHTLE AG	5,223	31.060	162,226.380	
	NEMETSCHEK SE	3,634	91.900	333,964.600	
	SCOUT24 AG	4,599	86.200	396,433.800	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,757	53.300	946,448.100	
	KNORR-BREMSE AG	4,442	70.050	311,162.100	
	SIEMENS ENERGY AG	40,302	51.100	2,059,432.200	
	BEIERSDORF AG	6,274	124.650	782,054.100	
	MERCK KGAA	8,107	140.050	1,135,385.350	
	ADIDAS AG	10,212	242.200	2,473,346.400	
	PUMA SE	6,466	45.000	290,970.000	
	HENKEL AG & CO KGAA	6,571	75.000	492,825.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	219,851	29.800	6,551,559.800	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	12,965	45.100	584,721.500	
	MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,136	54.050	2,547,700.800	
	QIAGEN N.V.	13,970	43.220	603,783.400	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,194	32.985	2,711,169.090	
	HANNOVER RUECK SE	3,790	251.000	951,290.000	
	DHL GROUP	64,185	34.090	2,188,066.650	
	DEUTSCHE BOERSE AG	11,825	225.300	2,664,172.500	
	MTU AERO ENGINES AG	3,393	324.400	1,100,689.200	
	SYMRISE AG	8,328	104.800	872,774.400	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,505	72.650	254,638.250	
	VONOVIA SE	46,599	29.830	1,390,048.170	
	LEG IMMOBILIEN SE	4,566	81.000	369,846.000	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	50,277	23.830	1,198,100.910	
	NN GROUP NV	17,062	41.870	714,385.940	
	ARCELORMITTAL	29,514	22.910	676,165.740	
	HEINEKEN NV	18,115	69.740	1,263,340.100	
	AEGON LTD	85,054	5.616	477,663.260	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	58,511	31.930	1,868,256.230	
	AKZO NOBEL N.V.	10,737	56.880	610,720.560	
	WOLTERS KLUWER	14,999	163.700	2,455,336.300	
	ING GROEP NV	207,983	14.692	3,055,686.230	
	KONINKLIJKE KPN NV	241,485	3.567	861,376.990	
	ASML HOLDING NV	25,150	703.400	17,690,510.000	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	28,945	14.485	419,268.320	
	IMCD NV	3,592	144.150	517,786.800	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,713	128.500	605,620.500	
	ASR NEDERLAND NV	10,012	44.400	444,532.800	
	ADYEN NV	1,328	1,503.000	1,995,984.000	
	PROSUS NV	85,918	40.350	3,466,791.300	
	JDE PEET'S NV	7,685	16.990	130,568.150	
	INPOST SA	14,300	16.190	231,517.000	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,974	551.600	1,640,458.400	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	RANDSTAD NV	6,852	40.600	278,191.200	
	HEINEKEN HOLDING NV	8,128	58.250	473,456.000	
	TOTALENERGIES SE	135,905	51.680	7,023,570.400	
	MICHELIN (CGDE)	42,054	32.330	1,359,605.820	
	AIR LIQUIDE SA	36,365	158.900	5,778,398.500	
	KERING	4,655	239.150	1,113,243.250	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,449	245.900	8,471,009.100	
	BOUYGUES SA	11,619	28.530	331,490.070	
	BNP PARIBAS	64,063	58.250	3,731,669.750	
	THALES SA	5,789	136.500	790,198.500	
	DANONE	40,692	64.940	2,642,538.480	
	CARREFOUR SA	34,145	13.740	469,152.300	
	L'OREAL	15,118	344.850	5,213,442.300	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	28,554	87.040	2,485,340.160	
	LEGRAND SA	16,540	94.360	1,560,714.400	
	PERNOD RICARD SA	12,803	111.350	1,425,614.050	
	EURAZEO SE	2,599	69.100	179,590.900	
	REXEL SA	14,143	24.160	341,694.880	
	SOCIETE GENERALE SA	45,311	26.690	1,209,350.590	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,330	635.600	11,014,948.000	
	ACCOR SA	12,225	46.800	572,130.000	
	CAPGEMINI SE	9,805	153.650	1,506,538.250	
	PUBLICIS GROUPE	14,406	104.600	1,506,867.600	
	BUREAU VERITAS SA	20,039	29.800	597,162.200	
	EIFFAGE	4,669	83.900	391,729.100	
	SODEXO SA	5,616	80.150	450,122.400	
	IPSEN	2,311	110.300	254,903.300	
	AMUNDI SA	3,852	64.200	247,298.400	
	TELEPERFORMANCE	3,431	80.080	274,754.480	
	EURONEXT NV	4,921	108.200	532,452.200	
	EUROFINS SCIENTIFIC	8,265	47.410	391,843.650	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,790	186.400	333,656.000	
	SEB SA	1,488	89.300	132,878.400	
	ESSILORLUXOTTICA	18,689	233.300	4,360,143.700	
	DASSAULT AVIATION SA	1,289	189.400	244,136.600	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	6,098	37.620	229,406.760	
	AXA SA	110,566	33.740	3,730,496.840	
	EDENRED	15,273	31.040	474,073.920	
	RENAULT SA	12,080	44.500	537,560.000	
	HERMES INTERNATIONAL	2,041	2,303.000	4,700,423.000	
	STMICROELECTRONICS NV	43,022	24.510	1,054,469.220	
	DASSAULT SYSTEMES SE	42,143	34.270	1,444,240.610	
	ORANGE	117,209	9.576	1,122,393.380	
	ALSTOM	21,803	22.270	485,552.810	
	SANOFI	71,927	91.740	6,598,582.980	
	VINCI SA	31,507	99.520	3,135,576.640	
	AIRBUS SE	37,456	158.540	5,938,274.240	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,401	27.280	1,211,259.280	
	CREDIT AGRICOLE SA	67,084	13.050	875,446.200	
	BIOMERIEUX	2,542	101.300	257,504.600	
	ENGIE	115,034	14.875	1,711,130.750	
	SAFRAN SA	23,010	211.700	4,871,217.000	
	ARKEMA	3,434	72.300	248,278.200	
	ADP	2,122	111.400	236,390.800	
	GETLINK SE	19,144	15.160	290,223.040	
	BOLLORE	43,698	5.750	251,263.500	
	UCB SA	7,939	185.900	1,475,860.100	
	KBC GROUP NV	14,445	72.960	1,053,907.200	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,201	64.950	337,804.950	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,575	49.570	2,804,422.750	
	AGEAS	10,078	46.820	471,851.960	
	D'IETEREN GROUP	1,322	164.000	216,808.000	
	ELIA GROUP SA/NV	1,802	76.300	137,492.600	
	SOFINA	931	213.400	198,675.400	
	ARGENX SE	3,739	599.400	2,241,156.600	
	PRYSMIAN SPA	17,730	61.080	1,082,948.400	
	GENERALI	58,894	27.650	1,628,419.100	
	MEDIOBANCA SPA	31,488	14.330	451,223.040	
	TENARIS SA	25,343	18.145	459,848.730	
	UNICREDIT SPA	92,732	38.200	3,542,362.400	
	UNIPOL GRUPPO SPA	26,800	11.830	317,044.000	
	TELECOM ITALIA SPA	612,014	0.273	167,569.430	
	INTESA SANPAOLO	921,048	3.866	3,561,232.090	
	POSTE ITALIANE SPA	28,013	13.800	386,579.400	
	MONCLER SPA	14,751	51.340	757,316.340	
	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,409	50.600	324,295.400	
	ENI SPA	144,794	12.784	1,851,046.490	
	BPER BANCA	67,500	6.126	413,505.000	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	38,820	6.084	236,180.880	
	BANCO BPM SPA	81,084	7.960	645,428.640	
	DIASORIN SPA	1,344	100.700	135,340.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	20,601	9.625	198,284.620	
	NEXI SPA	32,152	5.590	179,729.680	
	AMPLIFON SPA	7,824	24.750	193,644.000	
	LEONARDO SPA	25,455	25.690	653,938.950	
	ENEL SPA	512,156	6.955	3,562,044.980	
	SNAM SPA	126,955	4.307	546,795.180	
	TERNA SPA	88,571	7.690	681,110.990	
	FINECOBANK SPA	38,474	16.835	647,709.790	
	STELLANTIS NV	122,988	12.758	1,569,080.900	
	FERRARI NV	7,916	414.700	3,282,765.200	
	TELEFONICA SA	249,904	4.045	1,010,861.680	
	ENDESA SA	19,465	20.580	400,589.700	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	362,894	9.520	3,454,750.880	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	IBERDROLA SA	380,468	13.200	5,022,177.600	
	BANCO DE SABADELL SA	342,595	1.883	645,106.380	
	REPSOL SA	74,479	11.025	821,130.970	
	GRIFOLS SA	18,913	9.770	184,780.010	
	BANCO SANTANDER SA	975,665	4.460	4,351,465.900	
	AMADEUS IT GROUP SA	28,359	67.600	1,917,068.400	
	CAIXABANK SA	253,450	5.090	1,290,060.500	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,247	47.940	539,181.180	
	AENA SME SA	4,688	198.300	929,630.400	
	CELLNEX TELECOM SA	33,399	30.970	1,034,367.030	
	ACCIONA SA	1,472	108.700	160,006.400	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	68,731	50.200	3,450,296.200	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	24,877	16.570	412,211.890	
	UPM-KYMMENE OYJ	33,648	26.080	877,539.840	
	NOKIA OYJ	335,838	4.220	1,417,236.360	
	WARTSILA OYJ ABP	31,673	17.185	544,300.500	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	35,682	9.750	347,899.500	
	ELISA OYJ	8,714	42.120	367,033.680	
	SAMPO OYJ-A SHS	31,415	39.160	1,230,211.400	
	FORTUM OYJ	27,499	13.125	360,924.370	
	KESKO OYJ-B SHS	17,250	18.140	312,915.000	
	KONE OYJ-B	21,393	47.810	1,022,799.330	
	NESTE OYJ	25,885	12.240	316,832.400	
	ORION OYJ-CLASS B	6,816	42.680	290,906.880	
	METSO CORPORATION	38,123	9.016	343,716.960	
	NORDEA BANK ABP	198,712	10.560	2,098,398.720	
	VERBUND AG	4,249	68.700	291,906.300	
	OMV AG	9,024	36.540	329,736.960	
	ERSTE GROUP BANK AG	21,198	58.440	1,238,811.120	
	AIB GROUP PLC	117,515	5.270	619,304.050	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	62,250	8.606	535,723.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,753	69.000	672,957.000	
	JERONIMO MARTINS	17,354	18.530	321,569.620	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	197,570	3.199	632,026.430	
	GALP ENERGIA SGPS SA	29,235	16.680	487,639.800	
	EDP RENOVAVEIS SA	18,553	9.845	182,654.280	
	KERRY GROUP PLC-A	9,656	91.950	887,869.200	
ユーロ 小計				322,240,517.920 (52,003,174,782)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	94,000	50.750	4,770,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	34.250	5,103,250.000	
	MTR CORP	106,000	27.100	2,872,600.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	98,500	74.000	7,289,000.000	
	SINO LAND CO	264,000	7.780	2,053,920.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	182,169	41.300	7,523,579.700	
	WHARF HOLDINGS LTD	73,000	22.400	1,635,200.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	28,000	68.150	1,908,200.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CLP HOLDINGS LTD	111,500	64.150	7,152,725.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	98,507	23.900	2,354,317.300	
	HONG KONG & CHINA GAS	759,475	6.090	4,625,202.750	
	HANG SENG BANK LTD	51,100	93.900	4,798,290.000	
	WH GROUP LTD	565,500	6.260	3,540,030.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,700	300.600	24,559,020.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	130,669	30.850	4,031,138.650	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	43,000	53.050	2,281,150.000	
	AIA GROUP LTD	741,400	54.700	40,554,580.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	92,000	19.660	1,808,720.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	114,000	19.780	2,254,920.000	
	SANDS CHINA LTD	164,800	21.150	3,485,520.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	93,500	103.800	9,705,300.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	251,000	24.900	6,249,900.000	
香港・ドル 小計				150,557,063.400 (2,979,524,284)	
合計				656,595,315,530 [656,595,315,530]	

(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	9,237	2,096,244.780	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	21,007	3,780,419.720	
		BXP INC	9,700	779,492.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,000	1,462,930.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,000	1,600,940.000	
		EQUINIX INC	6,108	5,868,810.720	
		AMERICAN TOWER CORP	30,100	5,817,126.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	45,243	846,948.960	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	21,200	782,280.000	
		KIMCO REALTY CORP	43,400	1,054,620.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,700	867,123.000	
		INVITATION HOMES INC	37,400	1,211,760.000	
		VICI PROPERTIES INC	67,400	2,025,370.000	
		VENTAS INC	26,800	1,613,896.000	
		WEYERHAEUSER CO	46,814	1,375,395.320	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,000	2,656,640.000	
		IRON MOUNTAIN INC	18,900	2,080,701.000	
		SUN COMMUNITIES INC	8,100	994,680.000	
		PROLOGIS INC	59,654	6,494,530.980	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,200	1,043,562.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,900	818,271.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,200	1,235,220.000	
		WELLTOWER INC	39,900	5,156,277.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,000	939,150.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,600	1,186,132.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,500	790,625.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	34,800	677,904.000	
		REALTY INCOME CORP	56,095	3,058,299.400	
		PUBLIC STORAGE	10,200	3,196,272.000	
		REGENCY CENTERS CORP	11,000	830,500.000	
		UDR INC	20,200	897,082.000	
		WP CAREY INC	14,100	794,676.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,100	3,903,500.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	13,700	2,116,513.000	
	アメリカ・ドル 小計			70,053,891.880 (10,770,085,337)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	43,890	251,050.800	
		SEGRO PLC	79,485	555,918.090	
	イギリス・ポンド 小計			806,968.890 (157,697,860)	
	オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	187,089	2,467,703.910	
		APA GROUP	78,315	562,301.700	
		SCENTRE GROUP	313,440	1,093,905.600	
		GPT GROUP	112,602	502,204.920	
		MIRVAC GROUP	238,518	467,495.280	
		STOCKLAND	144,307	718,648.860	
		GOODMAN GROUP	103,698	3,810,901.500	
		VICINITY CENTRES	227,463	466,299.150	
	オーストラリア・ドル 小計			10,089,460.920 (982,007,231)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,800	211,056.000	
	カナダ・ドル 小計			211,056.000 (22,669,525)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	253,500	646,425.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	395,270	762,871.100	
	シンガポール・ドル 小計			1,409,296.100 (160,561,105)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,457	542,720.460	
		GECINA SA	2,908	260,266.000	
		KLEPIERRE	13,182	366,195.960	
		COVIVIO	3,349	163,833.080	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,363	218,851.380	
	ユーロ 小計			1,551,866.880 (250,440,277)	
	香港・ドル	LINK REIT	174,700	5,791,305.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	257,000	2,433,790.000	
	香港・ドル 小計			8,225,095.000 (162,774,630)	
投資証券 合計				12,506,235,965	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				[12,506,235,965]	
合計				12,506,235,965 [12,506,235,965]	

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 570銘柄 投資証券 34銘柄	98%	2.0%	79.2%
イギリス・ポンド	株式 76銘柄 投資証券 2銘柄	99.3%	0.7%	3.5%
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 46銘柄 投資証券 8銘柄	91.4%	8.6%	1.7%
カナダ・ドル	株式 83銘柄 投資証券 1銘柄	99.9%	0.1%	2.9%
シンガポール・ドル	株式 13銘柄 投資証券 2銘柄	93.1%	6.9%	0.3%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	2.2%
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	100%	-%	0.8%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.1%
ユーロ	株式 214銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	7.8%
香港・ドル	株式 22銘柄 投資証券 2銘柄	94.8%	5.2%	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12月18日現在 金　額（円）	2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,170,100,784	3,171,608,678
コール・ローン	1,716,112,297	1,335,347,355
国債証券	274,040,930,032	324,394,571,828
派生商品評価勘定	251,140	19,916,088
未収入金	－	3,462,085
未収利息	1,877,679,010	2,482,543,434
前払費用	93,256,788	153,891,904
流動資産合計	280,898,330,051	331,561,341,372
資産合計	280,898,330,051	331,561,341,372
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,266,097	337,728
未払金	220,125	14,265
未払解約金	57,540,544	309,636,718
流動負債合計	103,026,766	309,988,711
負債合計	103,026,766	309,988,711
純資産の部		
元本等		
元本　※1	82,652,055,717	89,547,195,166
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	198,143,247,568	241,704,157,495
元本等合計	280,795,303,285	331,251,352,661
純資産合計	280,795,303,285	331,251,352,661
負債純資産合計	280,898,330,051	331,561,341,372

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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1.　※1　期首	2022 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 19 日
期首元本額	76,482,606,084 円	82,652,055,717 円
期中追加設定元本額	11,616,498,414 円	16,450,147,562 円
期中一部解約元本額	5,447,048,781 円	9,555,008,113 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	378,265,789 円	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)	7,319,300 円	4,781,204 円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18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)	39,693,753円	30,065,328円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	15,003,665円	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)	202,530,565円	165,405,939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）	575,818,396円	862,368,326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	626,597,140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）	800,186,267円	981,378,486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）	3,784,307,962円	6,255,603,498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）	844,233,964円	1,141,672,928円
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックス	2,560,063円	1,854,652円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	19,940,223円	21,957,522円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,147,340,748円	1,366,095,940円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,287,197,948円	2,814,766,620円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	501,734,675円	671,427,825円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	297,564円	2,389,602円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51,328,969,323円	51,472,893,222円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,157,832,760円	1,196,484,774円
ダイワ・ライフ・バランス５０	818,375,038円	934,115,462円
ダイワ・ライフ・バランス７０	625,354,205円	750,649,313円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	696,882,920円	742,484,165円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	550,480,847円	609,463,845円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	219,646,890円	292,026,114円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	37,370,856円	36,746,467円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	18,942,184円	22,755,567円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,961,861,578円	2,478,042,791円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,614,349円	5,041,201円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,938,861円	2,514,030円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,291,159円	10,205,784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）	1,152,992,870円	2,584,397,859円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	94,521,436円	89,069,708円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	26,095,640円	26,929,432円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,806,836,890円	2,415,693,402円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	174,580,938円	150,818,032円
スタイル９（4資産分散・保守型）	19,262円	237,164円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	48,912円	2,681,759円
スタイル９（4資産分散・積極型）	50,401円	2,477,850円
スタイル９（6資産分散・保守型）	9,170円	52,155円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	17,475円	1,827,207円
スタイル９（6資産分散・積極型）	8,872円	641,559円
スタイル９（8資産分散・保守型）	8,872円	81,076円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	19,559円	1,766,798円
スタイル９（8資産分散・積極型）	13,635円	2,017,872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）	−円	2,705,214円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	156,788,408円	127,039,766円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	67,315,692円	68,146,721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）	3,217,888,980円	4,105,335,628円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,820,063,374円	6,026,779,896円
ダイワライフスタイル２５	26,705,094円	24,997,512円
ダイワライフスタイル５０	59,474,710円	58,284,801円
ダイワライフスタイル７５	16,603,675円	17,181,528円
計	82,652,055,717円	89,547,195,166円
2. 期末日における受益権の総数	82,652,055,717口	89,547,195,166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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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 12 月 18 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12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	6,832,474,204	△2,282,920,276
合計	6,832,474,204	△2,282,920,276

（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12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	（円）	うち1年超	（円）	（円）	（円）	うち1年超	（円）	（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,730,758,000	－	1,685,743,043	△45,014,957	1,044,836,940	－	1,064,415,300	19,578,360
アメリカ・ドル	315,181,225	－	312,748,847	△2,432,378	157,201,956	－	159,885,120	2,683,164
イギリス・ポンド	21,051,745	－	20,843,146	△208,599	23,424,418	－	24,157,456	733,038
オフショア・人民元	1,046,331,594	－	1,008,761,922	△37,569,672	492,890,369	－	502,671,610	9,781,241
カナダ・ドル	10,070,572	－	10,167,513	96,941	49,991,058	－	50,164,920	173,862
シンガポール・ドル	19,520,002	－	18,838,729	△681,273	－	－	－	－
スウェーデン・クローナ	－	－	－	－	11,630,489	－	11,889,468	258,979
ニュージーランド・ドル	25,779,248	－	25,037,809	△741,439	52,620,253	－	52,491,257	△128,996
ノルウェー・クローネ	－	－	－	－	25,831,178	－	26,163,883	332,705
ポーランド・ズロチ	27,875,525	－	26,970,398	△905,127	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	46,764,863	－	45,544,678	△1,220,185	108,926,260	－	112,484,941	3,558,681
ユーロ	218,183,226	－	216,830,001	△1,353,225	122,320,959	－	124,506,645	2,185,686
合計	1,730,758,000	－	1,685,743,043	△45,014,957	1,044,836,940	－	1,064,415,300	19,578,360

（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12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3973円 (33,973円)	3.6992円 (36,992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	872,766.900	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	746,229.590	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	764,435.160	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	781,237.380	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,532,666.750	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,194,780.720	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	894,076.260	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	543,500.920	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	520,557.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	938,813.040	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,086,887.970	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,054,032.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,185,751.600	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,016,009.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	678,000.000	663,111.120	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,005,061.930	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,412,840.130	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,277,061.060	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,330,915.950	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,366,301.220	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,195,510.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,334,024.850	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,088,123.190	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,029,386.990	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,248,987.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,125,930.820	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,783,546.740	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,789,494.880	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,835,337.950	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,723,702.990	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,102,285.820	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,536,718.560	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,137,678.620	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,863,000.000	2,750,417.370	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,422,767.250	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,418,048.300	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	508,556.890	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,721,041.860	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	807,227.680	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,452,997.410	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,978,076.100	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,163,642.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,849,005.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,083,230.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	747,460.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,491,961.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,788,695.650	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,129,216.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,521,700.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,610,015.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,775,662.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,203,935.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,807,800.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,071,679.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,269,860.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,936,678.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,219,915.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,389,187.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,427,236.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,549,891.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,433,787.800	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,960,850.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,475,145.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,191,460.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,455,175.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,531,674.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,448,425.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,437,575.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	3,039,709.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,608,319.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,730,196.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,910,750.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,702,644.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,408,375.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,186,854.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,409,870.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,669,604.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,388,850.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,860,650.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,768,776.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,960,235.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,902,800.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,380,350.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,365,600.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,141,720.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,646,424.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	280,509.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,475,552.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,612,856.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,199,552.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	492,980.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	4,000,000.000	2,466,840.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,197,425.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,189,235.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,542,800.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,525,750.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,143,090.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,056,900.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,169,670.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,599,040.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,075,396.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,600,440.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,685,260.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,233,196.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,915,992.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,504,100.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,491,400.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,805,050.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,291,740.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,408,371.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,900,795.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,788,350.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,537,100.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,223,072.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,868,690.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,636,080.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,826,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,401,786.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,292,190.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,440,260.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,170,944.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,759,788.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,428,080.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,184,796.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,512,100.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,751,350.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,482,565.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,314,845.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,781,893.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,662,260.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,458,750.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,467,550.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,715,400.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,478,200.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,298,680.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,248,800.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,784,770.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,750,920.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,387,880.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,610,030.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	5,000,000.000	4,721,650.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,042,184.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,575,760.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,769,280.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,587,030.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,894,682.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,342,377.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,820,750.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,544,200.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,753,900.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,778,750.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,813,750.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,441,703.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,624,600.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,249,215.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,834,940.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,900,970.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,633,400.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,925,540.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,833,560.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,930,970.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,921,485.700	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,519,885.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,869,216.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,690,340.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,130,545.600	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,429,775.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,330,390.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,457,225.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,490,970.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,992,260.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,609,014.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,337,141.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,964,780.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,455,950.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,970,810.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,302,825.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,491,460.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,494,015.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,910,800.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,485,195.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,823,800.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,488,905.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,531,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,259,375.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,789,900.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,621,153.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	3,949,680.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,978,490.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,510,525.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,745,082.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,631,402.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,986,940.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,889,060.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,953,900.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,966,080.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,258,212.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,719,736.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,252,825.000	

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	3,626,925.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,461,645.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,994,780.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,921,880.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,472,630.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,019,100.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,485,370.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,605,100.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,010,980.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,612,100.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,215,452.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,958,030.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,073,960.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,011,280.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,018,210.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,525,425.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,252,542.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,006,420.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,128,520.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,087,600.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,825,726.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,325,691.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,192,132.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,426,246.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,518,830.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,011,400.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,015,840.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,004,840.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,967,260.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,369,005.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	3,000,000.000	2,999,580.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	5,997,840.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,751,808.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	980,890.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	995,150.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	7,959,904.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	3,990,280.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,153,864.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,931,090.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,588,300.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	5,019,500.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,196,620.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,001,150.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	4,971,250.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,979,400.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,214,612.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,028,000.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,520,200.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,488,015.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,023,400.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,535,200.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,627,248.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	7,035,000.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,472,630.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,652,808.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,042,750.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,339,169.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,541,805.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,021,680.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,490,750.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	99,910.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,207,546.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,207,686.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,208,368.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,944,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,074,225.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,915,720.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	4,500,000.000	4,253,175.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,867,640.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,667,520.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,462,695.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,865,400.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	978,100.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,442,130.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	773,680.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,206,551.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,297,712.200	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	4,968,750.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	2,300,000.000	2,273,573.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,188,156.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,600,000.000	2,565,056.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,686,149.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,732,430.000	
	アメリカ・ドル 小計			997,167,296.120 (153,304,500,106)	
	イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	741,124.200	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,403,440.700	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	937,640.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,049,510.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	884,547.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,420,696.700	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,365,735.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	728,120.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	666,347.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,150,000.000	556,025.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,285,290.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	703,980.200	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,045,096.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	2,750,000.000	773,850.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,437,555.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,414,848.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	642,940.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,489,952.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,929,875.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,500,000.000	705,600.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,518,911.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	817,020.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,329,783.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,324,430.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	4,000,000.000	2,987,920.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	613,990.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,871,756.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	277,619.200	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,988,000.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	907,890.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,389,894.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,010,250.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	831,900.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,209,526.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	2,000,000.000	2,018,180.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,460,250.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,872,184.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,080,000.000	970,542.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	1,500,000.000	1,465,455.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,079,357.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,100,000.000	1,077,604.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	900,000.000	857,817.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	799,256.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,010,495.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,033,624.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,319,778.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,758,809.710	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,504,064.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,227,487.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,233,182.720	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,012,316.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,356,235.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,196,344.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,743,307.020	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,559,656.800	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	986,042.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,474,573.850	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,256,964.800	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,945,920.600	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,035,716.220	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,238,707.200	
	イギリス・ポンド 小計			85,754,933.720 (16,758,229,147)	
	イスラエル・シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,865,412.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,437,864.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,714,698.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,086,368.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,119,528.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,042,616.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,000,000.000	2,162,070.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	191,492.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,872,775.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	1,720,000.000	1,192,441.600	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,950,650.000	
		4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	969,000.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,471,900.000	
	イスラエル・シュケル 小計			23,076,814.600 (985,156,138)	
	オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,028,183.300	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,320,258.320	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,302,866.460	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,754,362.720	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,045,463.160	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,134,841.960	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	688,303.440	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,622,140.960	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,118,416.760	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	953,761.080	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,440,180.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,801,485.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,666,344.800	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,096,362.500	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,425,729.200	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,202,741.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,679,440.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	764,666.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,034,800.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,131,576.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,337,856.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,542,665.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,919,580.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,497,456.000	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	897,039.000	
		4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,098,218.000	
		4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	800,000.000	793,984.000	
	オーストラリア・ドル 小計			40,298,720.660 (3,922,274,481)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,306,496.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,364,600.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,421,550.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,154,250.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,462,000.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,655,360.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,514,410.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	12,216,565.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,547,560.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,767,625.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,166,390.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	9,953,623.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,395,990.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	22,801,590.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,177,128.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,609,665.000	
		2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	18,000,000.000	18,435,600.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,123,950.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,860,910.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,431,150.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,889,790.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,699,620.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	11,882,112.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	21,000,000.000	26,558,070.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,813,060.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	15,053,960.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,334,560.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,404,090.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,731,936.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,843,900.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,435,450.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,979,720.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,373,400.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,227,720.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,383,960.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	34,061,120.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	10,017,370.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,757,452.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	23,954,970.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,945,830.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	20,204,790.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,803,600.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,574,560.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,336,800.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,980,400.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	26,033,500.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	19,000,000.000	23,725,300.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,107,660.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	42,935,200.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,895,190.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	36,257,900.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	42,526,800.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,485,700.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	26,011,750.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	21,142,600.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	43,709,760.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,877,800.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	61,321,800.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,786,040.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,203,760.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,699,000.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	60,212,120.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,621,600.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,415,040.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,258,700.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	44,000,000.000	45,744,600.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,984,140.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	86,266,500.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	22,011,780.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,360,450.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,930,000.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,621,880.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,472,050.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,478,840.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,506,880.000	
		1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	10,032,600.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,014,290.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	13,078,390.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,057,140.000	
	オフショア・人民元 小計			1,725,401,412.000 (36,400,793,589)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	755,000.000	692,591.700	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,099,731.250	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,332,190.050	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,200,616.560	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,007,796.790	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,003,601.130	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,233,489.460	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	949,571.550	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,185,675.600	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	631,020.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,896,508.300	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,189,060.800	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,148,711.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,728,180.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,031,771.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	290,343.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,094,884.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,921,674.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,120,822.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,896,111.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,393,050.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	96,843.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,193,772.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,175,545.300	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,321,892.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	599,670.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,655,613.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	817,083.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,212,852.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,010,260.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,874,790.000	
		4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,031,220.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,681,776.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	1,012,720.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,544,580.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	819,048.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	710,654.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	1,100,000.000	1,109,999.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,707,582.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	1,500,000.000	1,483,830.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	800,000.000	800,280.000	
	カナダ・ドル 小計			56,907,408.990 (6,112,424,800)	
	シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	783,811.600	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	812,883.200	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	398,400.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	591,856.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	627,975.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	684,422.400	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	445,455.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	708,375.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	547,470.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	616,252.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	454,140.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	558,000.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	416,500.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	194,398.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	236,760.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	659,990.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,290.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	401,400.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	606,000.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	314,439.000	
		3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	110,209.000	
	シンガポール・ドル 小計			10,269,026.200 (1,169,950,155)	
	スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,181,831.700	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,059,806.800	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,857,494.000	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,343,164.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,042,112.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,437,500.000	
		1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,944,080.000	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	1,200,000.000	1,210,800.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			33,076,788.500 (464,398,110)	
	デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,729,177.400	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,930,068.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,848,894.500	
		0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,139,095.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	442,185.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	2,052,980.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,513.000	
	デンマーク・クローネ 小計			31,192,912.900 (675,014,636)	
	ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	609,726.000	
		3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,406,670.000	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	400,462.300	
		3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	577,776.000	
		1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	449,938.200	
		1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	225,806.000	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	975,469.000	
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	477,765.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	375,548.800	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	252,342.800	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	196,528.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	510,370.000	
		5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	688,142.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	497,485.000	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,255,917.000	
	ニュージーランド・ドル 小計			8,899,946.100 (787,289,232)	
	ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,214,140.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,257,270.500	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,308,095.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,525,599.000	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,238,736.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,996,840.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,528,572.000	
		3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,404,100.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,421,610.000	
		3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,470,215.000	
	ノルウェー・クローネ 小計			32,365,177.500 (444,373,887)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,208,222.880	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,967,627.200	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,287,175.200	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,364,120.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,016,652.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,377,990.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	484,805.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,342,700.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,056,900.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,874,900.000	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,938,540.000	
		5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,218,795.000	
		5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	1,985,700.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	901,320.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	835,666.960	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,370,994.000	
	ポーランド・ズロチ 小計			43,232,108.240 (1,634,212,601)	
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,374,305.150	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,513,221.340	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,534,772.080	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,336,309.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,229.590	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,429,725.570	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,896,297.560	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,443,806.000	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,263,615.000	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,013,755.800	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,565,686.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,203,006.700	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,105,727.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,335,828.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,190,920.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	655,590.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,334,717.000	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,340,604.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,001,620.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,702,627.500	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,614,834.500	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,685,376.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,381,324.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,052,361.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,175.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,463,294.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	999,280.000	
		4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,213,164.000	
		4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	813,592.000	
	マレーシア・リンギット 小計			46,721,763.790 (1,610,158,129)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	35,685,411.300	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	16,723,695.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,437,200.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	28,621,350.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	25,691,100.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	22,088,970.000	
		8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,356,750.000	
		8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,548,300.000	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,709,719.680	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	8,782,242.840	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,231,064.640	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	16,432,300.740	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,242,450.300	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	23,130,120.000	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	6,780,442.320	
	メキシコ・ペソ 小計			299,461,116.820 (2,283,031,662)	
	ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	328,601.000	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	793,425.630	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	272,095.200	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	766,168.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	411,423.900	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	469,140.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	459,695.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	231,318.900	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	268,752.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	436,830.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	197,260.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	514,470.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	192,744.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	298,453.500	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	742,000.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	265,253.400	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	396,752.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	309,150.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,023,080.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	402,576.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	102,847.000	
		2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	503,825.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	610,769.420	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	609,991.200	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	152,596.800	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,232,422.400	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	428,500.800	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,147,164.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,190,348.800	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	868,574.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	739,404.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	256,692.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	156,019.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,034,484.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	448,932.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	144,549.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,652,814.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,343,535.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	247,869.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	299,319.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,332,435.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	520,610.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,025,640.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	844,936.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	511,435.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	520,465.000	
		2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	806,536.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,612,654.700	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	663,462.240	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,437,178.050	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	916,355.280	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	549,316.800	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,063,524.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	448,862.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	504,510.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,417,839.300	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	582,491.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,407,255.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	506,667.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	193,844.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	573,207.200	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,128,144.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,344,768.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	221,010.000	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,182,748.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	516,544.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	770,832.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,531,050.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	588,534.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	721,490.000	
		2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,102,475.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	1,013,060.000	
		2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,390.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,296,665.370	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,394,328.520	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,039,689.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,337,941.830	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,635,715.360	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,806,406.650	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	771,000.000	902,756.190	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,326,571.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,253,952.680	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,304,983.180	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,724,681.280	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,703,057.420	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,092,976.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,342,777.800	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,122,758.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,181,233.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,739,773.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,818,262.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,860,314.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,387,074.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,741,250.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,549,288.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,581,982.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,662,255.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,891,020.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,611,234.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,074,408.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,681,063.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,845,792.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,854,600.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	925,548.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,400,176.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	612,759.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,283,162.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,344,352.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,626,587.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	2,042,432.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,207,808.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,428,536.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,720,995.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	870,780.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,480,712.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,526,940.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,399,880.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,800,000.000	1,819,026.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	500,000.000	508,715.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,613,190.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,089,816.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	302,529.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	803,832.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	809,384.000	
		2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,010,920.000	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	99,928.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,143,394.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,702,672.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,962,608.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,948,640.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	422,720.100	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	100,730.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,486.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,296.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,103,531.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,200.700	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,725,780.830	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,227,000.000	2,680,372.660	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,058,700.880	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	3,207,522.240	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,575,410.160	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,630,310.320	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,867,992.980	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,706,268.380	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,160,799.880	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,088,000.000	1,066,849.280	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,061,259.780	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,761,651.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,281,580.390	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,430,920.240	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	873,823.870	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,901,770.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,301,565.300	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,299,258.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,967,376.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,109,534.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,426,528.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,634,041.500	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,913,946.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	6,350,000.000	5,816,536.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,708,264.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,457,684.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,922,240.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,461,658.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,280,400.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	529,307.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,000,000.000	1,791,330.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,811,744.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,800,000.000	4,573,344.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,336,868.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,931,480.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,357,790.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,086,806.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,852,073.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	880,370.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,894,221.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,215,104.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,629,026.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,339,431.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,335,200.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	650,076.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,113,981.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,131,072.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	1,006,340.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	2,700,000.000	2,693,979.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,252,820.270	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,018,741.400	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,998,568.390	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,484,309.480	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,987,641.600	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	134,686.620	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,129,314.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,286,995.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,100,712.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	892,260.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,239,406.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,205,700.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	642,500.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,122,836.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	643,788.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	825,525.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	97,739.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	525,096.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	1,062,996.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	907,452.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,318,551.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	657,822.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	1,004,100.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,210,421.700	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,661,100.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,390,966.020	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,889,000.050	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,883,599.040	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,352,544.900	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,363,690.900	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,066,152.200	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,047,430.320	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	771,050.720	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,422,555.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,505,877.700	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,556,989.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,680,074.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,216,189.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,073,540.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,577,336.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,275,080.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,450,377.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,947,009.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,094,981.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,170,725.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,770,458.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,282,226.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,207,651.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,230,525.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,808,480.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,962,261.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,116,950.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,666,289.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,158,210.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,682,963.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	791,316.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	527,331.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,769,337.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,549,638.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,517,142.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,068,705.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	660,000.000	435,613.200	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	745,784.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,661,284.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,989,547.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	863,770.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,383,498.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	573,928.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	291,732.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	805,120.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,536,576.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,226,630.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	201,262.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,596,270.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,339,468.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,061,436.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	315,441.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,541,655.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,738,032.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	876,512.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	509,230.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	960,426.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,252,788.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,286,354.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	729,764.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	922,455.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,260,335.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,590,435.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	633,930.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,384.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,032,300.000	
		4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,110,100.000	
		3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	100,887.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	411,072.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	732,543.000	
		4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	52,856.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	500,000.000	513,880.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,538,325.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,174.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	521,450.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	202,330.000	
		4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	736,141.000	
		3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,309,542.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	805,104.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,402,925.040	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,367,603.470	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,141,181.250	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,625,717.780	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,903,276.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,783,150.160	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,588,534.150	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,122,971.300	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,597,859.500	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,053,802.660	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,409,676.900	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,527,080.900	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,263,341.920	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,104,000.000	1,255,623.360	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,028,267.240	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	850,239.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	690,639.870	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	761,372.280	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	969,264.600	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	827,333.150	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,056,250.470	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	495,319.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	770,048.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	687,900.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	710,040.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	907,487.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	466,860.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	282,047.500	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	478,685.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	711,568.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	683,608.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	286,776.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,859.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	209,302.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	302,382.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	908,217.750	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,568,254.330	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	300,000.000	309,660.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	406,049.540	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	748,572.510	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	757,484.370	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	396,511.590	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	393,906.810	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,028,557.480	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,993,210.200	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,723,762.460	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,808,157.120	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,050,000.000	1,017,271.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,589,629.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,869,790.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,692,880.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,003,649.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,330,016.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,945,834.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,807,722.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,537,856.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	2,025,022.500	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,479,964.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,307,481.600	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	826,322.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	400,000.000	385,316.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,232,864.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	968,461.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	487,570.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,883,970.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	344,812.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,328,000.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	535,682.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,650,530.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	417,492.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	859,230.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,828,008.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,154,496.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,345,048.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,680,484.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,008,200.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,673,086.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,317,572.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,260,209.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,584,060.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	626,766.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,678,936.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,112.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,081,350.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,672,400.000	
		3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	400,000.000	411,608.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	201,968.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,636,895.060	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,954,903.160	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,226,534.300	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,327,153.500	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,078,753.850	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,950,079.800	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,631,829.780	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	550,000.000	619,454.000	
		4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	712,606.000	
		2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	850,197.600	
		3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	680,985.900	
		2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,300,845.000	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	470,000.000	534,197.300	
		2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	697,312.800	
		1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	991,120.000	
		0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	813,501.000	
		0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	597,698.600	
		0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	550,000.000	454,657.500	
		1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	530,000.000	322,812.400	
		0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	653,407.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	386,516.000	
		1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	538,461.900	
		3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	530,805.000	
		2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	638,467.200	
		3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	254,954.400	
	ユーロ 小計			606,288,047.810 (97,842,765,155)	
国債証券 合計				324,394,571,828 [324,394,571,828]	
合計				324,394,571,828 [324,394,571,828]	

（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	282 銘柄	100%	47.3%
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	13 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	27 銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券	79 銘柄	100%	11.2%
カナダ・ドル	国債証券	41 銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券	21 銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8 銘柄	100%	0.1%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券	15 銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	10 銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16 銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	29 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	401 銘柄	100%	30.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2023年12月18日現在 金　額（円）	2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,490,491,252	6,739,841,082
投資証券	※2	396,524,083,100	253,282,199,744
未収入金		3,845,463,875	1,090,085,949
未収配当金		2,183,738,409	1,671,925,406
前払金		28,280,000	58,240,000
差入委託証拠金		522,937,908	477,207,668
流動資産合計		406,594,994,544	263,319,499,849
資産合計		406,594,994,544	263,319,499,849
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		115,696,000	81,256,000
未払解約金		55,330,000	1,036,039,000
流動負債合計		171,026,000	1,117,295,000
負債合計		171,026,000	1,117,295,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	126,407,264,091	86,235,422,547
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		280,016,704,453	175,966,782,302
元本等合計		406,423,968,544	262,202,204,849
純資産合計		406,423,968,544	262,202,204,849
負債純資産合計		406,594,994,544	263,319,499,849

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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	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、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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1.　※1　期首	2022 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 19 日
期首元本額	147,074,195,757 円	126,407,264,091 円
期中追加設定元本額	15,840,714,197 円	6,954,092,175 円
期中一部解約元本額	36,507,645,863 円	47,125,933,719 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	4,182,047,912 円	3,409,516,133 円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	108,317,971,329 円	65,612,425,608 円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年１回決算型）	435,013,976 円	740,904,069 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	20,894,901 円	26,039,587 円
ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	676,381,336 円	602,624,144 円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	2,387,649,719 円	3,343,787,945 円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	2,514,869 円	106,813,641 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	50,619 円	402,452 円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,432,509,358 円	5,235,391,280 円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	8,504,119円	9,854,023円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,667,097円	10,974,561円
ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	3,390,101円	5,833,615円
ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド	98,969,094円	80,451,279円
ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	2,960,929,609円	4,413,686,051円
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	531,516,611円	1,316,355,536円
ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	483,088,653円	635,940,818円
スタイル９（6資産分散・保守型）	12,261円	78,153円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	26,062円	3,016,134円
スタイル９（6資産分散・積極型）	19,007円	1,622,065円
スタイル９（8資産分散・保守型）	10,721円	106,132円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	23,012円	2,184,396円
スタイル９（8資産分散・積極型）	7,948円	1,188,682円
ダイワ・インデックスセレクト　Ｊ－ＲＥＩＴ	857,065,777円	676,226,243円
計	126,407,264,091円	86,235,422,547円
2.　期末日における受益権の総数	126,407,264,091口	86,235,422,547口
3.　※2　差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,652,550,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　679,000,000円

（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12月19日 至2024年12月18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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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 12 月 18 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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△17,958,716,272	△21,350,591,373
合計	△17,958,716,272	△21,350,591,373

（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

不動産投信関連

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	10,018,680,000	－	9,903,600,000	△115,080,000	9,004,240,000	－	8,923,600,000	△80,640,000
合計	10,018,680,000	－	9,903,600,000	△115,080,000	9,004,240,000	－	8,923,600,000	△80,640,000

(注)　1.　時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2.　不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3.　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.2152円 (32,152円)	3.0405円 (30,405円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	5,964	648,286,800	
	サンケイリアルエステート	8,633	633,662,200	
	SOSILA 物流リート投	13,445	1,380,801,500	
	東海道リート投資法	4,604	472,370,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	9,305	5,294,545,000	
	森ヒルズリート	31,689	3,847,044,600	
	産業ファンド	49,340	5,516,212,000	
	アドバンス・レジデンス	26,484	7,571,775,600	
	ＡＰＩ投資法人	13,098	4,093,125,000	
	ＧＬＰ投資法人	90,518	10,970,781,600	
	コンフォリア・レジデンシャル	13,645	3,693,701,500	
	日本プロロジスリート	46,945	10,384,234,000	
	星野リゾート・リート	11,397	2,548,369,200	
	Ｏｎｅリート投資法人	4,701	1,046,912,700	
	イオンリート投資	33,056	4,065,888,000	
	ヒューリックリート投資法	23,812	3,078,891,600	
	日本リート投資法人	8,753	2,652,159,000	
	積水ハウス・リート投資	80,977	6,024,688,800	
	トーセイ・リート投資法人	5,859	713,626,200	
	ヘルスケア&メディカル投資	6,644	684,332,000	
	サムティ・レジデンシャル	7,342	653,438,000	
	野村不動産マスターＦ	86,262	11,714,379,600	※
	いちごホテルリート投資	4,460	666,770,000	
	ラサールロジポート投資	34,501	4,785,288,700	
	スターアジア不動産投	49,660	2,502,864,000	
	マリモ地方創生リート	4,893	514,254,300	
	三井不ロジパーク	58,740.944	5,827,101,644	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	5,683	354,050,900	
	投資法人みらい	37,108	1,452,778,200	
	三菱地所物流 REIT	9,305	3,135,785,000	
	CRE ロジスティクスファンド	11,601	1,604,418,300	
	ザイマックス・リート	4,614	507,078,600	
	タカラレーベン不動産投	17,599	1,462,476,900	
	日本ビルファンド	157,186	19,302,440,800	
	ジャパンリアルエステイト	27,681	14,920,059,000	
	日本都市ファンド投資法人	139,736	12,059,216,800	
	オリックス不動産投資	53,694	8,655,472,800	
	日本プライムリアルティ	18,429	5,888,065,500	
	NTT 都市開発リート投資法人	27,390	3,182,718,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	東急リアル・エステート	18,068	2,780,665,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	19,515	1,863,682,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	60,281	8,168,075,500	
	森トラストリート投資法人	51,943	3,100,997,100	
	インヴィンシブル投資法人	148,474	9,680,504,800	
	フロンティア不動産投資	9,999	3,894,610,500	
	平和不動産リート	19,760	2,278,328,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	18,106	4,682,211,600	
	福岡リート投資法人	15,205	2,134,782,000	
	KDX 不動産投資法人	75,392	10,901,683,200	
	いちごオフィスリート投資法人	19,663	1,512,084,700	
	大和証券オフィス投資法人	11,165	3,219,986,000	
	阪急阪神リート投資法人	12,848	1,518,633,600	
	スターツプロシード投資法人	4,671	798,741,000	
	大和ハウスリート投資法人	40,414	9,117,398,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	99,000	7,009,200,000	
	大和証券リビング投資法人	39,801	3,458,706,900	
	ジャパンエクセレント投資法人	23,140	2,651,844,000	
投資証券 合計			253,282,199,744	
合計			253,282,199,744	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターＦ　5,000 口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月18日現在 金　額（円）	2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	530,744,114	384,813,214
コール・ローン	201,790,101	477,425,849
投資信託受益証券	1,190,063,836	2,436,751,481
投資証券	34,096,995,311	44,581,526,801
派生商品評価勘定	53,139,370	10,905,213
未収入金	162,779,094	8,188,260
未収配当金	120,067,844	152,190,003
差入委託証拠金	286,867,758	458,266,664
流動資産合計	36,642,447,428	48,510,067,485
資産合計	36,642,447,428	48,510,067,485
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,624,652	11,154,736
未払金	251,754,199	70,119,584
未払解約金	16,411,000	22,453,000
流動負債合計	274,789,851	103,727,320
負債合計	274,789,851	103,727,320
純資産の部		
元本等		
元本　※1	10,445,718,817	11,802,580,977
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	25,921,938,760	36,603,759,188
元本等合計	36,367,657,577	48,406,340,165
純資産合計	36,367,657,577	48,406,340,165
負債純資産合計	36,642,447,428	48,510,067,485

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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 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、市場価格のない有価証券については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。また、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。 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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1.　※1 期首	2022 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 19 日
期首元本額	9,133,427,619 円	10,445,718,817 円
期中追加設定元本額	2,187,181,975 円	2,291,480,579 円
期中一部解約元本額	874,890,777 円	934,618,419 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド 2023-01（適格機関投資家専用）	92,408,770 円	81,228,434 円
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	1,721,650,522 円	2,220,179,211 円
ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	271,581,866 円	348,458,085 円
Ｄ－Ｉ’ｓ グローバルＲＥＩＴインデックス	1,522,467 円	1,418,982 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2050	17,406,934 円	19,354,919 円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	708,540,551 円	639,683,559 円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,396,093,659 円	2,505,567,342 円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	369,788,330 円	399,772,618 円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	254,293,639 円	233,694,425 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2060	556,964 円	3,988,687 円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	4,036,311,343 円	4,465,154,844 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2030	8,311,324 円	7,266,352 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2040	8,548,978 円	8,113,100 円

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	3,261,395円	4,512,917円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	143,999,267円	128,911,402円
スタイル９（6資産分散・保守型）	9,610円	36,802円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	20,459円	1,875,063円
スタイル９（6資産分散・積極型）	22,574円	1,571,462円
スタイル９（8資産分散・保守型）	8,401円	45,990円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	18,041円	1,219,504円
スタイル９（8資産分散・積極型）	9,006円	1,269,394円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルＲＥＩＴ	239,359,246円	188,715,773円
ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	66,749,561円	61,268,444円
ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	13,065,384円	241,581,630円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	92,180,526円	80,995,964円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	－円	78,847,818円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	－円	77,848,256円
計	10,445,718,817円	11,802,580,977円
2.　期末日における受益権の総数	10,445,718,817口	11,802,580,977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12月19日 至2024年12月18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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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 12 月 18 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 12 月 18 日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024 年 12 月 18 日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	85,687,359	△113,934,008
投資証券	2,838,757,054	△2,303,581,204
合計	2,924,444,413	△2,417,515,212

（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. 不動産投信関連

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	1,029,127,460	－	1,082,266,830	53,139,370	1,454,680,152	－	1,443,525,416	△11,154,736
合計	1,029,127,460	－	1,082,266,830	53,139,370	1,454,680,152	－	1,443,525,416	△11,154,736

（注）
1. 時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	191,748,233	－	185,123,581	△6,624,652	510,745,240	－	521,650,453	10,905,213
アメリカ・ドル	107,228,605	－	103,382,162	△3,846,443	348,313,004	－	355,763,494	7,450,490
ユーロ	75,405,578	－	72,628,019	△2,777,559	162,432,236	－	165,886,959	3,454,723
香港・ドル	9,114,050	－	9,113,400	△650	－	－	－	－
合計	191,748,233	－	185,123,581	△6,624,652	510,745,240	－	521,650,453	10,905,213

（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12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4816円 (34,816円)	4.1013円 (41,013円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	170,300	15,849,821.000	
	アメリカ・ドル 小計			15,849,821.000 (2,436,751,481)	
投資信託受益証券 合計				2,436,751,481 [2,436,751,481]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,585	341,746.650	
		URBAN EDGE PROPERTIES	23,660	527,144.800	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,880	317,086.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,797	6,308,251.180	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	60,130	10,820,994.800	
		BXP INC	28,462	2,287,206.320	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,900	213,891.000	
		VORNADO REALTY TRUST	32,400	1,450,872.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18,648	217,062.720	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,656	561,944.400	
		UNITI GROUP INC	46,942	275,080.120	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,288	191,544.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	66,857	4,865,183.890	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,798	701,643.960	
		EPR PROPERTIES	14,806	664,641.340	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	42,375.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	37,994	276,976.260	
		EQUINIX INC	18,606	17,877,389.040	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18,098	508,734.780	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,953	85,948.800	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,743	1,301,241.830	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	24,893	434,382.850	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,748	89,499.800	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	35,741.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	137,786	2,579,353.920	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	61,689	2,276,324.100	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,116	84,873.080	
		RLJ LODGING TRUST	30,035	317,770.300	
		FARMLAND PARTNERS INC	7,936	100,152.320	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	13,053	141,363.990	
		KIMCO REALTY CORP	132,185	3,212,095.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,995	101,477.700	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	71,003	1,243,262.530	
		WHITESTONE REIT	8,817	134,194.740	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	53,836	2,637,425.640	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	23,773	224,179.390	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	40,784	631,744.160	
		INVITATION HOMES INC	111,725	3,619,890.000	
		OUTFRONT MEDIA INC	26,900	493,884.000	
		LAMAR ADVERTISING CO-A	17,200	2,210,028.000	
		JBG SMITH PROPERTIES	16,961	279,347.670	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	14,194	264,718.100	
		GLADSTONE LAND CORP	6,132	68,985.000	
		AMERICOLD REALTY TRUST	51,043	1,139,279.760	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	40,915.140	
		VICI PROPERTIES INC	205,400	6,172,270.000	
		BRT APARTMENTS CORP	2,049	38,931.000	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,539	560,879.140	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	34,295	1,120,760.600	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,517	143,574.700	
		BROADSTONE NET LEASE INC	36,819	617,454.630	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,816	143,630.400	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,128	251,020.000	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	43,931	930,458.580	
		PARAMOUNT GROUP INC	35,039	173,443.050	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	26,374	291,696.440	
		NETSTREIT CORP	14,791	220,829.630	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,700	75,961.000	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	42,824	1,709,534.080	
		STAG INDUSTRIAL INC	35,577	1,258,714.260	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	35,659.160	
		POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,925	52,830.500	
		PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	23,963	933,598.480	
		ORION OFFICE REIT INC	9,048	36,463.440	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	169,000	98,020.000	
		VENTAS INC	81,045	4,880,529.900	
		CARETRUST REIT INC	32,800	935,784.000	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	14,800	456,580.000	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	59,091	1,692,957.150	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	9,465.980	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	45,776	807,946.400	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		UMH PROPERTIES INC	13,139	253,714.090	
		CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,816	86,535.680	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	6,019	42,373.760	
		PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,900	89,976.000	
		NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,829	91,687.890	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	29,100	824,985.000	
		LINEAGE INC	11,600	702,554.000	
		MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	25,104.000	
		CURBLINE PROPERTIES	18,444	427,531.920	
		IRON MOUNTAIN INC	57,513	6,331,606.170	
		TERRENO REALTY CORP	18,927	1,173,095.460	
		SUN COMMUNITIES INC	22,907	2,812,979.600	
		ACADIA REALTY TRUST	20,544	516,887.040	
		ALEXANDER'S INC	393	83,842.620	
		PROLOGIS INC	181,600	19,770,792.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30,460	3,116,362.600	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	33,041	192,959.440	
		SAUL CENTERS INC	2,261	90,824.370	
		VERIS RESIDENTIAL INC	15,496	271,644.880	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	20,868	2,474,736.120	
		COUSINS PROPERTIES INC	29,716	929,516.480	
		SITE CENTERS CORP	9,022	139,119.240	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	9,542	1,600,384.240	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,567	3,695,954.700	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,842	1,344,042.420	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,663	1,676,420.790	
		GETTY REALTY CORP	9,698	311,693.720	
		WELLTOWER INC	113,535	14,672,128.050	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	138,040	2,880,894.800	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,674	646,062.500	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	30,381	77,775.360	
		EQUITY COMMONWEALTH	20,957	35,207.760	
		KILROY REALTY CORP	20,667	868,634.010	
		LTC PROPERTIES INC	8,490	309,969.900	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	57,532	505,130.960	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,891	3,572,598.370	
		MACERICH CO/THE	46,000	982,560.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,566	2,513,912.500	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	8,456	606,887.120	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	35,942	1,505,250.960	
		REALTY INCOME CORP	170,816	9,312,888.320	
		COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	21,964	705,922.960	
		PUBLIC STORAGE	30,903	9,683,764.080	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		REGENCY CENTERS CORP	32,007	2,416,528.500	
		SAFEHOLD INC	8,705	180,976.950	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	21,335	755,472.350	
		SL GREEN REALTY CORP	13,762	1,019,901.820	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,467	98,739.480	
		UDR INC	58,860	2,613,972.600	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,429	93,710.820	
		WP CAREY INC	42,876	2,416,491.360	
		ELME	16,897	268,662.300	
		AGREE REALTY CORP	19,686	1,443,180.660	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,553	1,988,755.020	
		CUBESMART	44,111	2,008,814.940	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,752	492,129.760	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	60,304	11,156,240.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	41,521	6,414,579.290	
		CENTERSPACE	2,959	202,070.110	
		KITE REALTY GROUP TRUST	42,907	1,115,152.930	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,892	83,202.840	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,128	135,493.760	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	40,119	389,154.300	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,379	465,994.630	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	33,290.400	
		DOUGLAS EMMETT INC	32,658	663,610.560	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	33,482.870	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	29,089.500	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
		PRIME US REIT	155,920	27,130.080	
	アメリカ・ドル 小計			230,349,580.770 (35,413,944,547)	
	イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	77,771	62,139.020	
		HELICAL PLC	20,666	38,397.420	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	23,249.000	
		HAMMERSON REIT PLC	93,880	264,366.080	
		ASSURA PLC	615,774	235,964.590	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	121,852	101,015.300	
		ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	7,312.720	
		CLS HOLDINGS PLC	29,656	23,902.730	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	112,420	72,735.740	
		REGIONAL REIT LTD	31,830	37,495.740	
		NEWRIVER REIT PLC	59,545	46,861.910	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	400,976	508,437.560	
		CUSTODIAN REIT PLC	90,504	69,326.060	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		PRS REIT PLC/THE	107,892	114,797.080	
		CARE REIT PLC	85,680	69,400.800	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	37,508.060	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	125,239	104,198.840	
		AEW UK REIT PLC	27,617	27,948.400	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	255,846	177,557.120	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	95,301	99,303.640	
		HOME REIT PLC	117,587	0.000	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	154,025	881,023.000	
		SEGRO PLC	279,635	1,955,767.190	
		UNITE GROUP PLC/THE	85,276	691,161.980	
		BRITISH LAND CO PLC	206,235	737,083.890	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,989	248,607.440	
		DERWENT LONDON PLC	23,052	454,585.440	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	276,353	253,830.230	
		WORKSPACE GROUP PLC	28,401	143,425.050	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	44,854	299,848.990	
		BIG YELLOW GROUP PLC	40,322	389,107.300	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	422,277	764,321.370	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	46,149.100	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	509,269	672,235.080	
	イギリス・ポンド 小計			9,659,063.870 (1,887,574,262)	
	イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	156,103	312,206.000	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	46,479	453,635.040	
		REIT 1 LTD	40,686	800,700.480	
	イスラエル・シュケル 小計			1,566,541.520 (66,876,128)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	230,363	1,541,128.470	
		HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	91,312.590	
		ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	115,395	131,550.300	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	71,065	182,637.050	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	274,625	101,611.250	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	111,495	319,990.650	
		RURAL FUNDS GROUP	79,145	137,712.300	
		WAYPOINT REIT	142,830	342,792.000	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	142,454	531,353.420	
		CENTURIA OFFICE REIT	86,351	98,440.140	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	175,165	321,778.100	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	383,161	448,298.370	
		REGION GROUP	248,839	532,515.460	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	55,242	134,238.060	
		NATIONAL STORAGE REIT	291,323	690,435.510	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	43,255	112,895.550	
		SCENTRE GROUP	1,112,672	3,883,225.280	
		ARENA REIT	82,725	318,491.250	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	41,492	157,254.680	
		BWP TRUST	116,344	390,915.840	
		GPT GROUP	410,276	1,829,830.960	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	109,971	355,206.330	
		MIRVAC GROUP	845,119	1,656,433.240	
		STOCKLAND	511,281	2,546,179.380	
		ABACUS GROUP UNIT	90,924	102,744.120	
		GOODMAN GROUP	406,123	14,925,020.250	
		VICINITY CENTRES	828,750	1,698,937.500	
		CHARTER HALL GROUP	101,305	1,480,066.050	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	79,716	377,056.680	
	オーストラリア・ドル 小計			35,440,050.780 (3,449,380,143)	
	カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	54,250.000	
		PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	9,941	159,254.820	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	72,324.000	
		SLATE GROCERY REIT	6,100	87,718.000	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,400	218,860.000	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	52,689.000	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	25,600	119,040.000	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,500	473,915.000	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	28,200	344,886.000	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,800	154,660.000	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	22,200	391,386.000	
		CHOICE PROPERTIES REIT	34,400	473,000.000	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	67,944.000	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,200	164,864.000	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	15,100	383,540.000	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17,400	765,078.000	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,766	260,433.180	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,200	581,568.000	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	29,947.500	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,100	343,638.000	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	11,000	152,680.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,100	235,276.000	
	カナダ・ドル 小計			5,586,951.500 (600,094,461)	
	シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	380,983	819,113.450	
		AIMS APAC REIT	134,700	168,375.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	623,090	551,434.650	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	114,700	79,716.500	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	363,740	198,238.300	
		EC WORLD REIT	36,500	5,110.000	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	753,377	1,921,111.350	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,157,522	2,234,017.460	
		SUNTEC REIT	465,200	553,588.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	716,900	910,463.000	
		KEPPEL REIT	508,800	432,480.000	
		CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	544,056	478,769.280	
		ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,271,302	324,182.010	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,400	121,040.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	250,276	530,585.120	
		STARHILL GLOBAL REIT	293,700	145,381.500	
		CAPITALAND CHINA TRUST	242,242	173,203.030	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	82,300	302,864.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	440,069	976,953.180	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	492,084	595,421.640	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	217,000	132,370.000	
		OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	469,400	131,432.000	
	シンガポール・ドル 小計			11,785,849.470 (1,342,761,830)	
	ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	218,742	440,765.130	
	ニュージーランド・ドル 小計			440,765.130 (38,990,083)	
	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,680	172,416.000	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,201	187,496.050	
		HAMBORNER REIT AG	12,056	76,314.480	
		WERELDHAVE NV	6,098	83,054.760	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,741	1,291,189.980	
		NSI NV	3,090	59,698.800	
		ICADE	5,324	114,998.400	
		CARMILA	9,521	150,812.640	
		ALTAREA	837	77,422.500	
		GECINA SA	9,170	820,715.000	
		KLEPIERRE	38,853	1,079,336.340	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		COVIVIO	9,424	461,022.080	
		MERCIALYS	15,523	155,385.230	
		AEDIFICA	8,364	460,020.000	
		COFINIMMO	6,701	356,493.200	
		RETAIL ESTATES	2,180	126,004.000	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,099	598,966.740	
		CARE PROPERTY INVEST	6,301	69,689.060	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	5,912	172,926.000	
		MONTEA NV	3,565	222,812.500	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,559	25,187.960	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,412	69,483.120	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	59,589	305,393.620	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	69,411	698,274.660	
		CROMWELL REIT EUR	59,320	93,725.600	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	88,042	78,181.290	
	ユーロ 小計			8,007,020.010 (1,292,172,889)	
	韓国・ウォン	SK REITS LTD	29,133	130,224,510.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,401	122,413,720.000	
		LOTTE REIT CO LTD	29,483	93,313,695.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	44,436,660.000	
		JR REIT XXVII	37,352	110,748,680.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	40,519,675.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	33,975	146,432,250.000	
	韓国・ウォン 小計			688,089,190.000 (73,625,543)	
	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	501,000	480,960.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	331,230.000	
		FORTUNE REIT	313,000	1,233,220.000	
		LINK REIT	551,800	18,292,170.000	
		CHAMPION REIT	398,000	688,540.000	
	香港・ドル 小計			21,026,120.000 (416,106,915)	
投資証券 合計				44,581,526,801 [44,581,526,801]	
合計				47,018,278,282 [47,018,278,282]	

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

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

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

3.　外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　1 銘柄 投資証券　141 銘柄	6.4%	93.6%	80.5%
イギリス・ポンド	投資証券　34 銘柄	-%	100%	4.0%
イスラエル・シュケル	投資証券　3 銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券　29 銘柄	-%	100%	7.3%
カナダ・ドル	投資証券　22 銘柄	-%	100%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券　22 銘柄	-%	100%	2.9%
ニュージーランド・ドル	投資証券　1 銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券　26 銘柄	-%	100%	2.7%
韓国・ウォン	投資証券　7 銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券　5 銘柄	-%	100%	0.9%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ短期日本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12月18日現在 金　額（円）	2024年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,124,512	5,111,467
国債証券	451,939,790	527,947,150
未収利息	101,590	157,545
前払費用	12,583	115,729
流動資産合計	457,178,475	533,331,891
資産合計	457,178,475	533,331,891
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,000	－
流動負債合計	1,000	－
負債合計	1,000	－
純資産の部		
元本等		
元本　※1	438,719,306	514,496,492
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,458,169	18,835,399
元本等合計	457,177,475	533,331,891
純資産合計	457,177,475	533,331,891
負債純資産合計	457,178,475	533,331,891

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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 日
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。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1. ※1 期首	2022 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 19 日
期首元本額	347,622,118 円	438,719,306 円
期中追加設定元本額	126,667,022 円	156,102,799 円
期中一部解約元本額	35,569,834 円	80,325,613 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2050	65,190,584 円	89,130,290 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2060	985,533 円	8,503,653 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2020	89,325,506 円	70,567,206 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2030	201,611,475 円	242,410,057 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー 2040	81,606,208 円	103,885,286 円
計	438,719,306 円	514,496,492 円
2. 期末日における受益権の総数	438,719,306 口	514,496,492 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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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 12 月 19 日 至 2024 年 12 月 18 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。 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 12 月 18 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 12 月 18 日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024 年 12 月 18 日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△626,450	△2,109,630
合計	△626,450	△2,109,630

（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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 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 12 月 18 日現在	2024 年 12 月 18 日現在
1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	1.0421 円 (10,421 円)	1.0366 円 (10,366 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	463 2年国債	41,000,000	40,897,910	
	147 5年国債	14,000,000	13,916,420	
	148 5年国債	29,000,000	28,770,900	
	149 5年国債	58,000,000	57,440,880	
	150 5年国債	52,000,000	51,428,000	
	152 5年国債	63,000,000	62,356,140	
	153 5年国債	62,000,000	61,135,720	
	154 5年国債	40,000,000	39,479,600	
	155 5年国債	55,000,000	54,529,200	
	342 10年国債	70,000,000	69,664,700	
	343 10年国債	35,000,000	34,773,200	
	97 20年国債	5,000,000	5,221,600	
	98 20年国債	8,000,000	8,332,880	
国債証券 合計			527,947,150	
合計			527,947,150	

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。

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	621,811,045 円
Ⅱ	負債総額	80,188 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	621,730,857 円
Ⅳ	発行済数量	305,844,584 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0328 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）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）ダイワＪ－ＲＥＩＴ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	266,271,638,575 円
Ⅱ	負債総額	847,027,900 円

Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	265,424,610,675 円
Ⅳ	発行済数量	85,086,675,514 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1195 円

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024 年 12 月 30 日

Ⅰ	資産総額	48,651,638,081 円
Ⅱ	負債総額	115,882,518 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,535,755,563 円
Ⅳ	発行済数量	11,857,973,304 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0931 円

（参考）ダイワ短期日本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	534,928,351 円
Ⅱ	負債総額	66,500 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	534,861,851 円
Ⅳ	発行済数量	515,921,848 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0367 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

（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030）

約　　款

大和アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

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。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券
4. ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
5. 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
6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

(2) 投資態度

① 主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

② マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030年に近づくに従って株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の38%
外国株式インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の22%
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の 8%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
……信託財産の純資産総額の 7%
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
……信託財産の純資産総額の14%
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の11%

③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

④ 2030年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

⑤ 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。

(3) 投資制限

① 株式への投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

② 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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
（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030）
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、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。
③　受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、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第2条第1項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。以下本条、第17条第1項、同条第2項および第21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、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
②　委託者は、受託者と合意のうえ、前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40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44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20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　この信託のすべての受益権は、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、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。

（受益権の設定にかかる受託者の通知）

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

（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 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。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を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。

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権の価額は、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29条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することができます。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第13条 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14条　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。

（投資の対象とする資産の種類）

第15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．約束手形

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

2.　次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（有価証券および金融商品の指図範囲等）

第16条　委託者は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の第1号から第7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8号から第11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.　外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3.　ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券

4.　ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券

5.　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

6.　ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

7.　外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

8.　コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

10.　外国法人が発行する譲渡性預金証書

11.　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。）

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

③　第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

（利害関係人等との取引等）

第17条　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、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人、第21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15

条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第24条から第26条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、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、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第24条から第26条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

（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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第19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20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20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21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

（混蔵寄託）

第22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23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、すみ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24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25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、有価証券等にかかる利子等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26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27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28条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、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、有価証券等にかかる利子等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29条　この信託の計算期間は、毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年2月28日から2008年12月18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等）
第30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。
③　受託者は、前2項の報告を行なうことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行なわないこととします。
④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。
（信託事務の諸費用および監査報酬）
第31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（有価証券等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、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32条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第29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、計算期間に応じ、次の各号に掲げる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。
1. 第1計算期間から第8計算期間までおよび第9計算期間の期首から2016年3月11日まで……年10,000分の65
2. 2016年3月12日から第9計算期間の期末までおよび第10計算期間から第18計算期間まで……年10,000分の34
3. 第19計算期間から第23計算期間まで……年10,000分の28
4. 第24計算期間以降……年10,000分の22
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33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。
（収益分配金の再投資）
第34条　収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、指定販売会社に支払われます。
②　指定販売会社は、積立投資契約に基づき、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　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の支払いは、委託者において行なうものとします。
④　収益分配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。

（償還金および一部解約金の支払い）

第35条　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。

②　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。

③　前2項に規定する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。

④　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36条　受託者は、収益分配金については第34条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1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2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。

（償還金の時効）

第37条　受益者が、信託終了による償還金について第35条第1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38条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、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　受益者が第1項の一部解約請求をするときは、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。

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39条　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40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、あるいは、第24計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、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、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、この信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第41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45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42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45条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託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43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44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違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。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45条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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。

（信託約款の変更等）

第45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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属

するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、この信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第2項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第46条　この信託は、受益者が第38条の規定による一部解約請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第47条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1.他の受益者の氏名または名称および住所

2.他の受益者が有する受益権の内容

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第47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48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49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34条第4項および第35条第4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。

2008年 2月28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