【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2023年2月21日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワライフスタイル２５
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル２５

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2023年2月22日から2023年8月24日まで（継続申込期間）

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞

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

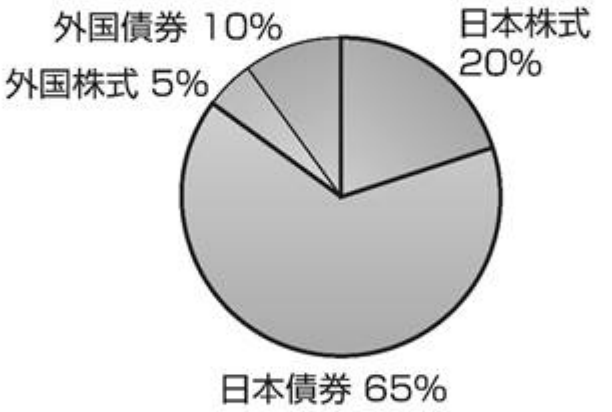
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国内	海外	合計
株式	20%	5%	25%
債券	65%	10%	75%
合計	85%	15%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

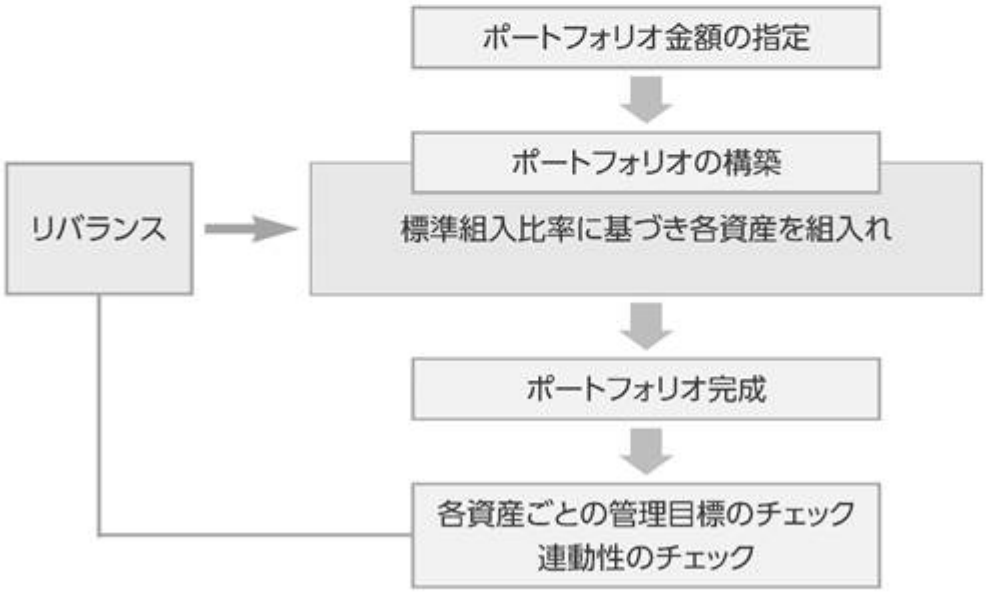
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

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

3 毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
②原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）および株式を組入可能な投資信託証券（各マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

●外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

2．日本債券インデックスマザーファンド

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデル(注)の使用により効率的なＤＢＩ総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またＤＢＩ総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行ないます。

(注) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。このモデルを用いることにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ないポートフォリオを効率的に構築および管理することができます。

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対　象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期　間：残存期間1年以上
種　類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

3. 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

(2)【ファンドの沿革】

2000年 4月28日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2000年12月 1日	ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル２５」）

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

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

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

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

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

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

損益↑↓投資

投資対象	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）、 わが国の公社債、外国の株式（預託証書を含みます。）、 外国の公社債　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

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

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

＜委託会社の概況（2022年11月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%
日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の65%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

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

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

ホ．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。

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

(2)【投資対象】

①　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の5．から25．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します。

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

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

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

23．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。）

24．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

25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

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

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

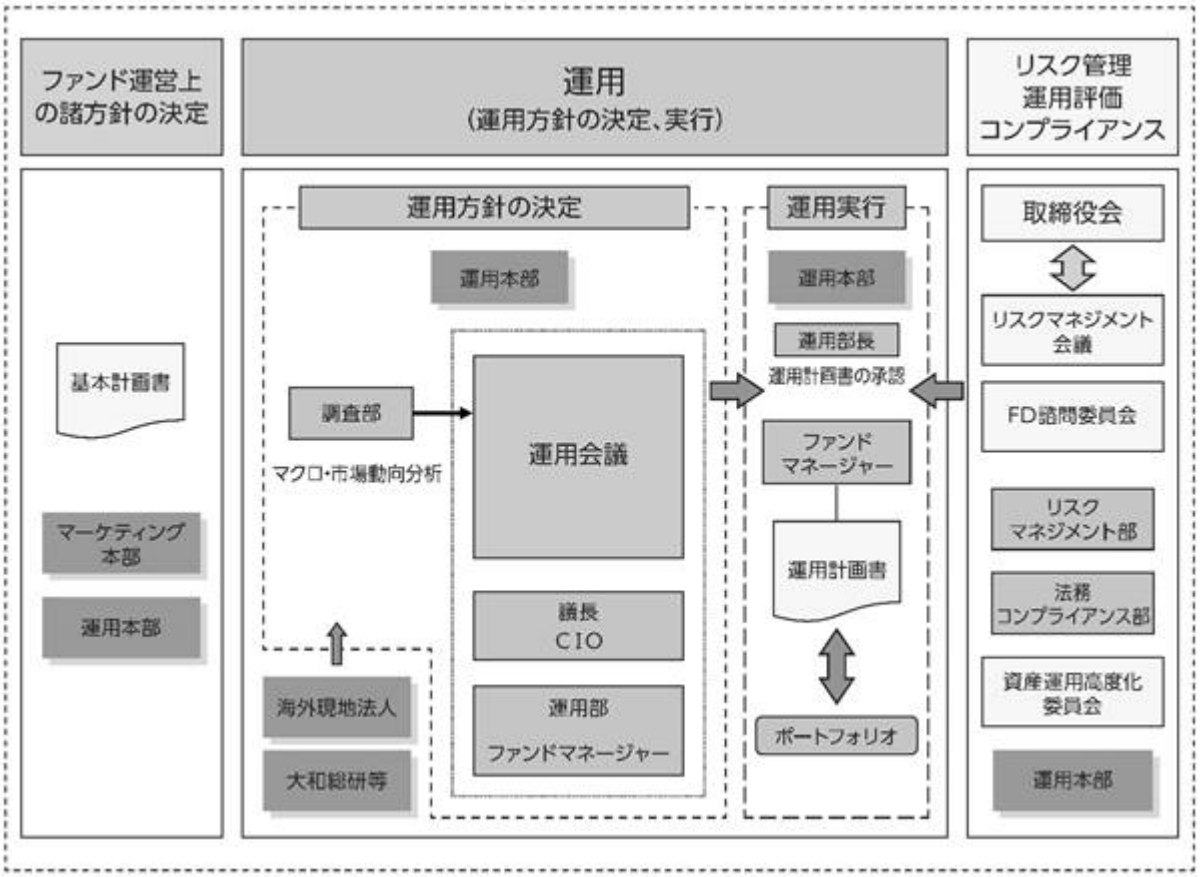
③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

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

(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、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は35～45名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．FD諮問委員会

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

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

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2022年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②　原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

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

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

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥ 信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

6．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦　先物取引等（信託約款）

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

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

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

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

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

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

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

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または解約代金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より支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

2．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に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数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．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。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

3．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。
② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

(3)その他の留意点

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

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

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

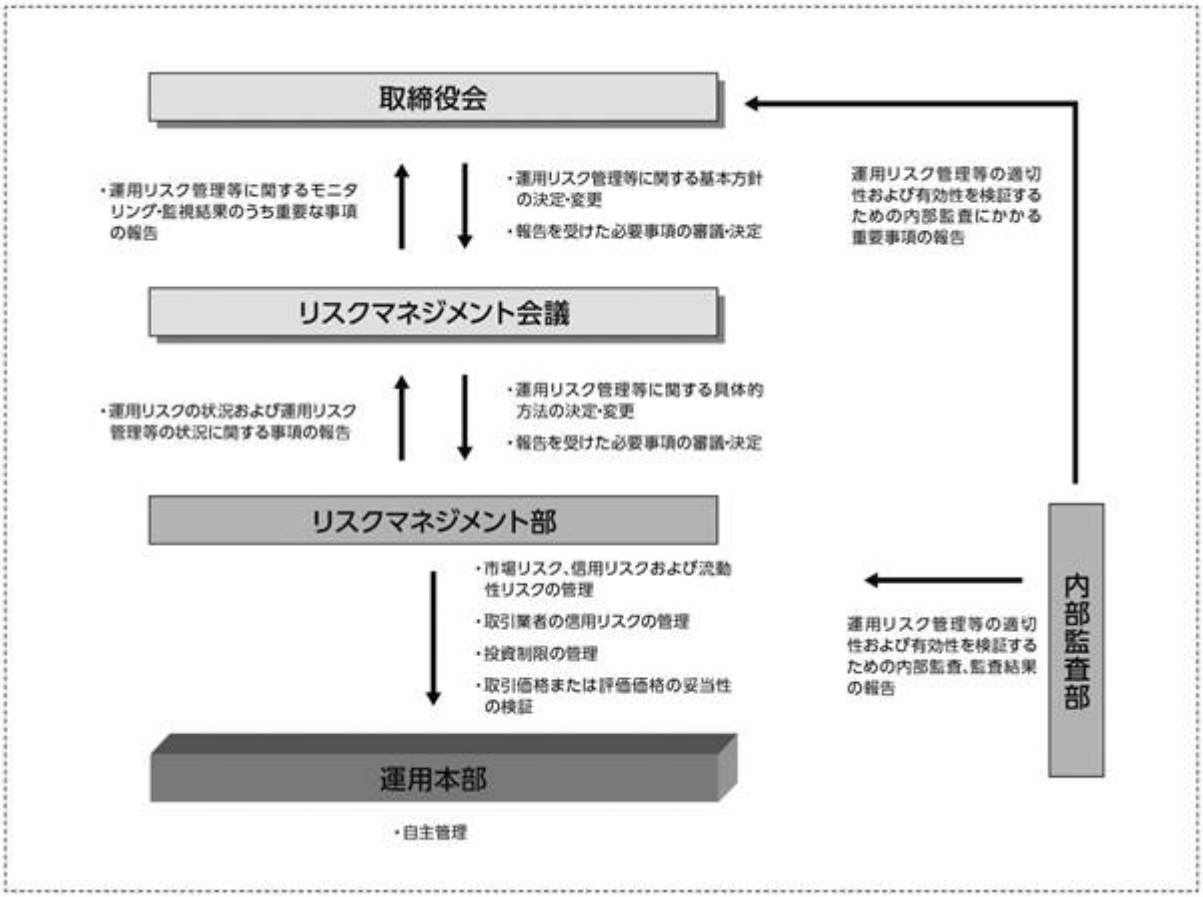
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



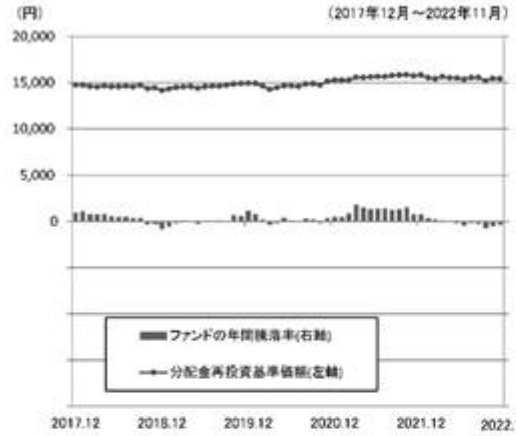
※　流動性リスクに対する管理体制

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

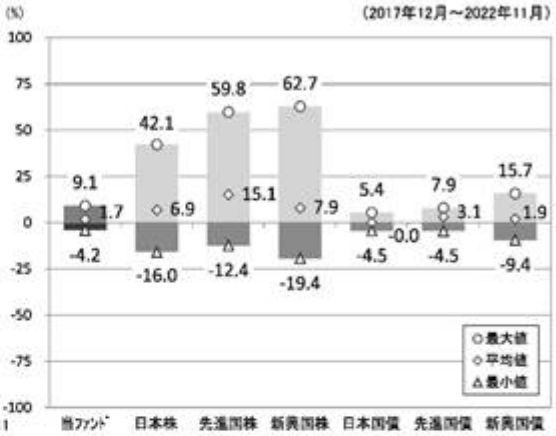
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※資産クラスについて

日 本 株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― 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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.77%（税抜0.70%）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信託財産中から支弁するものとします。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.27%（税抜）	年率0.35%（税抜）	年率0.08%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」の適用対象です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2022年11月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】(2022年11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		912,020,851	99.71
	内 日本	912,020,851	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,669,807	0.29
純資産総額		914,690,658	100.00

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

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

(2)【投資資産】(2022年11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	432,831,898	1.4190 614,229,996	1.3600 588,651,381	64.36
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	135,418,737	1.3135 177,880,488	1.3895 188,164,335	20.57
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	28,448,488	3.1373 89,253,282	3.1615 89,939,894	9.83
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	10,488,019	4.1011 43,013,312	4.3159 45,265,241	4.95

(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	99.71%
合計	99.71%

(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。

(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14計算期間末 (2013年12月2日)	638,027,220	638,027,220	1.2646	1.2646
第15計算期間末 (2014年12月1日)	744,594,681	744,594,681	1.3560	1.3560
第16計算期間末 (2015年11月30日)	875,628,369	875,628,369	1.3947	1.3947
第17計算期間末 (2016年11月30日)	915,556,581	915,556,581	1.3963	1.3963
第18計算期間末 (2017年11月30日)	973,218,082	973,218,082	1.4690	1.4690
第19計算期間末 (2018年11月30日)	971,801,470	971,801,470	1.4474	1.4474
第20計算期間末 (2019年12月2日)	1,002,408,072	1,002,408,072	1.4912	1.4912
第21計算期間末 (2020年11月30日)	1,019,086,041	1,019,086,041	1.5163	1.5163
第22計算期間末 (2021年11月30日)	1,032,177,908	1,032,177,908	1.5740	1.5740
2021年12月末日	1,046,006,752	－	1.5855	－
2022年1月末日	1,015,360,110	－	1.5537	－
2月末日	989,522,686	－	1.5430	－
3月末日	984,500,316	－	1.5659	－
4月末日	945,061,226	－	1.5519	－

5月末日	942,897,667	－	1.5507	－
6月末日	921,623,168	－	1.5359	－
7月末日	934,900,484	－	1.5570	－
8月末日	929,141,232	－	1.5563	－
9月末日	903,338,830	－	1.5225	－
10月末日	916,332,103	－	1.5469	－
第23計算期間末 (2022年11月30日)	914,690,658	914,690,658	1.5431	1.5431

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第14計算期間	17.4
第15計算期間	7.2
第16計算期間	2.9
第17計算期間	0.1
第18計算期間	5.2
第19計算期間	△1.5
第20計算期間	3.0
第21計算期間	1.7
第22計算期間	3.8
第23計算期間	△2.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第14計算期間	101,371,018	62,138,972

第15計算期間	86,587,089	41,997,530
第16計算期間	123,911,245	45,185,630
第17計算期間	91,543,767	63,659,698
第18計算期間	122,551,851	115,777,012
第19計算期間	76,475,000	67,569,021
第20計算期間	73,083,883	72,276,002
第21計算期間	84,740,001	84,860,395
第22計算期間	77,998,681	94,311,573
第23計算期間	40,328,814	103,348,624

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2022年11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	199,365,246,780	97.11
内 日本	199,365,246,780	97.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,925,487,458	2.89
純資産総額	205,290,734,238	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	5,810,800,000	2.83
内 日本	5,810,800,000	2.83

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

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

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

(2) 投資資産（2022年11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	3,820,100	2,045.84 7,815,317,504	2,010.50 7,680,311,050	3.74
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	492,200	10,331.71 5,085,270,371	11,255.00 5,539,711,000	2.70
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	69,600	51,163.44 3,560,975,492	57,140.00 3,976,944,000	1.94
4	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	894,000	3,920.17 3,504,633,319	3,820.00 3,415,080,000	1.66
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,495,600	732.92 3,294,940,986	755.10 3,394,627,560	1.65
6	第一三共	日本	株式	医薬品	607,900	4,224.99 2,568,373,615	4,518.00 2,746,492,200	1.34
7	任天堂	日本	株式	その他製品	439,200	6,179.50 2,714,037,107	5,894.00 2,588,644,800	1.26
8	日立	日本	株式	電気機器	352,800	6,721.49 2,371,342,713	7,299.00 2,575,087,200	1.25
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	617,500	3,839.93 2,371,160,027	4,050.00 2,500,875,000	1.22
10	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	403,400	5,508.63 2,222,181,990	5,952.00 2,401,036,800	1.17
11	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	501,300	4,349.70 2,180,508,030	4,673.00 2,342,574,900	1.14
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	529,500	4,399.45 2,329,510,950	4,329.00 2,292,205,500	1.12
13	KDDI	日本	株式	情報･通信業	539,100	4,369.69 2,355,704,037	4,111.00 2,216,240,100	1.08
14	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	49,100	40,994.50 2,012,830,090	45,090.00 2,213,919,000	1.08
15	三井物産	日本	株式	卸売業	538,600	3,316.73 1,786,391,553	3,983.00 2,145,243,800	1.04
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	460,200	4,366.11 2,009,284,631	4,605.00 2,119,221,000	1.03
17	HOYA	日本	株式	精密機器	150,300	14,484.34 2,176,996,556	14,060.00 2,113,218,000	1.03
18	信越化学	日本	株式	化学	119,300	15,859.31 1,892,016,470	17,570.00 2,096,101,000	1.02
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	690,300	2,633.22 1,817,714,357	2,827.00 1,951,478,100	0.95
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	453,500	3,801.04 1,723,774,996	4,287.00 1,944,154,500	0.95

21	本田技研	日本	株式	輸送用機器	565,400	3,541.56 2,002,398,024	3,356.00 1,897,482,400	0.92
22	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,900	24,072.20 2,019,658,300	22,405.00 1,879,779,500	0.92
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	992,400	1,664.42 1,651,773,972	1,717.00 1,703,950,800	0.83
24	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	1,120,800	1,502.54 1,684,048,730	1,497.50 1,678,398,000	0.82
25	村田製作所	日本	株式	電気機器	210,900	7,386.52 1,557,817,848	7,464.00 1,574,157,600	0.77
26	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	75,700	20,308.56 1,537,358,674	19,720.00 1,492,804,000	0.73
27	日本電産	日本	株式	電気機器	170,600	9,179.11 1,565,957,085	8,534.00 1,455,900,400	0.71
28	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	668,700	1,977.98 1,322,677,890	2,128.00 1,422,993,600	0.69
29	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	253,600	5,987.08 1,518,324,512	5,579.00 1,414,834,400	0.69
30	SMC	日本	株式	機械	22,800	63,079.48 1,438,212,258	61,760.00 1,408,128,000	0.69

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.11%
合計	97.11%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.31%
建設業	1.90%
食料品	3.40%
繊維製品	0.44%
パルプ・紙	0.17%
化学	5.99%
医薬品	5.60%
石油・石炭製品	0.47%

ゴム製品	0.73%
ガラス・土石製品	0.68%
鉄鋼	0.70%
非鉄金属	0.71%
金属製品	0.55%
機械	5.02%
電気機器	16.92%
輸送用機器	7.52%
精密機器	2.67%
その他製品	2.30%
電気・ガス業	1.16%
陸運業	3.09%
海運業	0.58%
空運業	0.50%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.58%
卸売業	5.78%
小売業	4.35%
銀行業	5.39%
証券、商品先物取引業	0.72%
保険業	2.29%
その他金融業	1.08%
不動産業	2.04%
サービス業	5.24%
合計	97.11%

(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　０４１２月	買建	292	5,578,261,850	5,810,800,000	2.83%

(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。

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2022年11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		104,845,798,810	92.72
	内 日本	104,845,798,810	92.72
地方債証券		2,911,753,400	2.58
	内 日本	2,911,753,400	2.58
特殊債券		2,016,980,400	1.78
	内 日本	2,016,980,400	1.78
社債券		2,780,464,900	2.46
	内 日本	2,780,464,900	2.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		521,740,967	0.46
純資産総額		113,076,738,477	100.00

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

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

(2) 投資資産（2022年11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	143 5年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	100.52 2,513,180,000	100.26 2,506,600,000	0.100000 2025/03/20	2.22
2	436 2年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	100.17 2,304,136,000	100.09 2,302,277,000	0.005000 2024/05/01	2.04
3	355 10年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	100.22 1,583,481,500	99.48 1,571,815,600	0.100000 2029/06/20	1.39
4	349 10年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	101.03 1,566,039,000	99.87 1,548,047,000	0.100000 2027/12/20	1.37

5	352 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	100.44 1,506,631,000	99.74 1,496,115,000	0.100000 2028/09/20	1.32
6	145 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	100.75 1,259,473,500	100.30 1,253,850,000	0.100000 2025/09/20	1.11
7	150 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	99.91 1,248,921,000	99.81 1,247,725,000	0.005000 2026/12/20	1.10
8	141 5年国債	日本	国債証券	1,240,000,000	100.60 1,247,517,100	100.24 1,243,013,200	0.100000 2024/09/20	1.10
9	151 5年国債	日本	国債証券	1,240,000,000	99.99 1,239,912,800	99.72 1,236,540,400	0.005000 2027/03/20	1.09
10	138 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.47 1,205,676,000	100.19 1,202,328,000	0.100000 2023/12/20	1.06
11	147 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.45 1,205,440,920	100.00 1,200,000,000	0.005000 2026/03/20	1.06
12	364 10年国債	日本	国債証券	1,210,000,000	99.97 1,209,671,800	98.32 1,189,744,600	0.100000 2031/09/20	1.05
13	144 5年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.69 1,188,249,300	100.29 1,183,457,400	0.100000 2025/06/20	1.05
14	363 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	99.72 1,196,723,300	98.41 1,180,968,000	0.100000 2031/06/20	1.04
15	359 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.53 1,186,274,720	98.88 1,166,878,400	0.100000 2030/06/20	1.03
16	140 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.56 1,126,344,000	100.22 1,122,520,000	0.100000 2024/06/20	0.99
17	365 10年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	99.01 1,118,813,500	98.41 1,112,033,000	0.100000 2031/12/20	0.98
18	347 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.69 1,107,668,000	100.04 1,100,495,000	0.100000 2027/06/20	0.97
19	361 10年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	100.47 1,075,065,960	98.62 1,055,244,700	0.100000 2030/12/20	0.93
20	148 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	100.06 1,050,670,000	99.96 1,049,622,000	0.005000 2026/06/20	0.93
21	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	100.66 1,056,943,500	99.95 1,049,496,000	0.100000 2027/09/20	0.93
22	142 5年国債	日本	国債証券	1,040,000,000	100.63 1,046,611,600	100.25 1,042,662,400	0.100000 2024/12/20	0.92
23	433 2年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.08 1,000,854,000	100.08 1,000,870,000	0.005000 2024/02/01	0.89
24	351 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.22 1,012,242,000	99.77 997,790,000	0.100000 2028/06/20	0.88

25	360 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.81 1,008,169,000	98.73 987,380,000	0.100000 2030/09/20	0.87
26	367 10年国債	日本	国債証券	960,000,000	99.85 958,592,700	99.67 956,860,800	0.200000 2032/06/20	0.85
27	139 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.52 955,023,000	100.20 951,966,500	0.100000 2024/03/20	0.84
28	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	101.00 959,505,500	100.20 951,919,000	0.100000 2026/12/20	0.84
29	149 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.38 953,628,900	99.90 949,097,500	0.005000 2026/09/20	0.84
30	357 10年国債	日本	国債証券	940,000,000	101.25 951,762,800	99.20 932,489,400	0.100000 2029/12/20	0.82

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	92.72%
地方債証券	2.58%
特殊債券	1.78%
社債券	2.46%
合計	99.54%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2022年11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		267,590,825,720	89.68
	内 香港	2,220,562,811	0.74
	内 シンガポール	1,124,742,168	0.38
	内 イスラエル	645,271,962	0.22
	内 ノルウェー	670,144,288	0.22
	内 スウェーデン	2,928,365,101	0.98
	内 デンマーク	2,356,253,979	0.79
	内 イギリス	12,424,463,706	4.16
	内 アイルランド	480,788,317	0.16
	内 オランダ	3,487,443,410	1.17
	内 ベルギー	768,034,111	0.26
	内 フランス	9,278,418,421	3.11
	内 ドイツ	6,493,252,119	2.18
	内 スイス	8,039,238,397	2.69
	内 ポルトガル	174,187,623	0.06
	内 スペイン	1,921,983,940	0.64
	内 イタリア	1,919,632,029	0.64
	内 フィンランド	794,754,208	0.27
	内 オーストリア	147,143,414	0.05
	内 カナダ	10,059,105,167	3.37
	内 アメリカ	195,902,161,071	65.66
	内 オーストラリア	5,601,355,473	1.88
	内 ニュージーランド	153,524,005	0.05
投資証券		6,560,957,275	2.20
	内 香港	122,651,952	0.04
	内 シンガポール	127,159,103	0.04
	内 イギリス	117,894,616	0.04
	内 ベルギー	22,866,298	0.01
	内 フランス	102,508,985	0.03
	内 カナダ	27,643,066	0.01
	内 アメリカ	5,498,694,638	1.84
	内 オーストラリア	541,538,617	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,221,481,393	8.12
純資産総額		298,373,264,388	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）		24,154,881,142	8.10
	内 イギリス	1,363,822,399	0.46
	内 ドイツ	4,126,420,111	1.38
	内 カナダ	1,181,750,102	0.40
	内 アメリカ	16,506,088,200	5.53
	内 オーストラリア	976,800,330	0.33
為替予約取引（買建）		16,953,866,380	5.68
	内 日本	16,953,866,380	5.68

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

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

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

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

(2) 投資資産（2022年11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	670,000	22,224.33 14,890,321,308	19,604.27 13,134,866,193	4.40
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	294,100	45,999.85 13,528,572,086	33,374.62 9,815,477,830	3.29
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	378,800	24,101.72 9,129,761,184	12,834.36 4,861,657,614	1.63
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	248,800	19,860.35 4,941,287,852	13,219.03 3,288,895,983	1.10
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	233,340	20,010.47 4,669,248,793	13,253.75 3,092,630,678	1.04
6	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	38,766	63,270.14 2,452,735,410	73,323.36 2,842,453,374	0.95

7	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	109,150	50,559.65 5,518,592,772	25,111.86 2,740,959,748	0.92
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	174,205	8,900.73 1,550,566,448	15,350.68 2,674,166,917	0.90
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	108,900	22,308.91 2,429,452,327	24,453.61 2,662,999,033	0.89
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	53,250	39,439.63 2,100,165,172	43,762.10 2,330,331,990	0.78
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	121,470	22,046.86 2,678,047,278	18,964.08 2,303,567,672	0.77
12	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	103,580	44,488.25 4,608,102,352	21,717.87 2,249,537,938	0.75
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	99,267	20,677.74 2,052,620,853	20,202.80 2,005,472,102	0.67
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	68,150	27,408.21 1,867,873,782	29,032.16 1,978,541,854	0.66
15	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	77,218	16,522.19 1,275,812,091	25,139.63 1,941,232,420	0.65
16	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	42,550	55,433.98 2,358,716,532	43,877.36 1,866,981,889	0.63
17	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	112,433	17,464.95 1,963,642,939	16,207.24 1,822,229,087	0.61
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	35,900	45,199.96 1,622,680,119	47,650.46 1,710,651,625	0.57
19	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	33,385	35,749.16 1,193,486,768	50,541.73 1,687,335,873	0.57
20	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,072	16,605.65 1,213,417,047	21,969.23 1,605,335,867	0.54
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	232,113	7,238.32 1,680,139,831	6,872.67 1,595,237,514	0.53
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	104,621	10,539.53 1,102,666,779	15,114.61 1,581,305,697	0.53
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	299,901	6,265.39 1,879,016,862	5,138.19 1,540,948,319	0.52
24	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	170,450	7,687.84 1,310,408,566	8,676.59 1,478,926,061	0.50
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	57,200	22,820.09 1,305,309,537	25,356.27 1,450,378,833	0.49

26	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	94,800	45,674.48 4,329,947,297	15,200.71 1,441,027,327	0.48
27	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	18,260	76,205.19 1,391,509,035	73,456.67 1,341,318,889	0.45
28	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	62,600	19,678.98 1,231,910,215	21,242.94 1,329,808,288	0.45
29	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	16,320	99,567.99 1,624,950,869	80,376.08 1,311,737,691	0.44
30	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	28,061	51,784.81 1,453,134,102	45,048.44 1,264,104,485	0.42

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	89.68%
投資証券	2.20%
合計	91.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.52%
素材	4.03%
資本財・サービス	8.96%
一般消費財・サービス	9.11%
生活必需品	7.21%
ヘルスケア	13.28%
金融	13.20%
情報技術	19.32%
コミュニケーション・サービス	5.84%
公益事業	2.90%
不動産	0.30%
合計	89.68%

(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 DEC 22	買建	600	16,446,802,167	16,506,088,200	5.53%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 22	買建	109	1,327,055,606	1,363,822,399	0.46%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 22	買建	58	939,903,407	976,800,330	0.33%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 22	買建	47	1,144,070,379	1,181,750,102	0.40%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 22	買建	66	1,047,541,594	1,064,967,149	0.36%
		EURO STOXX 50 DEC 22	買建	542	2,845,837,010	3,061,452,962	1.03%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2022年12月	買建	14,400,000	2,104,026,770	2,066,846,400	0.69%
		カナダ・ドル買/円売 2022年12月	買建	7,900,000	847,777,660	806,418,570	0.27%
		米ドル買/円売 2022年12月	買建	85,300,000	12,336,972,570	11,834,462,290	3.97%
		英ポンド買/円売 2022年12月	買建	4,900,000	828,018,030	813,955,170	0.27%
		豪ドル買/円売 2022年12月	買建	6,300,000	594,996,870	584,194,590	0.20%
		イスラエル・シュケル買/円売 2022年12月	買建	800,000	32,484,240	32,263,680	0.01%
		スイス・フラン買/円売 2022年12月	買建	5,600,000	829,345,070	815,725,680	0.27%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2022年11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		236,705,030,945	98.07
	内 ユーロ	81,126,760,924	33.61
	内 中国	7,534,316,737	3.12
	内 シンガポール	1,047,303,699	0.43
	内 マレーシア	1,197,267,343	0.50
	内 イスラエル	855,180,021	0.35
	内 ノルウェー	485,804,163	0.20
	内 スウェーデン	612,648,139	0.25
	内 デンマーク	871,107,851	0.36
	内 イギリス	11,154,519,094	4.62
	内 ポーランド	981,527,558	0.41
	内 カナダ	4,759,828,807	1.97
	内 アメリカ	120,068,309,446	49.75
	内 メキシコ	1,972,998,607	0.82
	内 オーストラリア	3,580,216,305	1.48
	内 ニュージーランド	457,242,251	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,647,287,639	1.93
純資産総額		241,352,318,584	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		2,127,572,068	0.88
	内 日本	2,127,572,068	0.88

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

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

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

(2) 投資資産（2022年11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	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	92.58 1,337,098,117	85.43 1,233,864,393	1.875000 2032/02/15	0.51

2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	96.91 1,439,994,411	82.21 1,221,625,225	1.125000 2031/02/15	0.51
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	100.49 1,297,918,585	92.98 1,200,879,991	2.875000 2032/05/15	0.50
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	97.64 1,396,725,436	81.65 1,167,975,578	1.250000 2031/08/15	0.48
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	94.91 1,291,750,131	80.69 1,098,253,672	0.875000 2030/11/15	0.46
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	98.51 1,231,228,003	82.05 1,025,535,508	1.375000 2031/11/15	0.42
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.16 1,222,183,760	84.81 1,024,672,292	1.625000 2031/05/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	102.16 1,096,553,009	91.87 986,150,673	1.625000 2026/05/15	0.41
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	98.95 1,030,661,894	92.85 967,149,699	0.375000 2024/09/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.40 962,466,886	91.84 956,567,805	2.750000 2032/08/15	0.40
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	93.01 1,033,315,005	79.30 880,991,280	0.625000 2030/08/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	109.49 1,018,745,320	94.46 878,883,233	2.875000 2028/08/15	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,086,000	106.76 932,980,628	100.09 874,684,231	2.250000 2024/05/25	0.36
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	117.32 993,694,882	102.76 870,422,782	2.750000 2027/10/25	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	95.26 926,098,511	89.29 868,037,486	1.125000 2026/10/31	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	109.25 986,150,587	94.65 854,381,010	2.875000 2028/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	108.20 991,725,940	92.84 850,945,089	2.625000 2029/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	108.34 955,395,118	94.24 831,049,045	2.750000 2028/02/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	105.91 941,329,739	93.27 828,980,576	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.50 938,066,850	85.09 827,199,985	0.750000 2028/01/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	104.36 893,051,870	96.29 823,986,955	2.375000 2024/08/15	0.34

22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	97.44 879,556,058	90.33 815,413,394	0.250000 2025/06/30	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	100.21 904,617,864	90.21 814,357,287	1.500000 2027/01/31	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	104.19 856,775,516	95.78 787,624,353	2.250000 2024/11/15	0.33
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	94.75 789,549,756	93.37 777,985,846	2.750000 2029/05/31	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	104.66 848,850,207	94.50 766,395,756	2.250000 2025/11/15	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	104.00 835,987,006	94.82 762,175,929	2.125000 2025/05/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	105.28 862,667,522	92.58 758,579,458	2.250000 2027/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	103.53 825,755,011	94.92 757,087,642	2.000000 2025/02/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,800,000	93.24 880,499,124	79.72 752,827,601	0.625000 2030/05/15	0.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.07%
合計	98.07%

(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	豪ドル買/円売 2022年12月	買建	959,000	90,011,493	88,942,453	0.04%

		英ポンド買/円売 2022年12月	買建	1,078,000	179,447,652	179,112,796	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2022年12月	買建	4,386,000	32,514,295	31,607,270	0.01%
		ユーロ買/円売 2022年12月	買建	4,108,000	592,268,599	589,735,514	0.24%
		米ドル買/円売 2022年12月	買建	6,729,000	941,267,656	934,036,875	0.39%
		カナダ・ドル買/円売 2022年12月	買建	1,656,000	176,541,309	169,074,798	0.07%
		オフショア人民元買/円売 2022年12月	買建	4,379,000	88,623,078	84,987,194	0.04%
		シンガポール・ドル買/円売 2022年12月	買建	496,000	51,909,276	50,075,168	0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

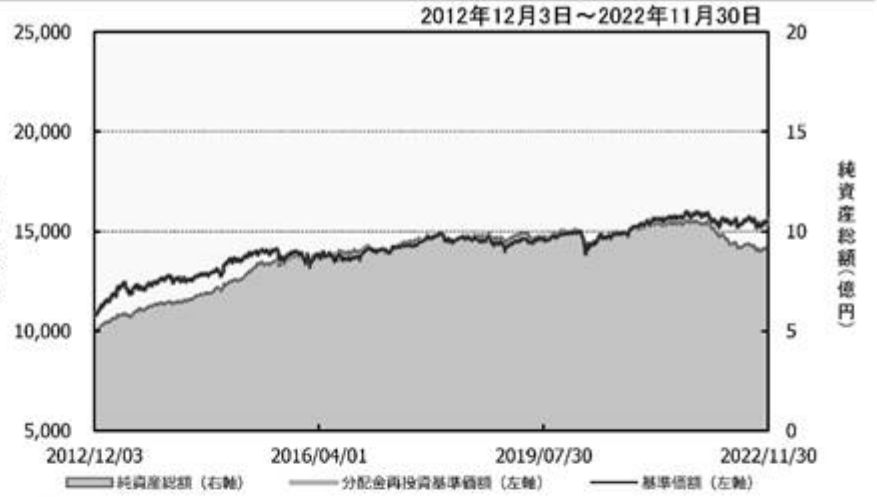
（参考情報）運用実績

●ダイワライフスタイル25

2022年11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	15,431円
純資産総額	9.1億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.2%
3カ月間	-0.8%
6カ月間	-0.5%
1年間	-2.0%
3年間	3.5%
5年間	5.0%
設定来	54.3%

※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12期 11年11月	第13期 12年11月	第14期 13年12月	第15期 14年12月	第16期 15年11月	第17期 16年11月	第18期 17年11月	第19期 18年11月	第20期 19年12月	第21期 20年11月	第22期 21年11月	第23期 22年11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	336	64.1%
国内株式・先物	2,153	20.6%
外国債券	920	9.6%
外国株式・先物	1,215	4.8%
外国リート	59	0.1%
外国投資証券	5	0.0%
コール・ローン、その他		1.8%
合計	4,688	-

通貨別構成	比率
日本円	85.2%
米ドル	8.6%
ユーロ	3.8%
英ポンド	0.7%
カナダ・ドル	0.4%
オフショア人民元	0.3%
豪ドル	0.3%
スイス・フラン	0.2%
メキシコ・ペソ	0.1%
その他	0.4%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	0.9
最終利回り(%)	0.8
修正デュレーション	8.7
残存年数	9.6

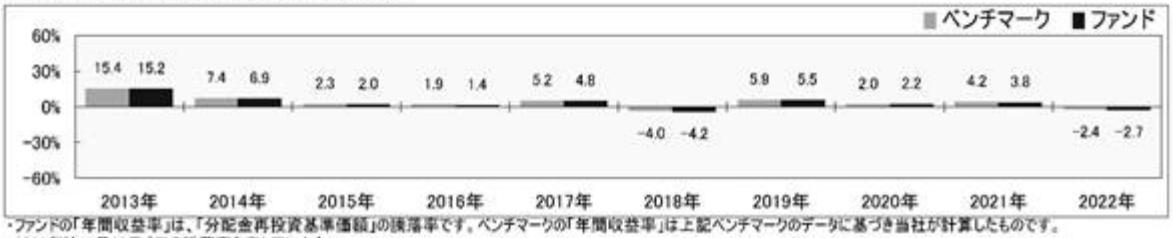
債券格付別構成	比率
AAA	92.4%
AA	3.9%
A	2.6%
BBB	-
BB以下・無格付	1.1%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	0.8%
TOPIX先物 0412月	日本	0.6%
ソニーグループ	日本	0.6%
キーエンス	日本	0.4%
日本電信電話	日本	0.3%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
第一三共	日本	0.3%
S&P500 EMINI DEC 22	アメリカ	0.3%
任天堂	日本	0.3%
日立	日本	0.3%
合計		4.1%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.1%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2022年は11月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

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

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託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、上記に準じて計算される価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

・外国の株式：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3.価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30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、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

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

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2021年12月1日から2022年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワライフスタイル２５

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2021年11月30日現在	第23期 2022年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,509,815	7,025,615
親投資信託受益証券	1,029,155,730	912,020,851
未収入金	173,000	－
流動資産合計	1,036,838,545	919,046,466
資産合計	1,036,838,545	919,046,466
負債の部		
流動負債		
未払解約金	587,795	759,601
未払受託者報酬	460,509	406,615
未払委託者報酬	3,569,247	3,151,561
その他未払費用	43,086	38,031
流動負債合計	4,660,637	4,355,808
負債合計	4,660,637	4,355,808
純資産の部		
元本等		
元本	※1 655,764,843	※1 592,745,033
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	376,413,065	321,945,625
（分配準備積立金）	158,244,099	134,066,042
元本等合計	1,032,177,908	914,690,658
純資産合計	1,032,177,908	914,690,658
負債純資産合計	1,036,838,545	919,046,466

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日	第23期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30日
営業収益		
有価証券売買等損益	46,439,289	△ 12,470,879
営業収益合計	46,439,289	△ 12,470,879
営業費用		
支払利息	1,181	1,099
受託者報酬	911,192	842,455
委託者報酬	7,062,345	6,529,572
その他費用	85,244	78,808
営業費用合計	8,059,962	7,451,934
営業利益又は営業損失（△）	38,379,327	△ 19,922,813
経常利益又は経常損失（△）	38,379,327	△ 19,922,813
当期純利益又は当期純損失（△）	38,379,327	△ 19,922,813
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（△）	3,994,095	△ 2,396,648
期首剰余金又は期首欠損金（△）	347,008,306	376,413,065
剰余金増加額又は欠損金減少額	43,903,753	22,346,625
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	43,903,753	22,346,625
剰余金減少額又は欠損金増加額	48,884,226	59,287,900
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	48,884,226	59,287,900
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	376,413,065	321,945,625

(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23期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30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22期 2021年11月30日現在	第23期 2022年11月30日現在
1.　※1　期首元本額	672,077,735円	655,764,843円
期中追加設定元本額	77,998,681円	40,328,814円
期中一部解約元本額	94,311,573円	103,348,624円
2.　計算期間末日における受益権の総数	655,764,843口	592,745,033口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第22期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日	第23期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30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（34,384,945円）、投資信託約款に規定される収益調整金（241,186,519円）及び分配準備積立金（123,859,154円）より分配対象額は399,430,618円（1万口当たり6,091.06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（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（226,978,535円）及び分配準備積立金（134,066,042円）より分配対象額は361,044,577円（1万口当たり6,091.06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23期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
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23期 2022年11月30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22期 2021年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第23期 2022年11月30日現在 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	37,917,996	△12,356,227
合計	37,917,996	△12,356,227

（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22期 2021年11月30日現在	第23期 2022年11月30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23期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30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22期 2021年11月30日現在	第23期 2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.5740円	1.5431円

（1万口当たり純資産額）	(15,740円)	(15,431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	135,418,737	188,164,335	
	日本債券インデックスマザーファンド	432,831,898	588,651,381	
	外国株式インデックスマザーファンド	10,488,019	45,265,241	
	外国債券インデックスマザーファンド	28,448,488	89,939,894	
親投資信託受益証券　合計			912,020,851	
合計			912,020,851	

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在

		金　額（円）	金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		8,845,838,998	12,597,232,619
株式	※2※3	177,548,758,040	199,365,246,780
派生商品評価勘定		－	252,089,300
未収入金		－	22,308,117
未収配当金		1,233,193,430	1,574,706,818
未収利息		551,974	656,842
前払金		211,095,600	－
その他未収収益	※4	21,961,225	15,277,058
差入委託証拠金		18,795,000	13,280,000
流動資産合計		187,880,194,267	213,840,797,534
資産合計		187,880,194,267	213,840,797,534
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		355,476,200	1,899,900
前受金		－	257,225,000
未払解約金		44,822,370	298,031,030
受入担保金		4,816,603,995	7,992,907,366
流動負債合計		5,216,902,565	8,550,063,296
負債合計		5,216,902,565	8,550,063,296
純資産の部			
元本等			
元本	※1	139,094,932,448	147,745,976,638
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		43,568,359,254	57,544,757,600
元本等合計		182,663,291,702	205,290,734,238
純資産合計		182,663,291,702	205,290,734,238
負債純資産合計		187,880,194,267	213,840,797,534

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年12月1日 至　2022年11月30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、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1．※1　期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	142,709,508,970円	139,094,932,448円
期中追加設定元本額	20,968,397,493円	22,455,105,001円
期中一部解約元本額	24,582,974,015円	13,804,060,811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	2,975,507,036円	2,868,987,712円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	5,686,561,941円	4,779,931,786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	924,307円	917,791円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	24,862,174円	22,001,280円

ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	418,851,032円	283,754,331円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	21,795,176円	20,586,631円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	711,622,184円	571,049,427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）	242,143,159円	461,873,574円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	48,516,772円	29,463,339円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	150,899,876円	216,770,163円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	4,912,109,453円	6,249,961,543円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,289,496,110円	4,259,741,459円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	524,441,173円	788,377,659円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	66,361,817,159円	69,173,293,158円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,933,677,304円	3,306,033,755円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,117,458,139円	4,756,270,267円
ダイワ・ライフ・バランス７０	4,042,208,265円	4,672,940,801円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,020,854,667円	6,732,752,455円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	53,651,007円	57,574,140円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	58,568,334円	70,614,624円
ダイワつみたてインデックス日本株式	1,539,852,892円	2,701,356,905円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	10,210,048円	11,751,428円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	9,943,370円	10,416,225円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	19,590,190円	26,427,874円

	ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	721,071円	1,913,542,032円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	108,723,511円	79,912,966円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	125,845,796円	34,293,201円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,927,962,438円	5,068,797,182円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	524,674,963円	454,578,946円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	75,481,125円	62,260,889円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	141,439,467円	104,389,988円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	200,182,570円	200,763,198円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	10,416,484,453円	11,679,378,364円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,750,254,771円	1,850,371,567円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,681,477,325円	3,206,509,611円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,175,509,780円	1,201,006,985円
	ダイワライフスタイル２５	150,358,577円	135,418,737円
	ダイワライフスタイル５０	597,518,476円	552,924,023円
	ダイワライフスタイル７５	479,645,847円	422,585,053円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	10,563,090,510円	8,706,395,569円
計		139,094,932,448円	147,745,976,638円
2.	期末日における受益権の総数	139,094,932,448口	147,745,976,638口
3. ※2	貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 4,435,964,100円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,569,896,520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　952,550,000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。 株式　902,690,000円
5．※4　その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分21,209,315円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分14,368,166円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　2021年12月1日 至　2022年11月30日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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	2022年11月30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	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2022年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△12,356,661,736	4,104,712,548
合計	△12,356,661,736	4,104,712,548

（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（2021年9月22日から2021年11月30日まで、及び2022年9月21日から2022年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2021年11月30日 現在				2022年11月30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								
株価指数先物取引								
買　建	5,891,635,600	－	5,536,320,000	△355,315,600	5,560,450,000	－	5,810,800,000	250,350,000
合計	5,891,635,600	－	5,536,320,000	△355,315,600	5,560,450,000	－	5,810,800,000	250,350,000

（注）1．時価の算定方法

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3132円 (13,132円)	1.3895円 (13,895円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考	
		単　価	金　額		
極　洋	3,800	3,695.00	14,041,000		
日本水産	97,600	522.00	50,947,200		
マルハニチロ	15,100	2,456.00	37,085,600		
雪国まいたけ	8,300	1,001.00	8,308,300		
カネコ種苗	3,300	1,429.00	4,715,700		
サカタのタネ	12,300	4,690.00	57,687,000	貸付株式数	4,400株
ホクト	8,700	1,890.00	16,443,000		
ホクリヨウ	1,300	680.00	884,000	貸付株式数	400株
ショーボンドＨＤ	13,400	6,060.00	81,204,000		
ミライト・ワン	34,000	1,514.00	51,476,000		
タマホーム	6,900	2,479.00	17,105,100	貸付株式数	2,500株
サンヨーホームズ	1,200	704.00	844,800	貸付株式数	400株
日本アクア	4,100	880.00	3,608,000	貸付株式数	1,500株
ファーストコーポレーション	2,300	715.00	1,644,500	貸付株式数	1,000株
ベステラ	2,100	991.00	2,081,100	貸付株式数	800株
キャンディル	2,100	499.00	1,047,900	貸付株式数	700株
住石ホールディングス	15,200	254.00	3,860,800	貸付株式数	7,100株
日鉄鉱業	3,800	3,145.00	11,951,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	4,400	3,225.00	14,190,000	貸付株式数	1,700株
ＩＮＰＥＸ	360,700	1,533.00	552,953,100	貸付株式数	146,700株
石油資源開発	11,300	4,335.00	48,985,500		

K＆Oエナジーグループ	4,400	2,427.00	10,678,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,900	825.00	1,567,500	貸付株式数	700株
第一カッター興業	2,500	1,161.00	2,902,500		
明豊ファシリティワークス	3,500	716.00	2,506,000	貸付株式数	1,200株
安藤・間	56,700	874.00	49,555,800		
東急建設	27,900	656.00	18,302,400		
コムシスホールディングス	33,000	2,467.00	81,411,000		
ビーアールホールディングス	16,100	337.00	5,425,700	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクショングループ	6,400	1,960.00	12,544,000		
東建コーポレーション	3,100	7,950.00	24,645,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,100	964.00	1,060,400	貸付株式数	400株 (100株)
ヤマウラ	4,700	1,004.00	4,718,800	貸付株式数	700株
オリエンタル白石	34,900	278.00	9,702,200		
大成建設	67,900	4,165.00	282,803,500		
大　林　組	244,000	1,024.00	249,856,000		
清水建設	205,100	738.00	151,363,800		
飛島建設	8,100	1,022.00	8,278,200		
長谷工コーポレーシヨン	70,400	1,517.00	106,796,800		
松井建設	6,400	562.00	3,596,800	貸付株式数	400株
錢　高　組	900	2,686.00	2,417,400	貸付株式数	300株
鹿島建設	151,300	1,550.00	234,515,000		
不動テトラ	5,100	1,524.00	7,772,400		
大末建設	2,500	1,196.00	2,990,000	貸付株式数	900株
鉄建建設	5,300	1,819.00	9,640,700		
西松建設	11,600	3,915.00	45,414,000	貸付株式数	5,800株
三井住友建設	55,500	422.00	23,421,000	貸付株式数	400株
大豊建設	2,900	4,440.00	12,876,000		
佐田建設	4,600	452.00	2,079,200	貸付株式数	1,300株
ナカノフドー建設	4,800	321.00	1,540,800	貸付株式数	1,500株
奥　村　組	11,100	2,936.00	32,589,600		
東鉄工業	9,500	2,552.00	24,244,000		
イチケン	1,600	1,801.00	2,881,600		
富士ピー・エス	3,500	433.00	1,515,500	貸付株式数	1,300株 (200株)
淺沼組	5,500	2,920.00	16,060,000	貸付株式数	200株
戸田建設	83,900	732.00	61,414,800		

熊　谷　組	11,900	2,539.00	30,214,100		
北野建設	1,300	2,446.00	3,179,800	貸付株式数	100株
植　木　組	2,100	1,299.00	2,727,900	貸付株式数	700株
矢作建設	9,300	739.00	6,872,700		
ピーエス三菱	9,400	603.00	5,668,200		
日本ハウスＨＬＤＧＳ	13,500	437.00	5,899,500	貸付株式数	100株
大東建託	25,100	15,320.00	384,532,000		
新日本建設	9,500	748.00	7,106,000		
東亜道路	1,400	6,100.00	8,540,000		
日本道路	1,400	6,210.00	8,694,000		
東亜建設	5,900	2,354.00	13,888,600		
日本国土開発	20,600	572.00	11,783,200		
若築建設	3,100	2,733.00	8,472,300		
東洋建設	22,300	837.00	18,665,100		
五洋建設	97,200	647.00	62,888,400	貸付株式数	700株
世紀東急	9,500	798.00	7,581,000		
福　田　組	2,600	4,865.00	12,649,000	貸付株式数	1,000株
日本ドライケミカル	1,500	1,550.00	2,325,000	貸付株式数	600株
住友林業	52,400	2,371.00	124,240,400		
日本基礎技術	4,400	537.00	2,362,800		
巴コーポレーション	7,900	382.00	3,017,800	貸付株式数	300株
大和ハウス	190,600	3,159.00	602,105,400		
ライト工業	13,200	2,068.00	27,297,600		
積水ハウス	213,700	2,567.00	548,567,900		
日特建設	7,100	911.00	6,468,100		
北陸電気工事	5,100	690.00	3,519,000		
ユアテック	15,900	719.00	11,432,100		
日本リーテック	4,700	734.00	3,449,800		
四電工	3,000	1,774.00	5,322,000		
中電工	11,100	2,085.00	23,143,500		
関　電　工	38,300	868.00	33,244,400		
きんでん	48,700	1,471.00	71,637,700		
東京エネシス	6,700	941.00	6,304,700		
トーエネック	2,400	3,420.00	8,208,000	貸付株式数	100株
住友電設	6,700	2,540.00	17,018,000		
日本電設工業	11,500	1,695.00	19,492,500		
エクシオグループ	33,600	2,127.00	71,467,200		
新日本空調	3,800	1,918.00	7,288,400	貸付株式数	1,300株
日本工営	5,100	3,525.00	17,977,500		
九電工	16,800	3,290.00	55,272,000		

三機工業	15,500	1,598.00	24,769,000		
日揮ホールディングス	67,400	1,893.00	127,588,200		
中外炉工業	2,100	1,597.00	3,353,700		
ヤマト	5,900	690.00	4,071,000		
太平電業	4,200	3,145.00	13,209,000		
高砂熱学	16,700	1,794.00	29,959,800		
三晃金属	1,000	3,000.00	3,000,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	23,300	1,642.00	38,258,600		
朝日工業社	2,900	2,132.00	6,182,800		
明星工業	12,300	724.00	8,905,200		
大　氣　社	8,400	3,535.00	29,694,000		
ダイダン	4,800	2,200.00	10,560,000		
日比谷総合設備	6,000	1,895.00	11,370,000		
ニップン	18,500	1,587.00	29,359,500		
日清製粉Ｇ本社	63,300	1,615.00	102,229,500		
日東富士製粉	1,200	4,475.00	5,370,000		
昭和産業	6,000	2,448.00	14,688,000		
鳥越製粉	5,600	620.00	3,472,000	貸付株式数	1,900株
中部飼料	9,500	1,039.00	9,870,500	貸付株式数	3,100株
フィード・ワン	10,100	669.00	6,756,900		
東洋精糖	1,300	898.00	1,167,400	貸付株式数	400株
日本甜菜糖	4,100	1,627.00	6,670,700		
ＤＭ三井製糖ホールディ	6,800	1,956.00	13,300,800	貸付株式数	100株
塩水港精糖	8,500	196.00	1,666,000	貸付株式数	2,800株
日新製糖	3,500	1,683.00	5,890,500		
ＬＩＦＵＬＬ	24,700	249.00	6,150,300		
ＭＩＸＩ	16,300	2,464.00	40,163,200	貸付株式数	100株
ジェイエイシーリクルートメント	6,500	2,587.00	16,815,500		
日本M&Aセンターホールデ	122,600	1,840.00	225,584,000		
メンバーズ	2,100	2,266.00	4,758,600	貸付株式数	800株
中広	1,100	394.00	433,400	貸付株式数	400株
ＵＴグループ	10,500	2,695.00	28,297,500		
アイティメディア	2,700	1,862.00	5,027,400	貸付株式数	1,300株
Ｅ・Ｊホールディングス	4,600	1,305.00	6,003,000	貸付株式数	1,800株
夢真ビーネックスグループ	26,100	1,922.00	50,164,200		
コシダカホールディングス	21,400	1,147.00	24,545,800	貸付株式数	8,500株
アルトナー	1,700	1,052.00	1,788,400		
パソナグループ	8,700	2,058.00	17,904,600		

ＣＤＳ	1,800	1,839.00	3,310,200		
リンクアンドモチベーション	20,600	711.00	14,646,600	貸付株式数	8,200株
エス・エム・エス	27,200	3,610.00	98,192,000		
サニーサイドアップＧ	2,500	625.00	1,562,500	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	80,100	3,150.00	252,315,000		
リニカル	4,000	728.00	2,912,000	貸付株式数	1,600株
クックパッド	19,600	212.00	4,155,200	貸付株式数	7,300株
エスクリ	2,900	342.00	991,800	貸付株式数	1,300株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	3,400	635.00	2,159,000	貸付株式数	1,400株
森永製菓	14,100	3,695.00	52,099,500		
中　村　屋	1,700	3,110.00	5,287,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	19,600	3,585.00	70,266,000		
名糖産業	2,700	1,610.00	4,347,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,800	2,231.00	8,477,800		
不　二　家	4,700	2,633.00	12,375,100	貸付株式数	1,800株
山崎製パン	45,800	1,581.00	72,409,800		
第一屋製パン	1,300	404.00	525,200	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,200	3,590.00	7,898,000		
亀田製菓	4,400	4,355.00	19,162,000	貸付株式数	1,600株
寿スピリッツ	7,300	7,770.00	56,721,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,400	2,904.00	91,185,600		
森永乳業	12,400	4,445.00	55,118,000		
六甲バター	5,000	1,395.00	6,975,000	貸付株式数	1,000株
ヤクルト	49,000	8,750.00	428,750,000		
明治ホールディングス	42,400	6,600.00	279,840,000		
雪印メグミルク	16,600	1,729.00	28,701,400		
プリマハム	9,200	2,041.00	18,777,200		
日本ハム	26,800	3,700.00	99,160,000		
林兼産業	2,200	477.00	1,049,400		
丸大食品	6,900	1,425.00	9,832,500	貸付株式数	2,700株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7,600	2,913.00	22,138,800	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,700	2,171.00	5,861,700	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	53,300	684.00	36,457,200		
学情	3,200	1,498.00	4,793,600	貸付株式数	1,100株
スタジオアリス	3,500	2,087.00	7,304,500	貸付株式数	1,400株 (100株)
クロスキャット	4,000	1,599.00	6,396,000	貸付株式数	1,500株
シミックホールディングス	3,900	1,737.00	6,774,300	貸付株式数	1,500株

エプコ	1,400	739.00	1,034,600	貸付株式数	600株
システナ	117,200	420.00	49,224,000		
ＮＪＳ	1,600	2,070.00	3,312,000		
デジタルアーツ	4,400	6,450.00	28,380,000		
日鉄ソリューションズ	11,900	3,435.00	40,876,500		
綜合警備保障	26,500	3,725.00	98,712,500		
キューブシステム	4,100	1,017.00	4,169,700	貸付株式数	1,500株 (200株)
いちご	79,300	309.00	24,503,700		
日本駐車場開発	81,600	246.00	20,073,600	貸付株式数	29,400株
コア	3,000	1,470.00	4,410,000	貸付株式数	600株
カカクコム	53,400	2,428.00	129,655,200		
アイロムグループ	2,600	2,218.00	5,766,800		
セントケア・ホールディング	4,500	854.00	3,843,000		
サイネックス	1,600	557.00	891,200	貸付株式数	400株
ルネサンス	5,000	901.00	4,505,000	貸付株式数	1,900株
ディップ	12,500	4,095.00	51,187,500	貸付株式数	4,000株
ＳＢＳホールディングス	6,200	2,965.00	18,383,000	貸付株式数	2,300株
デジタルホールディングス	5,600	1,187.00	6,647,200	貸付株式数	1,800株
新日本科学	7,600	2,763.00	20,998,800	貸付株式数	3,100株
キャリアデザインセンター	1,500	1,607.00	2,410,500		
ベネフィット・ワン	33,100	2,160.00	71,496,000	貸付株式数	6,100株
エムスリー	141,300	4,205.00	594,166,500		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,500	395.00	1,777,500	貸付株式数	600株
ブラス	1,000	953.00	953,000	貸付株式数	300株
アウトソーシング	42,600	1,008.00	42,940,800		
ウェルネット	6,300	642.00	4,044,600	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	3,200	2,905.00	9,296,000	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	30,500	1,850.00	56,425,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	91,200	1,331.00	121,387,200		
ぐるなび	13,100	419.00	5,488,900	貸付株式数	100株
タカミヤ	9,700	385.00	3,734,500		
ジャパンベストレスキューＳ	4,500	872.00	3,924,000		
ファンコミュニケーションズ	14,000	441.00	6,174,000	貸付株式数	1,500株
ライク	2,700	2,082.00	5,621,400		
ビジネス・ブレークスルー	2,500	392.00	980,000	貸付株式数	1,000株

エスプール	20,600	939.00	19,343,400		
ＷＤＢホールディングス	3,600	2,377.00	8,557,200		
手間いらず	1,200	5,150.00	6,180,000		
ティア	4,000	423.00	1,692,000	貸付株式数	300株
ＣＤＧ	700	1,181.00	826,700	貸付株式数	200株
アドウェイズ	9,800	547.00	5,360,600	貸付株式数	4,300株
バリューコマース	5,400	2,091.00	11,291,400		
インフォマート	74,200	454.00	33,686,800		
サッポロホールディングス	22,600	3,590.00	81,134,000		
アサヒグループホールディン	158,300	4,398.00	696,203,400	貸付株式数	63,600株
キリンＨＤ	309,200	2,165.00	669,418,000		
宝ホールディングス	46,800	1,068.00	49,982,400		
オエノンホールディングス	20,600	282.00	5,809,200	貸付株式数	5,800株
養　命　酒	2,300	1,790.00	4,117,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	53,700	1,460.00	78,402,000		
サントリー食品インター	48,200	4,665.00	224,853,000		
ダイドーグループＨＤ	3,900	4,850.00	18,915,000	貸付株式数	1,500株
伊　藤　園	25,500	5,270.00	134,385,000		
キーコーヒー	7,700	2,070.00	15,939,000		
ユニカフェ	2,300	990.00	2,277,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	1,000	1,082.00	1,082,000	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	9,700	3,335.00	32,349,500		
不二製油グループ	16,000	2,113.00	33,808,000	貸付株式数	100株
かどや製油	800	3,500.00	2,800,000	貸付株式数	100株
Ｊ－オイルミルズ	7,100	1,514.00	10,749,400		
ローソン	18,100	4,925.00	89,142,500		
サンエー	5,400	4,360.00	23,544,000		
カワチ薬品	5,400	2,111.00	11,399,400	貸付株式数	300株
エービーシー・マート	10,700	6,970.00	74,579,000		
ハードオフコーポレーション	3,000	1,424.00	4,272,000		
高千穂交易	2,600	2,190.00	5,694,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	17,800	1,581.00	28,141,800	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	7,800	1,961.00	15,295,800		
アダストリア	8,900	2,007.00	17,862,300	貸付株式数	3,600株
ジーフット	3,500	294.00	1,029,000	貸付株式数	1,800株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	402.00	402,000	貸付株式数	300株

オルバヘルスケアＨＬＤＧＳ	1,500	1,575.00	2,362,500	貸付株式数	300株
伊藤忠食品	1,700	5,190.00	8,823,000		
くら寿司	8,600	3,350.00	28,810,000	貸付株式数	3,400株
キャンドゥ	2,600	2,153.00	5,597,800	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,400	1,536.00	9,830,400		
アイケイ	2,300	425.00	977,500	貸付株式数	800株
パルグループＨＬＤＧＳ	7,200	2,421.00	17,431,200		
エディオン	29,200	1,254.00	36,616,800	貸付株式数	14,000株 (300株)
あらた	5,600	4,025.00	22,540,000	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	15,500	750.00	11,625,000	貸付株式数	6,200株
ワッツ	3,000	692.00	2,076,000	貸付株式数	1,400株
トーメンデバイス	1,100	5,570.00	6,127,000		
ハローズ	3,200	2,994.00	9,580,800	貸付株式数	1,300株
ＪＰホールディングス	20,500	278.00	5,699,000	貸付株式数	1,200株
フジオフードＧ本社	6,200	1,388.00	8,605,600	貸付株式数	2,400株 (100株)
あみやき亭	1,800	2,900.00	5,220,000	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,700	6,870.00	18,549,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,900	186.00	2,957,400	貸付株式数	5,000株
円谷フィールズホールディ	6,300	2,372.00	14,943,600	貸付株式数	2,500株
双日	78,200	2,438.00	190,651,600		
アルフレッサホールディングス	74,000	1,666.00	123,284,000		
大黒天物産	2,600	5,280.00	13,728,000	貸付株式数	400株 (100株)
ハニーズホールディングス	6,500	1,228.00	7,982,000	貸付株式数	2,100株
ファーマライズＨＤ	1,500	676.00	1,014,000	貸付株式数	500株
キッコーマン	45,400	7,720.00	350,488,000		
味　の　素	167,600	4,335.00	726,546,000		
ブルドックソース	2,700	1,720.00	4,644,000	貸付株式数	1,100株
キユーピー	36,800	2,447.00	90,049,600		
ハウス食品Ｇ本社	21,000	2,714.00	56,994,000		
カ　ゴ　メ	31,900	3,050.00	97,295,000	貸付株式数	12,000株
焼津水産化工	3,000	832.00	2,496,000	貸付株式数	1,000株
アリアケジャパン	6,000	4,605.00	27,630,000		
ピエトロ	1,000	1,807.00	1,807,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,800	3,195.00	5,751,000	貸付株式数	500株
やまみ	600	1,303.00	781,800		

ニチレイ	31,400	2,781.00	87,323,400		
横浜冷凍	20,100	995.00	19,999,500	貸付株式数	200株
東洋水産	34,600	5,770.00	199,642,000		
イートアンドＨＬＤＧＳ	2,900	2,232.00	6,472,800	貸付株式数	1,100株
大冷	900	1,899.00	1,709,100	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	4,400	529.00	2,327,600	貸付株式数	1,600株
日清食品ＨＤ	24,400	10,480.00	255,712,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,003.00	6,810,200		
一正蒲鉾	2,800	742.00	2,077,600	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,000	1,895.00	13,265,000		
ロックフィールド	8,300	1,476.00	12,250,800	貸付株式数	3,200株
日本たばこ産業	450,900	2,815.50	1,269,508,950	貸付株式数	144,800株
ケンコーマヨネーズ	4,700	1,651.00	7,759,700	貸付株式数	1,600株
わらべや日洋ＨＤ	5,000	1,848.00	9,240,000		
なとり	4,300	2,060.00	8,858,000	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,200	960.00	1,152,000	貸付株式数	300株
ファーマフーズ	10,600	1,285.00	13,621,000	貸付株式数	4,200株
北の達人コーポ	29,400	302.00	8,878,800	貸付株式数	11,700株 (2,600株)
ユーグレナ	44,100	901.00	39,734,100	貸付株式数	17,000株
紀文食品	5,400	943.00	5,092,200	貸付株式数	2,300株
ピックルスホールディングス	4,000	1,083.00	4,332,000		
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	6,200	716.00	4,439,200		
ＳＲＥホールディングス	3,400	4,575.00	15,555,000	貸付株式数	1,300株
ＡＤワークスグループ	17,200	156.00	2,683,200	貸付株式数	6,500株 (1,000株)
片倉工業	6,500	1,975.00	12,837,500	貸付株式数	2,100株
グ　ン　ゼ	5,400	3,980.00	21,492,000	貸付株式数	600株
ヒューリック	159,600	1,153.00	184,018,800		
神　栄	1,100	801.00	881,100		
ラサ商事	3,100	1,009.00	3,127,900	貸付株式数	100株
アルペン	6,100	2,030.00	12,383,000	貸付株式数	2,400株
ハブ	2,500	668.00	1,670,000	貸付株式数	900株
ラクーンホールディングス	6,900	1,260.00	8,694,000	貸付株式数	1,900株
クオールホールディングス	10,100	1,140.00	11,514,000	貸付株式数	4,000株
アルコニックス	9,600	1,315.00	12,624,000		
神戸物産	56,900	3,575.00	203,417,500	貸付株式数	22,700株

ソリトンシステムズ	3,600	1,165.00	4,194,000	貸付株式数	1,400株
ジンズホールディングス	4,400	4,325.00	19,030,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	49,000	1,265.00	61,985,000	貸付株式数	11,000株
ＤＣＭホールディングス	45,000	1,148.00	51,660,000		
ペッパーフードサービス	15,500	212.00	3,286,000	貸付株式数	6,100株
ハイパー	1,400	490.00	686,000	貸付株式数	500株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	104,300	2,336.00	243,644,800		
東京一番フーズ	2,000	581.00	1,162,000	貸付株式数	600株
ＤＤホールディングス	4,900	684.00	3,351,600	貸付株式数	1,300株
あい　ホールディングス	11,800	2,220.00	26,196,000		
ディーブイエックス	2,500	1,021.00	2,552,500	貸付株式数	1,000株
きちりホールディングス	2,100	568.00	1,192,800	貸付株式数	700株
アークランドサービスＨＤ	6,000	2,222.00	13,332,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
Ｊ．　フロント　リテイリング	91,200	1,159.00	105,700,800		
ドトール・日レスＨＤ	13,100	1,691.00	22,152,100		
マツキヨココカラ＆カンパニー	44,600	5,720.00	255,112,000		
ブロンコビリー	3,900	2,500.00	9,750,000	貸付株式数	1,500株
ＺＯＺＯ	48,600	3,425.00	166,455,000		
トレジャー・ファクトリー	2,200	2,396.00	5,271,200	貸付株式数	800株
物語コーポレーション	4,100	7,020.00	28,782,000	貸付株式数	1,600株
三越伊勢丹ＨＤ	123,600	1,324.00	163,646,400		
東洋紡	31,100	1,035.00	32,188,500		
ユニチカ	21,800	268.00	5,842,400		
富士紡ホールディングス	2,700	3,385.00	9,139,500		
日清紡ホールディングス	56,900	1,014.00	57,696,600		
倉敷紡績	5,200	2,179.00	11,330,800		
ダイワボウＨＤ	30,000	2,176.00	65,280,000		
シキボウ	3,700	878.00	3,248,600		
日東紡績	8,200	2,184.00	17,908,800		
トヨタ紡織	29,200	1,911.00	55,801,200		
マクニカホールディングス	17,900	3,445.00	61,665,500		
Ｈａｍｅｅ	2,900	881.00	2,554,900	貸付株式数	1,100株
マーケットエンタープライズ	800	1,006.00	804,800	貸付株式数	300株
ラクト・ジャパン	2,900	2,121.00	6,150,900	貸付株式数	1,000株 (400株)
ウエルシアＨＤ	38,000	3,020.00	114,760,000		

クリエイトＳＤＨ	11,900	3,065.00	36,473,500	貸付株式数	3,700株
グリムス	3,100	1,815.00	5,626,500	貸付株式数	1,300株 (100株)
バイタルＫＳＫＨＤ	11,000	826.00	9,086,000		
八洲電機	5,700	1,015.00	5,785,500	貸付株式数	2,200株 (400株)
メディアスホールディングス	5,100	765.00	3,901,500	貸付株式数	1,800株
レスターホールディングス	7,000	2,219.00	15,533,000		
ジューテックＨＤ	1,800	1,153.00	2,075,400		
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	9,100	330.00	3,003,000	貸付株式数	3,200株
大光	3,300	676.00	2,230,800	貸付株式数	1,200株 (100株)
ＯＣＨＩホールディングス	1,700	1,251.00	2,126,700	貸付株式数	700株
ＴＯＫＡＩホールディングス	36,100	876.00	31,623,600		
黒谷	2,000	587.00	1,174,000	貸付株式数	800株
ミサワ	1,200	618.00	741,600	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,000	1,329.00	1,329,000	貸付株式数	400株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	700	739.00	517,300	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	451.00	766,700	貸付株式数	500株
三洋貿易	7,500	1,139.00	8,542,500		
チムニー	2,300	1,127.00	2,592,100	貸付株式数	900株
シュッピン	5,500	1,470.00	8,085,000	貸付株式数	2,400株
ビューティガレージ	1,300	3,015.00	3,919,500	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,900	1,927.00	19,077,300	貸付株式数	4,100株
ウイン・パートナーズ	6,000	992.00	5,952,000	貸付株式数	2,000株
ネクステージ	16,800	3,085.00	51,828,000	貸付株式数	6,200株
ジョイフル本田	23,700	1,849.00	43,821,300	貸付株式数	7,500株
鳥貴族ホールディングス	2,700	2,445.00	6,601,500	貸付株式数	900株
ホットランド	5,600	1,527.00	8,551,200	貸付株式数	2,200株 (2,000株)
すかいらーくＨＤ	100,600	1,596.00	160,557,600	貸付株式数	40,200株
ＳＦＰホールディングス	4,000	1,711.00	6,844,000	貸付株式数	1,500株 (100株)
綿半ホールディングス	5,800	1,357.00	7,870,600	貸付株式数	1,600株
日本毛織	20,000	1,008.00	20,160,000	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	10,700	86.00	920,200	貸付株式数	5,500株
トーア紡コーポレーション	2,600	354.00	920,400	貸付株式数	900株

ダイドーリミテツド	10,100	247.00	2,494,700	貸付株式数	4,600株 (1,000株)
ヨシックスホールディングス	1,500	2,113.00	3,169,500	貸付株式数	600株
ユナイテッド・スーパーマーケ	23,300	1,101.00	25,653,300	貸付株式数	9,300株
三栄建築設計	3,300	1,538.00	5,075,400		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	42,800	3,320.00	142,096,000		
三重交通グループＨＤ	14,700	492.00	7,232,400	貸付株式数	1,800株
サムティ	10,400	2,274.00	23,649,600	貸付株式数	4,100株
地主	5,200	2,036.00	10,587,200	貸付株式数	2,000株
プレサンスコーポレーション	9,000	1,589.00	14,301,000	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,200	1,068.00	1,281,600		
ハウスコム	1,000	1,092.00	1,092,000	貸付株式数	400株
ＪＰＭＣ	3,300	1,046.00	3,451,800		
サンセイランディック	1,800	856.00	1,540,800	貸付株式数	400株
エストラスト	900	606.00	545,400	貸付株式数	200株
フージャースＨＤ	10,500	797.00	8,368,500	貸付株式数	100株
オープンハウスグループ	25,000	5,780.00	144,500,000		
東急不動産ＨＤ	205,900	742.00	152,777,800		
飯田ＧＨＤ	60,000	2,193.00	131,580,000		
イーグランド	1,000	1,585.00	1,585,000	貸付株式数	400株
帝国繊維	7,800	1,663.00	12,971,400	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	62,700	88.00	5,517,600	貸付株式数	8,100株
ゴルフダイジェスト・オン	3,300	1,741.00	5,745,300	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,900	1,108.00	2,105,200	貸付株式数	100株
ＢＥＥＮＯＳ	4,200	3,180.00	13,356,000	貸付株式数	1,400株
あさひ	6,200	1,332.00	8,258,400	貸付株式数	2,100株
日本調剤	5,000	1,198.00	5,990,000	貸付株式数	2,000株
コスモス薬品	8,300	13,960.00	115,868,000	貸付株式数	3,300株
シップヘルスケアＨＤ	26,600	2,773.00	73,761,800	貸付株式数	9,000株
トーエル	3,200	731.00	2,339,200	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	3,520.00	10,208,000		
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	253,600	5,579.00	1,414,834,400		
クリエイト・レストランツ・ホール	55,400	939.00	52,020,600	貸付株式数	20,100株
明治電機工業	2,400	1,040.00	2,496,000	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	18,000	8,870.00	159,660,000	貸付株式数	7,200株
デリカフーズＨＬＤＧＳ	3,000	487.00	1,461,000	貸付株式数	1,100株

スターティアホールディングス	1,400	1,153.00	1,614,200	貸付株式数	600株
サンマルクホールディングス	6,000	1,690.00	10,140,000		
フェリシモ	1,700	1,027.00	1,745,900	貸付株式数	200株
トリドールホールディングス	18,300	2,692.00	49,263,600	貸付株式数	6,600株
帝　人	66,900	1,328.00	88,843,200		
東　レ	467,300	738.60	345,147,780		
ク　ラ　レ	111,500	1,096.00	122,204,000		
旭　化　成	435,600	1,019.00	443,876,400		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	7,600	300.00	2,280,000	貸付株式数	3,000株
稲葉製作所	4,100	1,387.00	5,686,700	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングＧ	2,100	3,405.00	7,150,500		
トーカロ	19,200	1,242.00	23,846,400		
アルファＣＯ	2,600	957.00	2,488,200	貸付株式数	800株
ＳＵＭＣＯ	136,600	2,023.00	276,341,800	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,800	3,370.00	6,066,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	2,300	8,200.00	18,860,000	貸付株式数	900株
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,940.00	1,940,000	貸付株式数	300株
信和	3,800	789.00	2,998,200		
ビーロット	4,700	575.00	2,702,500	貸付株式数	2,000株
ファーストブラザーズ	1,500	857.00	1,285,500	貸付株式数	500株
ＡＮＤ　ＤＯホールディングス	4,000	853.00	3,412,000	貸付株式数	1,600株
シーアールイー	3,100	1,491.00	4,622,100	貸付株式数	1,100株
プロパティエージェント	800	1,298.00	1,038,400	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	3,300	4,930.00	16,269,000	貸付株式数	1,300株
アグレ都市デザイン	1,200	1,550.00	1,860,000	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,700	4,365.00	7,420,500		
ロードスターキャピタル	2,900	1,740.00	5,046,000	貸付株式数	1,100株
テンポイノベーション	2,000	994.00	1,988,000	貸付株式数	800株
グロバルリンクマネジメント	1,300	1,254.00	1,630,200	貸付株式数	500株
フェイスネットワーク	900	1,376.00	1,238,400	貸付株式数	300株
住江織物	1,200	1,761.00	2,113,200		
日本フエルト	3,700	413.00	1,528,100	貸付株式数	1,700株
イチカワ	700	1,312.00	918,400	貸付株式数	100株

エコナックホールディングス	11,900	94.00	1,118,600	貸付株式数	4,700株
日東製網	700	1,383.00	968,100	貸付株式数	100株
芦森工業	1,400	1,284.00	1,797,600		
アツギ	3,800	380.00	1,444,000	貸付株式数	200株
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,300	1,191.00	1,548,300	貸付株式数	500株
ＪＭホールディングス	5,900	1,759.00	10,378,100	貸付株式数	100株
コメダホールディングス	18,100	2,412.00	43,657,200	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	3,400	703.00	2,390,200	貸付株式数	1,300株
アレンザホールディングス	5,600	984.00	5,510,400	貸付株式数	2,000株
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	2,000	1,803.00	3,606,000	貸付株式数	700株
バロックジャパン	4,500	799.00	3,595,500	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	7,400	7,580.00	56,092,000	貸付株式数	2,900株
ダイニック	1,600	619.00	990,400	貸付株式数	800株
共和レザー	3,800	510.00	1,938,000	貸付株式数	1,400株
ピーバンドットコム	800	529.00	423,200	貸付株式数	300株
力の源ＨＤ	4,200	909.00	3,817,800	貸付株式数	1,600株
ＦＯＯＤ＆ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮ	42,300	2,495.00	105,538,500		
アセンテック	2,400	512.00	1,228,800	貸付株式数	900株
セーレン	13,400	2,623.00	35,148,200	貸付株式数	5,600株
ソトー	2,100	832.00	1,747,200	貸付株式数	1,100株
東海染工	500	1,127.00	563,500		
小松マテーレ	10,000	799.00	7,990,000		
ワコールホールディングス	13,300	2,329.00	30,975,700		
ホギメディカル	9,500	3,490.00	33,155,000		
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,600	285.00	456,000	貸付株式数	500株
ＴＳＩホールディングス	24,800	481.00	11,928,800	貸付株式数	9,100株
マツオカコーポレーション	1,800	1,043.00	1,877,400		
ワールド	9,000	1,315.00	11,835,000		
ＴＩＳ	78,400	3,890.00	304,976,000		
ＪＮＳホールディングス	3,000	359.00	1,077,000	貸付株式数	1,400株
グリー	37,400	768.00	28,723,200	貸付株式数	14,900株
ＧＭＯペパボ	1,000	2,022.00	2,022,000	貸付株式数	400株
コーエーテクモＨＤ	43,700	2,375.00	103,787,500		
三菱総合研究所	3,400	5,150.00	17,510,000		
ボルテージ	2,100	327.00	686,700	貸付株式数	600株
電算	700	1,631.00	1,141,700	貸付株式数	200株
ＡＧＳ	2,700	653.00	1,763,100	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	5,500	552.00	3,036,000	貸付株式数	2,200株

ブレインパッド	6,900	893.00	6,161,700	貸付株式数	700株
ＫＬａｂ	13,700	490.00	6,713,000	貸付株式数	5,400株
ポールトゥウィンホールディン	11,900	937.00	11,150,300		
ネクソン	180,300	2,894.00	521,788,200		
アイスタイル	22,300	538.00	11,997,400	貸付株式数	8,900株
エムアップホールディングス	8,600	1,354.00	11,644,400	貸付株式数	3,400株
エイチーム	5,100	829.00	4,227,900		
エニグモ	8,900	597.00	5,313,300	貸付株式数	3,200株
テクノスジャパン	5,600	489.00	2,738,400	貸付株式数	300株
ｅｎｉｓｈ	5,300	424.00	2,247,200	貸付株式数	2,000株
コロプラ	27,100	686.00	18,590,600	貸付株式数	10,100株
オルトプラス	5,400	290.00	1,566,000	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	40,600	496.00	20,137,600	貸付株式数	16,000株
クロス・マーケティングＧ	2,800	783.00	2,192,400	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	4,400	1,890.00	8,316,000	貸付株式数	200株
システム情報	6,100	898.00	5,477,800	貸付株式数	100株
メディアドゥ	2,800	1,910.00	5,348,000		
じげん	20,300	357.00	7,247,100		
ブイキューブ	8,400	795.00	6,678,000	貸付株式数	3,300株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	516.00	670,800	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	2,200	1,131.00	2,488,200	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	336.00	1,444,800		
フィックスターズ	7,900	1,376.00	10,870,400		
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,300	1,700.00	5,610,000	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,800	1,162.00	6,739,600	貸付株式数	2,100株 (1,900株)
セレス	2,800	958.00	2,682,400	貸付株式数	1,100株
ＳＨＩＦＴ	5,100	28,870.00	147,237,000		
特種東海製紙	3,400	2,833.00	9,632,200	貸付株式数	1,300株
ティーガイア	7,400	1,652.00	12,224,800	貸付株式数	2,200株
セック	900	2,336.00	2,102,400	貸付株式数	100株
テクマトリックス	12,700	1,646.00	20,904,200		
プロシップ	3,000	1,527.00	4,581,000	貸付株式数	800株
ガンホー・オンライン・エンター	21,400	2,080.00	44,512,000	貸付株式数	7,300株

GMOペイメントゲートウェイ	15,900	12,160.00	193,344,000		
ザッパラス	2,500	365.00	912,500	貸付株式数	900株
システムリサーチ	2,100	2,031.00	4,265,100	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	38,900	2,450.00	95,305,000		
さくらインターネット	7,700	527.00	4,057,900	貸付株式数	3,100株
ヴィンクス	2,100	1,682.00	3,532,200		
GMOグローバルサインHD	2,100	4,000.00	8,400,000	貸付株式数	800株
ＳＲＡホールディングス	3,500	3,125.00	10,937,500		
システムインテグレータ	1,900	461.00	875,900	貸付株式数	900株
朝日ネット	7,500	571.00	4,282,500		
ｅＢＡＳＥ	9,700	620.00	6,014,000	貸付株式数	3,600株
アバントグループ	8,800	1,500.00	13,200,000	貸付株式数	3,300株
アドソル日進	2,800	1,508.00	4,222,400	貸付株式数	1,100株
ＯＤＫソリューションズ	1,500	603.00	904,500	貸付株式数	600株
フリービット	4,300	1,156.00	4,970,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
コムチュア	9,200	2,607.00	23,984,400	貸付株式数	1,300株
サイバーコム	1,100	1,567.00	1,723,700	貸付株式数	400株
アステリア	5,500	812.00	4,466,000	貸付株式数	2,100株
アイル	3,900	1,991.00	7,764,900	貸付株式数	1,500株
王子ホールディングス	289,700	528.00	152,961,600		
日本製紙	36,300	965.00	35,029,500		
三菱製紙	7,900	279.00	2,204,100	貸付株式数	3,000株
北越コーポレーション	43,900	777.00	34,110,300	貸付株式数	17,600株
中越パルプ	2,600	948.00	2,464,800	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,500	780.00	1,950,000	貸付株式数	800株
大王製紙	30,600	1,064.00	32,558,400		
阿波製紙	1,100	303.00	333,300	貸付株式数	500株
マークラインズ	3,800	2,783.00	10,575,400		
メディカル・データ・ビジ	10,600	1,002.00	10,621,200	貸付株式数	3,800株
ｇｕｍｉ	11,400	737.00	8,401,800	貸付株式数	4,500株
ショーケース	1,600	363.00	580,800	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,500	903.00	1,354,500	貸付株式数	500株
テラスカイ	3,000	2,800.00	8,400,000	貸付株式数	1,000株 (100株)
デジタル・インフォメーション	3,600	1,985.00	7,146,000		

ＰＣＩホールディングス	2,900	999.00	2,897,100	貸付株式数	200株
アイビーシー	1,100	447.00	491,700	貸付株式数	400株
ネオジャパン	2,300	1,001.00	2,302,300	貸付株式数	800株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,700	2,478.00	4,212,600	貸付株式数	600株
ラクス	33,000	1,720.00	56,760,000		
ランドコンピュータ	1,600	875.00	1,400,000	貸付株式数	300株
ダブルスタンダード	2,800	2,213.00	6,196,400	貸付株式数	1,100株
オープンドア	4,900	1,967.00	9,638,300	貸付株式数	1,900株
マイネット	2,300	455.00	1,046,500	貸付株式数	700株
アカツキ	3,300	2,274.00	7,504,200		
ベネフィットジャパン	400	1,302.00	520,800	貸付株式数	200株
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	2,200	2,295.00	5,049,000	貸付株式数	800株
カナミックネットワーク	10,700	645.00	6,901,500		
ノムラシステムコーポレーション	6,500	123.00	799,500	貸付株式数	2,900株
レンゴー	63,200	866.00	54,731,200		
トーモク	4,000	1,600.00	6,400,000		
ザ・パック	5,200	2,521.00	13,109,200	貸付株式数	1,900株
チェンジ	17,100	2,181.00	37,295,100		
シンクロ・フード	4,400	476.00	2,094,400	貸付株式数	1,700株
オークネット	3,600	1,951.00	7,023,600	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,300	595.00	773,500	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,900	909.00	1,727,100	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,000	1,517.00	1,517,000	貸付株式数	500株
マクロミル	15,800	1,103.00	17,427,400	貸付株式数	6,000株
ビーグリー	1,200	1,300.00	1,560,000	貸付株式数	600株
オロ	2,100	1,867.00	3,920,700	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,500	1,590.00	3,975,000		
テモナ	1,300	340.00	442,000	貸付株式数	500株
ニーズウェル	2,100	730.00	1,533,000	貸付株式数	500株
マネーフォワード	16,800	4,885.00	82,068,000	貸付株式数	6,200株 (100株)
サインポスト	2,700	733.00	1,979,100	貸付株式数	700株
昭和電工	67,300	2,188.00	147,252,400	貸付株式数	300株
住友化学	517,600	498.00	257,764,800		
住友精化	3,100	4,240.00	13,144,000	貸付株式数	400株
日産化学	33,100	6,740.00	223,094,000		
ラサ工業	2,800	2,117.00	5,927,600		

クレハ	6,000	9,730.00	58,380,000	貸付株式数	2,100株
多木化学	2,800	5,250.00	14,700,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	5,100	1,275.00	6,502,500		
石原産業	12,900	1,121.00	14,460,900	貸付株式数	100株
片倉コープアグリ	1,800	1,613.00	2,903,400		
日本曹達	7,600	4,280.00	32,528,000	貸付株式数	900株
東ソー	93,300	1,623.00	151,425,900		
トクヤマ	22,800	1,913.00	43,616,400		
セントラル硝子	11,200	3,495.00	39,144,000	貸付株式数	100株
東亞合成	36,800	1,177.00	43,313,600		
大阪ソーダ	4,300	4,130.00	17,759,000		
関東電化	13,900	1,026.00	14,261,400	貸付株式数	100株
デンカ	25,400	3,310.00	84,074,000		
イビデン	40,200	5,510.00	221,502,000		
信越化学	119,300	17,570.00	2,096,101,000		
日本カーバイド	2,900	1,307.00	3,790,300	貸付株式数	900株
電算システムＨＤ	3,300	2,272.00	7,497,600	貸付株式数	1,200株
堺　化　学	5,600	1,879.00	10,522,400	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,500	1,203.00	7,819,500	貸付株式数	2,500株
エア・ウォーター	66,100	1,615.00	106,751,500		
日本酸素ＨＬＤＧＳ	67,800	2,273.00	154,109,400		
日本化学工業	2,500	1,858.00	4,645,000		
東邦アセチレン	1,500	1,120.00	1,680,000		
日本パーカライジング	35,000	991.00	34,685,000		
高圧ガス	11,200	648.00	7,257,600		
チタン工業	1,100	1,571.00	1,728,100	貸付株式数	200株
四国化成	8,600	1,351.00	11,618,600		
戸田工業	1,600	2,948.00	4,716,800	貸付株式数	600株
ステラ　ケミファ	4,300	2,617.00	11,253,100	貸付株式数	1,300株
保土谷化学	2,000	3,105.00	6,210,000		
日本触媒	10,700	5,510.00	58,957,000		
大日精化	5,200	1,717.00	8,928,400		
カネカ	16,100	3,500.00	56,350,000		
協和キリン	84,300	3,175.00	267,652,500		
三菱瓦斯化学	52,300	1,961.00	102,560,300		
三井化学	58,800	3,100.00	182,280,000		
ＪＳＲ	65,200	2,873.00	187,319,600		
東京応化工業	12,100	6,840.00	82,764,000		
大阪有機化学	5,300	2,113.00	11,198,900		
三菱ケミカルグループ	471,200	729.20	343,599,040		

ＫＨネオケム	11,700	2,767.00	32,373,900		
ダイセル	103,500	998.00	103,293,000		
住友ベークライト	10,400	4,320.00	44,928,000		
積水化学	144,900	1,927.00	279,222,300		
日本ゼオン	42,300	1,325.00	56,047,500		
アイカ工業	17,700	3,235.00	57,259,500		
ＵＢＥ	35,900	1,999.00	71,764,100		
積水樹脂	10,200	1,809.00	18,451,800		
タキロンシーアイ	16,700	508.00	8,483,600		
旭有機材	4,900	2,654.00	13,004,600		
ニチバン	4,300	1,754.00	7,542,200	貸付株式数	1,500株
リケンテクノス	16,100	499.00	8,033,900		
大倉工業	3,200	2,014.00	6,444,800	貸付株式数	1,300株
積水化成品	14,500	393.00	5,698,500		
群栄化学	1,800	2,424.00	4,363,200	貸付株式数	100株
タイガース　ポリマー	6,200	404.00	2,504,800		
ミライアル	2,100	1,716.00	3,603,600	貸付株式数	800株
ダイキアクシス	2,600	741.00	1,926,600	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	16,600	590.00	9,794,000		
竹本容器	2,200	756.00	1,663,200	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,800	1,757.00	6,676,600		
恵和	2,300	3,725.00	8,567,500		
日本化薬	53,300	1,248.00	66,518,400	貸付株式数	200株
カーリットホールディングス	6,400	719.00	4,601,600	貸付株式数	2,500株
ソルクシーズ	5,600	369.00	2,066,400	貸付株式数	2,300株
ＣＬホールディングス	2,000	833.00	1,666,000	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	30,000	712.00	21,360,000		
フェイス	2,000	544.00	1,088,000	貸付株式数	700株
プロトコーポレーション	8,700	1,260.00	10,962,000	貸付株式数	1,400株
ハイマックス	2,200	1,435.00	3,157,000		
アミューズ	3,900	1,792.00	6,988,800		
野村総合研究所	143,100	2,996.00	428,727,600		
ドリームインキュベータ	2,200	2,826.00	6,217,200	貸付株式数	800株
サイバネットシステム	5,800	967.00	5,608,600		
クイック	5,500	2,083.00	11,456,500		
ＴＡＣ	3,800	207.00	786,600	貸付株式数	800株 (400株)
ＣＥホールディングス	3,500	513.00	1,795,500		
日本システム技術	2,900	1,734.00	5,028,600	貸付株式数	200株

電通グループ	75,000	4,400.00	330,000,000		
インテージホールディングス	9,500	1,532.00	14,554,000		
テイクアンドギヴニーズ	2,500	1,437.00	3,592,500		
東邦システムサイエンス	1,900	1,019.00	1,936,100	貸付株式数	700株
ぴあ	2,400	3,280.00	7,872,000	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	3,100	2,923.00	9,061,300	貸付株式数	1,200株
ソースネクスト	35,500	279.00	9,904,500	貸付株式数	12,000株
シーティーエス	7,800	835.00	6,513,000		
ネクシィーズグループ	2,200	716.00	1,575,200	貸付株式数	800株
インフォコム	9,000	2,046.00	18,414,000		
メディカルシステムネットワーク	6,400	404.00	2,585,600		
日本精化	4,100	2,238.00	9,175,800	貸付株式数	2,100株
扶桑化学工業	6,500	3,525.00	22,912,500		
トリケミカル	9,400	2,411.00	22,663,400		
シンプレクスＨＤ	11,700	2,321.00	27,155,700		
ＨＥＲＯＺ	2,300	1,247.00	2,868,100	貸付株式数	900株 (700株)
ラクスル	9,800	3,065.00	30,037,000		
メルカリ	31,400	2,811.00	88,265,400	貸付株式数	11,800株
ＩＰＳ	2,300	3,075.00	7,072,500	貸付株式数	900株
ＦＩＧ	8,200	409.00	3,353,800	貸付株式数	3,200株 (1,300株)
システムサポート	2,900	1,492.00	4,326,800	貸付株式数	600株
ＡＤＥＫＡ	24,500	2,252.00	55,174,000		
日油	21,600	5,780.00	124,848,000		
ミヨシ油脂	2,700	986.00	2,662,200	貸付株式数	900株
新日本理化	10,200	255.00	2,601,000	貸付株式数	2,200株
ハリマ化成グループ	5,500	841.00	4,625,500		
イーソル	4,500	911.00	4,099,500	貸付株式数	1,300株
アルテリア・ネットワークス	6,400	1,250.00	8,000,000	貸付株式数	700株
東海ソフト	1,100	926.00	1,018,600	貸付株式数	200株
ウイングアーク１ＳＴ	7,200	2,219.00	15,976,800		
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,900	1,647.00	3,129,300	貸付株式数	700株
サーバーワークス	1,400	2,807.00	3,929,800	貸付株式数	500株
東名	500	1,488.00	744,000	貸付株式数	100株
ヴィッツ	700	1,027.00	718,900	貸付株式数	200株

トビラシステムズ	1,800	1,133.00	2,039,400	貸付株式数	600株
Ｓａｎｓａｎ	26,000	1,670.00	43,420,000	貸付株式数	10,400株
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,300	962.00	1,250,600	貸付株式数	500株
ギフティ	7,500	2,261.00	16,957,500	貸付株式数	3,000株
花　王	169,700	5,461.00	926,731,700		
第一工業製薬	2,700	2,009.00	5,424,300		
石原ケミカル	3,500	1,234.00	4,319,000		
日華化学	3,000	891.00	2,673,000	貸付株式数	1,100株
ニイタカ	1,400	2,095.00	2,933,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,400	4,405.00	19,382,000		
ベース	2,400	3,865.00	9,276,000	貸付株式数	900株
ＪＭＤＣ	11,400	5,120.00	58,368,000		
武田薬品	617,500	4,050.00	2,500,875,000		
アステラス製薬	668,700	2,128.00	1,422,993,600		
住友ファーマ	51,800	1,067.00	55,270,600		
塩野義製薬	89,200	6,950.00	619,940,000		
わかもと製薬	6,600	236.00	1,557,600	貸付株式数	2,900株
日本新薬	16,500	8,090.00	133,485,000		
中外製薬	218,400	3,624.00	791,481,600		
科研製薬	12,000	3,940.00	47,280,000	貸付株式数	500株
エーザイ	84,900	9,332.00	792,286,800		
理研ビタミン	5,900	1,776.00	10,478,400		
ロート製薬	33,800	4,490.00	151,762,000		
小野薬品	134,600	3,516.00	473,253,600		
久光製薬	15,500	3,870.00	59,985,000		
有機合成薬品	5,800	299.00	1,734,200	貸付株式数	1,300株
持田製薬	8,400	3,380.00	28,392,000	貸付株式数	100株
参天製薬	135,500	1,114.00	150,947,000		
扶桑薬品	2,300	2,047.00	4,708,100		
日本ケミファ	700	1,699.00	1,189,300		
ツムラ	22,000	2,999.00	65,978,000		
日医工	10,400	205.00	2,132,000	貸付株式数	8,800株
テ　ル　モ	217,500	4,043.00	879,352,500		
ＨＵグループＨＤ	20,900	2,775.00	57,997,500		
キッセイ薬品工業	10,800	2,534.00	27,367,200		
生化学工業	13,300	943.00	12,541,900	貸付株式数	4,500株
栄研化学	11,400	1,903.00	21,694,200		
鳥居薬品	3,800	2,902.00	11,027,600	貸付株式数	700株
ＪＣＲファーマ	23,600	1,912.00	45,123,200		
東和薬品	10,700	2,112.00	22,598,400		

富士製薬工業	4,500	1,019.00	4,585,500		
ゼリア新薬工業	9,700	2,226.00	21,592,200	貸付株式数	1,900株
第一三共	607,900	4,518.00	2,746,492,200		
キョーリン製薬ＨＤ	15,200	1,770.00	26,904,000	貸付株式数	5,700株
大幸薬品	12,800	523.00	6,694,400	貸付株式数	4,600株
ダイト	5,300	2,594.00	13,748,200		
大塚ホールディングス	159,600	4,690.00	748,524,000		
大正製薬ＨＤ	15,500	5,600.00	86,800,000		
ペプチドリーム	33,800	1,712.00	57,865,600		
大日本塗料	9,400	767.00	7,209,800	貸付株式数	3,100株
日本ペイントＨＯＬＤ	308,600	1,120.00	345,632,000		
関西ペイント	64,000	1,877.00	120,128,000		
神東塗料	9,900	132.00	1,306,800	貸付株式数	1,800株
中国塗料	13,500	1,033.00	13,945,500		
日本特殊塗料	4,400	872.00	3,836,800		
藤倉化成	10,800	409.00	4,417,200	貸付株式数	3,700株
太陽ホールディングス	10,800	2,539.00	27,421,200		
ＤＩＣ	27,600	2,506.00	69,165,600	貸付株式数	11,000株
サカタインクス	16,000	1,105.00	17,680,000	貸付株式数	1,400株
東洋インキＳＣホールディン	14,100	1,880.00	26,508,000	貸付株式数	5,600株
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	6,600	1,002.00	6,613,200		
アルプス技研	6,200	2,091.00	12,964,200		
サニックス	11,400	236.00	2,690,400	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
ダイオーズ	300	1,498.00	449,400		
日本空調サービス	7,700	708.00	5,451,600	貸付株式数	500株
オリエンタルランド	75,700	19,720.00	1,492,804,000		
フォーカスシステムズ	5,000	1,002.00	5,010,000		
ダスキン	15,900	2,953.00	46,952,700		
パーク２４	53,400	2,005.00	107,067,000	貸付株式数	5,500株
明光ネットワークジャパン	9,300	617.00	5,738,100	貸付株式数	3,100株
ファルコホールディングス	3,200	1,807.00	5,782,400	貸付株式数	400株
クレスコ	5,400	1,735.00	9,369,000	貸付株式数	2,100株
フジ・メディア・ＨＤ	67,200	1,077.00	72,374,400		
秀英予備校	1,500	443.00	664,500	貸付株式数	800株
田谷	1,100	536.00	589,600	貸付株式数	600株
ラウンドワン	59,800	610.00	36,478,000		
リゾートトラスト	28,200	2,435.00	68,667,000		
オービック	23,300	21,700.00	505,610,000		

ジャストシステム	10,000	3,300.00	33,000,000		
ＴＤＣソフト	5,800	1,469.00	8,520,200		
Ｚホールディングス	992,900	373.50	370,848,150		
ビー・エム・エル	8,800	3,460.00	30,448,000		
トレンドマイクロ	40,300	6,810.00	274,443,000		
りらいあコミュニケーショ	11,800	1,027.00	12,118,600		
ＩＤホールディングス	4,600	918.00	4,222,800		
リソー教育	32,600	323.00	10,529,800	貸付株式数	200株
日本オラクル	13,300	8,030.00	106,799,000		
早稲田アカデミー	3,900	1,153.00	4,496,700	貸付株式数	1,600株
アルファシステムズ	2,200	4,240.00	9,328,000	貸付株式数	500株
フューチャー	17,400	1,671.00	29,075,400		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,300	1,532.00	6,587,600		
ＳＢテクノロジー	3,000	2,060.00	6,180,000		
トーセ	1,800	774.00	1,393,200	貸付株式数	100株
ユー・エス・エス	73,500	2,296.00	168,756,000		
オービックビジネスＣ	13,700	4,675.00	64,047,500		
伊藤忠テクノソリュー	37,400	3,350.00	125,290,000		
アイティフォー	9,000	801.00	7,209,000		
東京個別指導学院	8,400	529.00	4,443,600	貸付株式数	2,600株
東計電算	1,000	5,910.00	5,910,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	171,100	1,229.00	210,281,900		
楽天グループ	330,800	653.00	216,012,400		
エックスネット	800	998.00	798,400		
クリーク・アンド・リバー社	4,200	2,058.00	8,643,600		
モーニングスター	11,600	470.00	5,452,000	貸付株式数	4,800株
テー・オー・ダブリュー	14,900	297.00	4,425,300	貸付株式数	4,200株
大塚商会	39,500	4,570.00	180,515,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,600	2,219.00	21,302,400	貸付株式数	200株
山田コンサルティングＧＰ	3,700	1,144.00	4,232,800	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,600	2,416.00	6,281,600	貸付株式数	900株
パラカ	2,400	1,908.00	4,579,200	貸付株式数	600株
電通国際情報Ｓ	8,500	4,575.00	38,887,500	貸付株式数	3,800株
ＡＣＣＥＳＳ	8,100	748.00	6,058,800	貸付株式数	900株
デジタルガレージ	12,400	4,005.00	49,662,000		
イーエムシステムズ	11,600	988.00	11,460,800		
ウェザーニューズ	2,500	7,610.00	19,025,000	貸付株式数	900株
ＣＩＪ	6,300	934.00	5,884,200	貸付株式数	2,400株
ビジネスエンジニアリング	1,500	2,219.00	3,328,500	貸付株式数	600株

日本エンタープライズ	7,100	142.00	1,008,200	貸付株式数	2,900株
WOWOW	3,900	1,252.00	4,882,800	貸付株式数	700株
スカラ	6,800	747.00	5,079,600		
インテリジェント　ウェイブ	3,700	806.00	2,982,200	貸付株式数	1,500株
フルキャストホールディングス	6,800	3,075.00	20,910,000	貸付株式数	2,600株
エン・ジャパン	12,900	2,448.00	31,579,200		
あすか製薬ＨＤ	7,200	1,279.00	9,208,800		
サワイグループＨＤ	16,000	4,240.00	67,840,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	133,800	7,315.00	978,747,000		
コニカミノルタ	156,800	569.00	89,219,200		
資　生　堂	145,700	5,799.00	844,914,300		
ライオン	83,800	1,465.00	122,767,000		
高砂香料	4,900	2,844.00	13,935,600	貸付株式数	1,700株
マンダム	15,000	1,438.00	21,570,000		
ミルボン	10,300	5,700.00	58,710,000	貸付株式数	2,200株
ファンケル	30,500	2,566.00	78,263,000		
コーセー	14,200	14,490.00	205,758,000		
コタ	5,800	1,683.00	9,761,400		
シーボン	800	1,631.00	1,304,800	貸付株式数	400株
ポーラ・オルビスＨＤ	35,700	1,786.00	63,760,200	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	6,200	5,830.00	36,146,000		
アジュバンホールディング	1,600	956.00	1,529,600	貸付株式数	600株
新日本製薬	4,000	1,373.00	5,492,000	貸付株式数	1,400株
エステー	5,300	1,538.00	8,151,400	貸付株式数	2,000株
アグロカネショウ	3,000	1,551.00	4,653,000	貸付株式数	1,000株
コ　ニ　シ	12,200	1,723.00	21,020,600		
長谷川香料	14,600	3,075.00	44,895,000		
星光ＰＭＣ	4,400	556.00	2,446,400	貸付株式数	100株
小林製薬	21,300	8,500.00	181,050,000		
荒川化学工業	6,800	995.00	6,766,000	貸付株式数	1,200株
メック	5,800	2,571.00	14,911,800	貸付株式数	1,700株
日本高純度化学	2,000	2,504.00	5,008,000		
タカラバイオ	18,800	1,801.00	33,858,800		
ＪＣＵ	8,000	3,370.00	26,960,000		
新田ゼラチン	4,400	1,076.00	4,734,400	貸付株式数	1,700株
ＯＡＴアグリオ	2,900	1,776.00	5,150,400	貸付株式数	1,100株
デクセリアルズ	20,200	3,230.00	65,246,000	貸付株式数	8,000株
アース製薬	6,300	5,320.00	33,516,000		

北興化学	7,200	909.00	6,544,800		
大成ラミック	2,100	3,075.00	6,457,500		
クミアイ化学	28,000	923.00	25,844,000		
日本農薬	13,100	749.00	9,811,900	貸付株式数	5,100株
富士興産	1,600	1,126.00	1,801,600		
ニチレキ	8,600	1,295.00	11,137,000		
ユシロ化学	3,500	828.00	2,898,000		
ビーピー・カストロール	2,600	965.00	2,509,000		
富士石油	14,400	275.00	3,960,000	貸付株式数	5,600株
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,800	1,112.00	3,113,600	貸付株式数	1,000株
出光興産	77,500	3,240.00	251,100,000		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,260,200	466.00	587,253,200		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	26,500	3,880.00	102,820,000		
テスホールディングス	7,300	1,112.00	8,117,600	貸付株式数	2,900株
インフロニアＨＤ	71,500	1,030.00	73,645,000		
横浜ゴム	39,700	2,255.00	89,523,500		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	40,000	1,567.00	62,680,000		
ブリヂストン	222,800	5,167.00	1,151,207,600		
住友ゴム	68,300	1,188.00	81,140,400		
藤倉コンポジット	5,200	847.00	4,404,400	貸付株式数	2,400株
オカモト	4,200	3,850.00	16,170,000		
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ　ＧＲＯＵＰ	1,200	1,059.00	1,270,800	貸付株式数	400株
アキレス	4,800	1,351.00	6,484,800	貸付株式数	700株
フ　コ　ク	3,500	1,096.00	3,836,000		
ニッタ	7,800	2,930.00	22,854,000		
クリエートメディック	3,200	907.00	2,902,400	貸付株式数	700株
住友理工	15,100	616.00	9,301,600		
三ツ星ベルト	10,500	3,430.00	36,015,000		
バンドー化学	12,400	999.00	12,387,600	貸付株式数	100株
ＡＧＣ	70,900	4,600.00	326,140,000		
日本板硝子	35,300	604.00	21,321,200		
石塚硝子	1,300	1,486.00	1,931,800	貸付株式数	400株
有沢製作所	11,200	1,284.00	14,380,800		
日本山村硝子	2,200	610.00	1,342,000	貸付株式数	700株
日本電気硝子	28,200	2,532.00	71,402,400		
オハラ	3,200	1,265.00	4,048,000	貸付株式数	1,200株
住友大阪セメント	9,700	3,235.00	31,379,500		

太平洋セメント	44,100	2,167.00	95,564,700		
リソルホールディングス	600	4,565.00	2,739,000	貸付株式数	300株
日本ヒユーム	6,800	648.00	4,406,400		
日本コンクリート	14,900	234.00	3,486,600	貸付株式数	100株
三谷セキサン	2,900	4,210.00	12,209,000		
アジアパイルＨＤ	12,100	536.00	6,485,600		
東海カーボン	58,100	1,047.00	60,830,700		
日本カーボン	3,800	4,335.00	16,473,000	貸付株式数	300株
東洋炭素	4,600	3,930.00	18,078,000	貸付株式数	1,600株
ノリタケ	3,400	4,040.00	13,736,000		
ＴＯＴＯ	46,000	4,745.00	218,270,000		
日本碍子	82,100	1,811.00	148,683,100		
日本特殊陶業	53,100	2,680.00	142,308,000		
ダントーホールディングス	5,000	276.00	1,380,000	貸付株式数	2,000株
ＭＡＲＵＷＡ	2,600	18,820.00	48,932,000		
品川リフラクトリーズ	1,900	3,945.00	7,495,500		
黒崎播磨	1,400	5,030.00	7,042,000		
ヨータイ	4,500	1,376.00	6,192,000		
東京窯業	4,700	270.00	1,269,000	貸付株式数	2,800株
ニッカトー	2,500	511.00	1,277,500		
フジミインコーポレーテッド	5,500	7,020.00	38,610,000		
クニミネ工業	1,800	861.00	1,549,800	貸付株式数	900株
エーアンドエーマテリアル	800	867.00	693,600		
ニチアス	17,600	2,418.00	42,556,800	貸付株式数	800株
日本製鉄	321,300	2,192.50	704,450,250		
神戸製鋼所	144,200	620.00	89,404,000		
中山製鋼所	14,700	755.00	11,098,500		
合同製鐵	3,500	1,903.00	6,660,500		
ＪＦＥホールディングス	191,800	1,526.00	292,686,800		
東京製鐵	20,100	1,403.00	28,200,300	貸付株式数	8,000株
共英製鋼	8,100	1,293.00	10,473,300	貸付株式数	3,100株
大和工業	11,800	4,710.00	55,578,000	貸付株式数	100株
東京鐵鋼	3,300	1,412.00	4,659,600	貸付株式数	1,100株
大阪製鐵	3,200	1,135.00	3,632,000		
淀川製鋼所	8,100	2,543.00	20,598,300	貸付株式数	400株
丸一鋼管	21,800	2,843.00	61,977,400		
モリ工業	1,600	2,813.00	4,500,800		
大同特殊鋼	9,000	4,415.00	39,735,000		
日本高周波	1,900	315.00	598,500	貸付株式数	900株

日本冶金工	5,200	4,305.00	22,386,000		
山陽特殊製鋼	7,000	2,213.00	15,491,000		
愛知製鋼	4,100	2,273.00	9,319,300		
日本金属	1,500	1,021.00	1,531,500	貸付株式数	700株
大平洋金属	5,100	2,050.00	10,455,000		
新日本電工	46,000	422.00	19,412,000		
栗本鉄工所	3,300	1,796.00	5,926,800		
虹　技	800	906.00	724,800	貸付株式数	100株
日本鋳鉄管	800	954.00	763,200	貸付株式数	300株
日本製鋼所	19,300	2,920.00	56,356,000		
三菱製鋼	4,600	995.00	4,577,000		
日亜鋼業	6,600	237.00	1,564,200	貸付株式数	200株
日本精線	1,000	4,365.00	4,365,000	貸付株式数	400株
エンビプロＨＤ	4,900	720.00	3,528,000	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	10,200	1,295.00	13,209,000		
日本軽金属ＨＤ	19,200	1,532.00	29,414,400		
三井金属	20,800	3,135.00	65,208,000		
東邦亜鉛	4,200	2,159.00	9,067,800		
三菱マテリアル	47,700	2,187.00	104,319,900		
住友鉱山	83,200	4,645.00	386,464,000		
ＤＯＷＡホールディングス	16,100	4,520.00	72,772,000		
古河機金	10,200	1,291.00	13,168,200		
エス・サイエンス	42,800	28.00	1,198,400	貸付株式数	14,800株
大阪チタニウム	10,500	4,195.00	44,047,500		
東邦チタニウム	13,000	2,748.00	35,724,000		
ＵＡＣＪ	10,000	2,305.00	23,050,000		
ＣＫサンエツ	1,700	4,225.00	7,182,500	貸付株式数	600株
古河電工	24,500	2,597.00	63,626,500		
住友電工	247,800	1,600.50	396,603,900		
フジクラ	77,000	1,117.00	86,009,000		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	8,000	1,795.00	14,360,000	貸付株式数	100株
東京特殊電線	1,000	5,650.00	5,650,000		
タツタ電線	15,000	431.00	6,465,000	貸付株式数	900株
カナレ電気	800	1,498.00	1,198,400	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,900	1,098.00	4,282,200	貸付株式数	1,400株
いよぎんホールディンク	80,700	729.00	58,830,300		
しずおかフィナンシャルク	154,200	1,005.00	154,971,000		
ちゅうぎんフィナンシャ	56,900	968.00	55,079,200		
リョービ	7,600	1,243.00	9,446,800		
アーレステイ	7,800	390.00	3,042,000		

アサヒＨＤ	29,000	2,044.00	59,276,000		
東洋製罐グループＨＤ	47,900	1,594.00	76,352,600		
ホッカンホールディングス	5,000	1,323.00	6,615,000	貸付株式数	1,400株
コロナ	3,900	867.00	3,381,300		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	9,700	1,933.00	18,750,100		
駒井ハルテック	1,300	1,539.00	2,000,700		
高田機工	800	2,455.00	1,964,000	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	66,100	1,290.00	85,269,000		
文化シヤッター	20,700	1,124.00	23,266,800	貸付株式数	8,900株
三協立山	10,400	565.00	5,876,000		
アルインコ	5,400	1,000.00	5,400,000	貸付株式数	1,800株
東洋シヤッター	1,700	524.00	890,800	貸付株式数	200株
ＬＩＸＩＬ	104,600	2,109.00	220,601,400		
日本フイルコン	7,100	466.00	3,308,600	貸付株式数	2,200株
ノーリツ	10,500	1,484.00	15,582,000		
長府製作所	7,200	1,972.00	14,198,400		
リンナイ	13,000	10,180.00	132,340,000		
ユニプレス	12,400	882.00	10,936,800		
ダイニチ工業	3,500	686.00	2,401,000		
日東精工	11,200	523.00	5,857,600		
三洋工業	800	1,770.00	1,416,000	貸付株式数	300株
岡　部	11,400	719.00	8,196,600		
ジーテクト	7,800	1,534.00	11,965,200		
東　プ　レ	12,500	1,259.00	15,737,500		
高周波熱錬	12,600	680.00	8,568,000	貸付株式数	4,600株
東京製綱	4,400	891.00	3,920,400		
サンコール	6,400	636.00	4,070,400	貸付株式数	2,500株
モリテックスチル	5,500	245.00	1,347,500	貸付株式数	2,300株
パイオラックス	9,900	1,740.00	17,226,000		
エイチワン	7,200	648.00	4,665,600		
日本発条	63,400	915.00	58,011,000		
中央発條	4,900	706.00	3,459,400		
アドバネクス	1,200	1,211.00	1,453,200	貸付株式数	400株
三浦工業	29,200	3,260.00	95,192,000		
タ　ク　マ	21,400	1,276.00	27,306,400		
テクノプロ・ホールディング	48,000	3,790.00	181,920,000		
アトラグループ	1,600	201.00	321,600	貸付株式数	600株
インターワークス	1,700	368.00	625,600	貸付株式数	800株
アイ・アールジャパンＨＤ	3,700	1,808.00	6,689,600	貸付株式数	1,400株

ＫｅｅＰｅｒ技研	5,200	4,255.00	22,126,000		
ファーストロジック	1,100	827.00	909,700	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	955.00	1,241,500	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,400	669.00	2,943,600	貸付株式数	1,700株
デザインワン・ジャパン	2,200	197.00	433,400	貸付株式数	900株 (100株)
イー・ガーディアン	2,700	2,866.00	7,738,200		
リブセンス	3,300	315.00	1,039,500	貸付株式数	1,300株
ジャパンマテリアル	21,900	2,433.00	53,282,700		
ベクトル	11,200	1,281.00	14,347,200	貸付株式数	300株
ウチヤマホールディングス	3,300	278.00	917,400	貸付株式数	1,400株
チャームケアコーポレーション	6,000	1,158.00	6,948,000	貸付株式数	2,100株
キャリアリンク	2,600	3,015.00	7,839,000	貸付株式数	1,000株
ＩＢＪ	4,400	980.00	4,312,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,500	1,601.00	5,603,500	貸付株式数	1,000株
バリューＨＲ	6,300	1,675.00	10,552,500	貸付株式数	2,100株
M&Aキャピタルパートナー	6,600	4,855.00	32,043,000	貸付株式数	2,600株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,600	1,123.00	2,919,800	貸付株式数	1,100株
ＥＲＩホールディングス	2,000	1,080.00	2,160,000	貸付株式数	800株
アビスト	1,100	2,939.00	3,232,900	貸付株式数	400株
シグマクシス・ホールディンク	10,800	1,334.00	14,407,200		
ウィルグループ	6,000	1,360.00	8,160,000		
エスクローＡＪ	7,600	156.00	1,185,600	貸付株式数	300株
メドピア	5,600	1,649.00	9,234,400	貸付株式数	2,200株
レアジョブ	1,400	969.00	1,356,600	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	529,500	4,329.00	2,292,205,500		
エラン	9,500	1,025.00	9,737,500		
ツ　ガ　ミ	15,300	1,184.00	18,115,200		
オークマ	6,800	5,210.00	35,428,000		
芝浦機械	7,700	2,742.00	21,113,400		
アマダ	111,200	1,098.00	122,097,600		
アイダエンジニア	13,900	835.00	11,606,500	貸付株式数	5,700株
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	1,400	1,106.00	1,548,400	貸付株式数	400株
ＦＵＪＩ	30,200	2,074.00	62,634,800		
牧野フライス	7,700	4,615.00	35,535,500	貸付株式数	3,000株

オーエスジー	33,300	1,936.00	64,468,800		
ダイジェット	400	856.00	342,400	貸付株式数	100株
旭ダイヤモンド	20,000	720.00	14,400,000		
ＤＭＧ森精機	42,300	1,831.00	77,451,300		
ソディツク	18,500	763.00	14,115,500		
ディスコ	11,300	40,600.00	458,780,000		
日東工器	3,700	1,526.00	5,646,200		
日進工具	5,600	1,127.00	6,311,200	貸付株式数	200株
パンチ工業	5,300	421.00	2,231,300		
冨士ダイス	2,300	610.00	1,403,000	貸付株式数	800株
土木管理総合試験	2,800	312.00	873,600	貸付株式数	100株
ネットマーケティング	1,700	897.00	1,524,900		
日本郵政	938,100	1,078.00	1,011,271,800		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	9,600	1,348.00	12,940,800	貸付株式数	4,200株
鎌倉新書	8,100	840.00	6,804,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
ＳＭＮ	1,700	476.00	809,200	貸付株式数	600株
一蔵	900	456.00	410,400	貸付株式数	400株
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,100	587.00	645,700		
エアトリ	4,600	2,673.00	12,295,800	貸付株式数	1,800株
アトラエ	5,600	1,477.00	8,271,200		
ストライク	3,500	4,465.00	15,627,500		
ソラスト	19,700	821.00	16,173,700		
セラク	2,500	1,239.00	3,097,500	貸付株式数	900株
インソース	8,900	3,375.00	30,037,500		
豊田自動織機	50,800	7,810.00	396,748,000		
豊和工業	3,800	881.00	3,347,800	貸付株式数	1,200株
ニデックオーケーケー	2,800	968.00	2,710,400	貸付株式数	1,100株
石川製作所	1,700	1,451.00	2,466,700	貸付株式数	800株
東洋機械金属	4,400	543.00	2,389,200	貸付株式数	700株
津田駒工業	1,000	593.00	593,000	貸付株式数	500株
エンシュウ	1,300	717.00	932,100	貸付株式数	600株
島精機製作所	11,000	2,092.00	23,012,000		
オプトラン	10,400	2,547.00	26,488,800		
ＮＣホールディングス	1,500	2,096.00	3,144,000		
イワキポンプ	4,500	1,307.00	5,881,500		
フリュー	7,300	1,155.00	8,431,500	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	17,800	482.00	8,579,600	貸付株式数	4,900株 (4,700株)

日阪製作所	6,300	818.00	5,153,400		
やまびこ	11,400	1,134.00	12,927,600		
野村マイクロ・サイエンス	2,400	4,705.00	11,292,000		
平田機工	3,300	5,470.00	18,051,000		
ペガサスミシン製造	7,700	967.00	7,445,900		
マルマエ	3,400	1,901.00	6,463,400	貸付株式数	1,300株 (900株)
タツモ	3,800	1,766.00	6,710,800	貸付株式数	1,200株
ナブテスコ	44,000	3,410.00	150,040,000	貸付株式数	15,100株
三井海洋開発	8,700	1,529.00	13,302,300		
レオン自動機	7,300	1,170.00	8,541,000	貸付株式数	400株
ＳＭＣ	22,800	61,760.00	1,408,128,000		
ホソカワミクロン	5,200	2,944.00	15,308,800		
ユニオンツール	2,900	3,510.00	10,179,000		
オイレス工業	11,200	1,494.00	16,732,800	貸付株式数	3,900株
日精エーエスビー	3,100	4,210.00	13,051,000	貸付株式数	1,200株
サト－ホールディングス	9,900	1,954.00	19,344,600		
技研製作所	7,300	3,285.00	23,980,500		
日本エアーテック	3,300	1,172.00	3,867,600	貸付株式数	1,200株
カ　ワ　タ	1,900	850.00	1,615,000		
日精樹脂工業	4,800	957.00	4,593,600		
オカダアイヨン	2,100	1,547.00	3,248,700	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	3,000	1,466.00	4,398,000	貸付株式数	1,100株
小松製作所	329,100	3,179.00	1,046,208,900		
住友重機械	41,400	2,912.00	120,556,800		
日立建機	27,900	3,210.00	89,559,000		
日　工	10,100	620.00	6,262,000		
巴工業	3,400	2,418.00	8,221,200	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,500	1,277.00	8,300,500		
ＴＯＷＡ	7,200	1,969.00	14,176,800	貸付株式数	2,500株
丸山製作所	1,000	1,610.00	1,610,000	貸付株式数	400株
北川鉄工所	2,800	1,187.00	3,323,600		
シンニッタン	12,700	223.00	2,832,100		
ローツェ	3,700	8,390.00	31,043,000	貸付株式数	1,400株
タカキタ	1,900	469.00	891,100	貸付株式数	1,000株 (100株)
クボタ	371,700	2,030.00	754,551,000		
荏原実業	3,400	2,267.00	7,707,800		
東洋エンジニア	8,900	582.00	5,179,800		

三菱化工機	2,100	2,116.00	4,443,600		
月島機械	9,300	981.00	9,123,300	貸付株式数	4,000株
帝国電機製作所	5,100	2,367.00	12,071,700		
東京機械	1,600	615.00	984,000		
新東工業	13,200	670.00	8,844,000	貸付株式数	500株
渋谷工業	6,500	2,478.00	16,107,000		
アイチ　コーポレーション	9,700	800.00	7,760,000	貸付株式数	100株
小森コーポレーション	15,800	814.00	12,861,200	貸付株式数	3,200株
鶴見製作所	5,200	1,996.00	10,379,200		
住友精密	1,000	3,640.00	3,640,000		
日本ギア工業	4,000	326.00	1,304,000	貸付株式数	900株
酒井重工業	1,100	3,525.00	3,877,500		
荏原製作所	28,700	5,260.00	150,962,000	貸付株式数	11,100株
石井鉄工所	700	2,573.00	1,801,100	貸付株式数	300株
酉島製作所	5,900	1,550.00	9,145,000		
北越工業	7,000	1,153.00	8,071,000		
ダイキン工業	83,900	22,405.00	1,879,779,500		
オルガノ	9,600	2,818.00	27,052,800		
トーヨーカネツ	2,700	2,487.00	6,714,900		
栗田工業	39,300	6,100.00	239,730,000		
椿本チエイン	10,300	3,145.00	32,393,500		
大同工業	2,500	770.00	1,925,000		
日　機　装	17,400	1,001.00	17,417,400		
木村化工機	5,300	700.00	3,710,000	貸付株式数	2,300株
レイズネクスト	9,600	1,255.00	12,048,000		
アネスト岩田	11,500	944.00	10,856,000	貸付株式数	100株
ダイフク	36,200	7,040.00	254,848,000		
サムコ	2,300	3,865.00	8,889,500	貸付株式数	800株
加藤製作所	3,300	804.00	2,653,200		
油研工業	700	1,824.00	1,276,800		
タダノ	36,900	980.00	36,162,000		
フジテック	25,700	3,010.00	77,357,000		
ＣＫＤ	19,900	2,043.00	40,655,700		
平和	23,400	2,445.00	57,213,000		
理想科学工業	6,200	2,378.00	14,743,600	貸付株式数	2,400株
ＳＡＮＫＹＯ	13,800	5,360.00	73,968,000		
日本金銭機械	7,700	1,014.00	7,807,800	貸付株式数	3,000株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,100	2,050.00	8,405,000		
フクシマガリレイ	5,100	4,350.00	22,185,000		
オーイズミ	2,700	416.00	1,123,200	貸付株式数	100株

ダイコク電機	3,800	1,606.00	6,102,800	貸付株式数 1,000株
竹内製作所	12,700	3,175.00	40,322,500	
ア　マ　ノ	19,900	2,475.00	49,252,500	
ＪＵＫＩ	10,700	671.00	7,179,700	貸付株式数 200株
サンデン	10,200	227.00	2,315,400	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	7,000	620.00	4,340,000	貸付株式数 2,700株
ブラザー工業	93,700	2,214.00	207,451,800	
マックス	8,500	2,059.00	17,501,500	
モリタホールディングス	12,000	1,266.00	15,192,000	
グローリー	18,100	2,304.00	41,702,400	
新晃工業	7,000	1,548.00	10,836,000	
大和冷機工業	10,600	1,225.00	12,985,000	
セガサミーホールディングス	56,500	1,823.00	102,999,500	
日本ピストンリング	2,200	1,208.00	2,657,600	
リ　ケ　ン	2,700	2,277.00	6,147,900	
ＴＰＲ	8,000	1,232.00	9,856,000	
ツバキ・ナカシマ	17,300	1,035.00	17,905,500	
ホシザキ	45,200	4,635.00	209,502,000	
大豊工業	5,900	699.00	4,124,100	貸付株式数 2,300株
日本精工	129,400	760.00	98,344,000	
Ｎ　Ｔ　Ｎ	142,200	290.00	41,238,000	
ジェイテクト	63,300	1,010.00	63,933,000	
不　二　越	5,300	3,870.00	20,511,000	
ミネベアミツミ	122,100	2,243.00	273,870,300	
日本トムソン	18,400	609.00	11,205,600	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	40,900	2,669.00	109,162,100	
ユーシン精機	4,600	688.00	3,164,800	
前澤給装工業	5,000	933.00	4,665,000	貸付株式数 200株
イーグル工業	7,800	1,109.00	8,650,200	
前澤工業	4,700	612.00	2,876,400	
日本ピラー工業	6,700	2,765.00	18,525,500	
キッツ	27,300	844.00	23,041,200	
日　立	352,800	7,299.00	2,575,087,200	
東　芝	135,200	4,690.00	634,088,000	
三菱電機	725,900	1,377.50	999,927,250	
富士電機	42,700	5,620.00	239,974,000	
東洋電機製造	2,300	873.00	2,007,900	
安川電機	83,100	4,445.00	369,379,500	

シンフォニア　テクノロジー	7,600	1,507.00	11,453,200	貸付株式数	100株
明　電　舎	10,600	1,987.00	21,062,200		
オリジン	1,600	1,316.00	2,105,600	貸付株式数	700株
山洋電気	3,000	6,200.00	18,600,000		
デンヨー	5,200	1,500.00	7,800,000		
ＰＨＣホールディングス	9,800	1,595.00	15,631,000		
ベイカレントコンサルティング	54,300	4,465.00	242,449,500	貸付株式数	2,100株
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,500	2,305.00	3,457,500	貸付株式数	400株
アイモバイル	3,700	1,266.00	4,684,200	貸付株式数	1,400株
キャリアインデックス	2,400	350.00	840,000	貸付株式数	800株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,300	1,074.00	2,470,200	貸付株式数	1,000株
船場	1,600	767.00	1,227,200	貸付株式数	100株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	25,400	1,742.00	44,246,800		
フルテック	1,000	1,209.00	1,209,000	貸付株式数	400株
グリーンズ	2,700	1,121.00	3,026,700	貸付株式数	1,000株
ツナググループＨＬＤＧＳ	2,100	531.00	1,115,100	貸付株式数	800株
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	2,000	408.00	816,000	貸付株式数	800株
ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	800	625.00	500,000	貸付株式数	300株
ウェルビー	5,300	861.00	4,563,300	貸付株式数	1,900株
エル・ティー・エス	900	3,495.00	3,145,500	貸付株式数	300株
ミダックホールディングス	4,300	3,370.00	14,491,000	貸付株式数	1,700株
日総工産	5,400	598.00	3,229,200	貸付株式数	2,200株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,700	1,493.00	5,524,100		
ＲＰＡホールディングス	9,700	287.00	2,783,900	貸付株式数	4,000株
三桜工業	10,500	669.00	7,024,500		
マキタ	87,300	3,130.00	273,249,000		
東芝テック	10,500	3,695.00	38,797,500		
芝浦メカトロニクス	1,300	10,980.00	14,274,000		
マブチモーター	17,400	4,130.00	71,862,000		
日本電産	170,600	8,534.00	1,455,900,400		
ユーエムシーエレクトロニクス	5,000	505.00	2,525,000		
トレックス・セミコンダクター	3,300	2,926.00	9,655,800	貸付株式数	1,300株

東光高岳	4,200	1,847.00	7,757,400	貸付株式数	200株
ダブル・スコープ	22,900	1,868.00	42,777,200	貸付株式数	9,100株 (100株)
宮越ホールディングス	3,100	884.00	2,740,400	貸付株式数	1,200株
ダイヘン	6,300	4,080.00	25,704,000		
ヤーマン	13,700	1,306.00	17,892,200	貸付株式数	5,400株
ＪＶＣケンウッド	64,100	370.00	23,717,000		
ミマキエンジニアリング	6,600	654.00	4,316,400		
Ｉ－ＰＥＸ	3,800	1,309.00	4,974,200	貸付株式数	1,000株
日新電機	16,600	1,341.00	22,260,600		
大崎電気	16,300	533.00	8,687,900	貸付株式数	100株
オムロン	64,500	7,044.00	454,338,000		
日東工業	9,500	2,331.00	22,144,500	貸付株式数	100株
ＩＤＥＣ	10,500	3,265.00	34,282,500	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,600	1,022.00	2,657,200	貸付株式数	1,000株
不二電機工業	1,100	1,133.00	1,246,300	貸付株式数	600株 (100株)
ジーエス・ユアサ　コーポ	23,000	2,161.00	49,703,000		
サクサホールディングス	1,400	1,370.00	1,918,000	貸付株式数	700株
メルコホールディングス	1,800	3,110.00	5,598,000	貸付株式数	700株
テクノメディカ	2,100	1,732.00	3,637,200	貸付株式数	600株
ダイヤモンドエレクトリクHD	2,100	1,497.00	3,143,700	貸付株式数	800株
日本電気	99,300	4,855.00	482,101,500		
富　士　通	70,000	18,465.00	1,292,550,000		
沖　電　気	31,700	728.00	23,077,600		
岩崎通信機	3,100	783.00	2,427,300	貸付株式数	1,000株
電気興業	3,200	2,100.00	6,720,000	貸付株式数	200株
サンケン電気	6,500	6,630.00	43,095,000		
ナカヨ	1,000	1,100.00	1,100,000	貸付株式数	400株
アイホン	4,300	1,917.00	8,243,100	貸付株式数	1,400株
ルネサスエレクトロニクス	458,200	1,316.00	602,991,200		
セイコーエプソン	93,500	2,152.00	201,212,000		
ワコム	55,600	648.00	36,028,800	貸付株式数	22,200株
アルバック	16,600	5,930.00	98,438,000		
アクセル	2,600	1,507.00	3,918,200	貸付株式数	1,100株
ＥＩＺＯ	5,100	3,595.00	18,334,500		
ジャパンディスプレイ	61,700	49.00	3,023,300		
日本信号	15,800	1,033.00	16,321,400	貸付株式数	200株
京三製作所	14,200	414.00	5,878,800		

能美防災	9,400	1,590.00	14,946,000	貸付株式数	100株
ホーチキ	5,100	1,445.00	7,369,500		
星和電機	2,900	451.00	1,307,900		
エレコム	16,700	1,452.00	24,248,400		
パナソニック　ホールディンク	829,800	1,274.00	1,057,165,200		
シャープ	84,600	973.00	82,315,800	貸付株式数	33,300株
アンリツ	49,700	1,466.00	72,860,200		
富士通ゼネラル	19,900	3,235.00	64,376,500		
ソニーグループ ※	492,200	11,255.00	5,539,711,000		
Ｔ　Ｄ　Ｋ	111,200	4,880.00	542,656,000		
帝国通信工業	3,100	1,403.00	4,349,300	貸付株式数	300株
タムラ製作所	30,100	816.00	24,561,600	貸付株式数	11,300株
アルプスアルパイン	62,600	1,302.00	81,505,200		
池上通信機	2,100	549.00	1,152,900	貸付株式数	800株
日本電波工業	8,400	1,745.00	14,658,000	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,900	919.00	3,584,100		
メイコー	7,600	3,005.00	22,838,000	貸付株式数	3,300株
日本トリム	1,500	2,462.00	3,693,000		
ローランド　ディー.ジー.	3,900	3,085.00	12,031,500		
フオスター電機	6,400	961.00	6,150,400		
Ｓ　Ｍ　Ｋ	1,600	2,639.00	4,222,400	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,500	2,414.00	13,277,000	貸付株式数	2,100株
ティアック	10,800	119.00	1,285,200	貸付株式数	4,000株
ホシデン	16,800	1,626.00	27,316,800		
ヒロセ電機	11,600	18,200.00	211,120,000		
日本航空電子	14,300	2,347.00	33,562,100	貸付株式数	5,500株
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,900	766.00	6,051,400	貸付株式数	100株
マクセル	15,100	1,410.00	21,291,000		
古野電気	9,100	1,020.00	9,282,000		
スミダコーポレーション	6,300	1,462.00	9,210,600		
アイコム	2,600	2,785.00	7,241,000	貸付株式数	1,000株
リオン	2,900	2,050.00	5,945,000		
横河電機	77,100	2,566.00	197,838,600		
新電元工業	2,700	3,335.00	9,004,500		
アズビル	48,500	4,175.00	202,487,500		
東亜ディーケーケー	3,800	849.00	3,226,200	貸付株式数	1,500株
日本光電工業	32,300	3,195.00	103,198,500		
チ　ノ　ー	3,100	1,840.00	5,704,000	貸付株式数	700株

共和電業	8,400	359.00	3,015,600		
日本電子材料	4,600	1,542.00	7,093,200	貸付株式数	1,300株
堀場製作所	15,500	6,240.00	96,720,000		
アドバンテスト	54,800	9,130.00	500,324,000		
小野測器	3,800	410.00	1,558,000	貸付株式数	1,000株
エスペック	5,900	2,058.00	12,142,200		
キーエンス ※	69,600	57,140.00	3,976,944,000		
日置電機	3,700	6,820.00	25,234,000	貸付株式数	1,000株
シスメックス	60,000	8,318.00	499,080,000		
日本マイクロニクス	11,400	1,459.00	16,632,600		
メガチップス	5,700	2,645.00	15,076,500		
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,100	3,485.00	10,803,500	貸付株式数	1,400株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,800	755.00	4,379,000		
澤藤電機	800	1,278.00	1,022,400	貸付株式数	300株
デンソー	143,500	7,514.00	1,078,259,000		
原田工業	2,900	824.00	2,389,600	貸付株式数	1,200株 (1,000株)
コーセル	8,900	851.00	7,573,900		
イリソ電子工業	6,400	4,760.00	30,464,000	貸付株式数	1,200株
オプテックスグループ	12,700	2,146.00	27,254,200		
千代田インテグレ	2,700	2,407.00	6,498,900		
レーザーテック	34,300	25,135.00	862,130,500		
スタンレー電気	49,400	2,793.00	137,974,200		
岩崎電気	2,200	2,546.00	5,601,200		
ウシオ電機	36,100	1,782.00	64,330,200		
岡谷電機	4,800	280.00	1,344,000	貸付株式数	2,100株
ヘリオステクノＨ	6,300	446.00	2,809,800	貸付株式数	2,500株
エノモト	1,700	1,942.00	3,301,400	貸付株式数	600株
日本セラミック	7,000	2,647.00	18,529,000		
遠藤照明	2,900	747.00	2,166,300		
古河電池	5,000	1,123.00	5,615,000	貸付株式数	2,200株
双信電機	2,600	425.00	1,105,000	貸付株式数	1,400株
山一電機	5,900	1,845.00	10,885,500		
図　研	6,000	3,290.00	19,740,000	貸付株式数	1,700株
日本電子	17,500	4,560.00	79,800,000		
カ　シ　オ	51,800	1,340.00	69,412,000		
ファナック	68,300	20,365.00	1,390,929,500		
日本シイエムケイ	14,600	578.00	8,438,800	貸付株式数	1,200株
エンプラス	2,000	4,470.00	8,940,000		

大真空	8,400	839.00	7,047,600	貸付株式数	3,300株 (100株)
ローム	32,100	10,850.00	348,285,000		
浜松ホトニクス	55,800	7,160.00	399,528,000		
三井ハイテック	7,200	7,960.00	57,312,000	貸付株式数	2,800株
新光電気工業	24,600	3,805.00	93,603,000	貸付株式数	9,200株
京セラ	108,000	6,981.00	753,948,000		
協栄産業	700	1,788.00	1,251,600		
太陽誘電	33,800	4,365.00	147,537,000		
村田製作所	210,900	7,464.00	1,574,157,600		
双葉電子工業	12,600	592.00	7,459,200	貸付株式数	300株
日東電工	50,700	8,610.00	436,527,000		
北陸電気工業	2,400	1,290.00	3,096,000		
東海理化電機	19,400	1,552.00	30,108,800		
ニチコン	14,100	1,414.00	19,937,400	貸付株式数	5,600株
日本ケミコン	6,800	1,841.00	12,518,800		
ＫＯＡ	10,500	2,199.00	23,089,500	貸付株式数	3,800株
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	413.00	8,962,100		
日立造船	57,300	896.00	51,340,800		
三菱重工業	122,900	5,457.00	670,665,300		
川崎重工業	52,400	2,926.00	153,322,400		
ＩＨＩ	44,200	3,760.00	166,192,000		
名村造船所	17,800	487.00	8,668,600	貸付株式数	7,100株
サノヤスホールディングス	8,400	127.00	1,066,800	貸付株式数	3,800株
スプリックス	2,400	993.00	2,383,200	貸付株式数	100株
マネジメントソリューションズ	3,900	3,825.00	14,917,500	貸付株式数	1,500株
プロレド・パートナーズ	1,800	578.00	1,040,400	貸付株式数	600株
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	2,100	376.00	789,600	貸付株式数	700株
テノ．ホールディングス	900	552.00	496,800	貸付株式数	300株
フロンティア・マネジメント	2,400	1,405.00	3,372,000		
ピアラ	1,200	694.00	832,800	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	1,200	979.00	1,174,800	貸付株式数	400株
ギークス	1,000	878.00	878,000	貸付株式数	500株
カーブスホールディングス	22,000	982.00	21,604,000	貸付株式数	7,900株
フォーラムエンジニアリング	4,100	870.00	3,567,000		
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰ	2,400	1,335.00	3,204,000	貸付株式数	500株

日本車輌	2,600	1,965.00	5,109,000		
三菱ロジスネクスト	11,100	894.00	9,923,400	貸付株式数	4,200株
近畿車輌	800	1,064.00	851,200		
一家ホールディングス	1,700	625.00	1,062,500	貸付株式数	600株
フルサト・マルカＨＤ	7,300	3,970.00	28,981,000	貸付株式数	2,900株
ヤマエグループＨＤ	4,200	1,433.00	6,018,600		
ジャパンクラフトホールディ	2,400	652.00	1,564,800	貸付株式数	900株
ＦＰＧ	27,900	1,165.00	32,503,500	貸付株式数	2,900株
島根銀行	1,700	462.00	785,400	貸付株式数	800株
じもとホールディングス	4,000	414.00	1,656,000		
全国保証	17,900	5,100.00	91,290,000	貸付株式数	7,200株
めぶきフィナンシャルＧ	337,500	312.00	105,300,000		
ジャパンインベストメントＡ	5,600	1,227.00	6,871,200	貸付株式数	2,300株
東京きらぼしＦＧ	8,700	2,387.00	20,766,900		
九州フィナンシャルＧ	119,500	397.00	47,441,500		
かんぽ生命保険	83,500	2,287.00	190,964,500		
ゆうちょ銀行	194,500	1,051.00	204,419,500	貸付株式数	77,800株
あんしん保証	3,400	257.00	873,800	貸付株式数	1,300株
富山第一銀行	16,400	568.00	9,315,200	貸付株式数	6,500株
コンコルディア・フィナンシャル	375,900	477.00	179,304,300		
ジェイリース	2,300	3,105.00	7,141,500		
西日本フィナンシャルＨＤ	42,700	874.00	37,319,800		
イントラスト	2,700	766.00	2,068,200		
日本モーゲージサービス	3,900	860.00	3,354,000	貸付株式数	1,600株
Ｃａｓａ	2,700	861.00	2,324,700	貸付株式数	900株
アルヒ	5,300	1,007.00	5,337,100		
プレミアグループ	11,500	1,925.00	22,137,500		
日産自動車	987,900	491.20	485,256,480		
いすゞ自動車	202,100	1,794.00	362,567,400		
トヨタ自動車	3,820,100	2,010.50	7,680,311,050		
日野自動車	89,500	620.00	55,490,000		
三菱自動車工業	271,300	636.00	172,546,800		
エフテック	4,600	533.00	2,451,800		
レシップホールディングス	2,400	490.00	1,176,000	貸付株式数	1,100株
ＧＭＢ	1,300	762.00	990,600	貸付株式数	500株
ファルテック	1,100	610.00	671,000	貸付株式数	200株
武蔵精密工業	16,900	1,768.00	29,879,200		

日産車体	12,200	832.00	10,150,400	貸付株式数	4,800株
新明和工業	21,600	1,013.00	21,880,800		
極東開発工業	12,100	1,363.00	16,492,300		
トピー工業	5,600	1,730.00	9,688,000		
ティラド	1,800	2,648.00	4,766,400		
タチエス	10,900	1,096.00	11,946,400		
ＮＯＫ	26,800	1,264.00	33,875,200		
フタバ産業	18,300	375.00	6,862,500		
ＫＹＢ	6,600	3,625.00	23,925,000		
市光工業	9,600	426.00	4,089,600		
大同メタル工業	13,500	495.00	6,682,500		
プレス工業	31,000	451.00	13,981,000		
ミクニ	8,000	340.00	2,720,000	貸付株式数	3,100株
太平洋工業	15,800	1,079.00	17,048,200		
河西工業	9,200	166.00	1,527,200	貸付株式数	1,200株
アイシン	53,600	3,765.00	201,804,000		
マツダ	230,000	1,091.00	250,930,000		
今仙電機製作所	4,300	649.00	2,790,700	貸付株式数	1,700株
本田技研 ※	565,400	3,356.00	1,897,482,400		
スズキ	127,700	4,913.00	627,390,100		
ＳＵＢＡＲＵ	220,000	2,351.50	517,330,000		
安永	2,800	722.00	2,021,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	109,300	3,415.00	373,259,500		
小糸製作所	83,500	2,165.00	180,777,500		
ＴＢＫ	5,900	261.00	1,539,900		
エクセディ	11,200	1,668.00	18,681,600		
ミツバ	12,900	533.00	6,875,700		
豊田合成	20,200	2,282.00	46,096,400		
愛三工業	11,300	702.00	7,932,600		
盟和産業	900	929.00	836,100		
日本プラスト	5,100	427.00	2,177,700	貸付株式数	500株
ヨロズ	6,200	805.00	4,991,000	貸付株式数	200株
エフ・シー・シー	12,100	1,425.00	17,242,500	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,600	2,312.00	3,699,200		
シマノ	28,500	23,380.00	666,330,000		
テイ・エス　テック	31,700	1,607.00	50,941,900		
３３ＦＧ	5,700	1,500.00	8,550,000		
第四北越フィナンシャルＧ	10,800	2,618.00	28,274,400		
ひろぎんＨＬＤＧＳ	88,100	632.00	55,679,200		

マーキュリアホールディングス	4,100	613.00	2,513,300	貸付株式数	800株
おきなわＦＧ	6,400	2,144.00	13,721,600		
ダイレクトマケティングミクス	8,100	1,495.00	12,109,500	貸付株式数	3,000株
ポピンズ	1,000	1,700.00	1,700,000	貸付株式数	600株
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,600	2,338.00	13,092,800		
十六ＦＧ	8,700	2,640.00	22,968,000		
北國ＦＨＤ	5,800	4,455.00	25,839,000	貸付株式数	1,000株
ネットプロＨＤ	22,700	476.00	10,805,200	貸付株式数	9,100株
プロクレアホールディングス	8,300	2,159.00	17,919,700		
あいちフィナンシャルグル	9,200	2,215.00	20,378,000		
ジャムコ	3,800	1,611.00	6,121,800	貸付株式数	1,800株
小　野　建	6,700	1,444.00	9,674,800		
はるやまＨＬＤＧＳ	3,300	436.00	1,438,800	貸付株式数	1,200株
南　陽	1,100	1,843.00	2,027,300	貸付株式数	500株
ノ　ジ　マ	24,000	1,395.00	33,480,000		
佐鳥電機	4,600	1,348.00	6,200,800		
カッパ・クリエイト	11,700	1,378.00	16,122,600	貸付株式数	4,500株
エコートレーディング	1,500	642.00	963,000	貸付株式数	500株
伯東	4,200	3,735.00	15,687,000		
コンドーテック	5,600	1,004.00	5,622,400	貸付株式数	2,000株
中山福	3,700	330.00	1,221,000	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,600	636.00	3,561,600	貸付株式数	2,200株
ナガイレーベン	9,100	2,007.00	18,263,700		
三菱食品	6,800	3,250.00	22,100,000		
良品計画	95,000	1,449.00	137,655,000		
パリミキホールディングス	9,600	264.00	2,534,400	貸付株式数	3,600株
松田産業	5,600	2,303.00	12,896,800		
第一興商	14,200	4,090.00	58,078,000		
メディパルＨＤ	76,400	1,830.00	139,812,000		
アドヴァングループ	7,000	890.00	6,230,000	貸付株式数	2,200株
ＳＰＫ	3,100	1,391.00	4,312,100		
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,800	2,517.00	7,047,600		
アルビス	2,500	2,384.00	5,960,000	貸付株式数	800株
アズワン	10,800	6,110.00	65,988,000		
スズデン	2,500	2,293.00	5,732,500		
尾家産業	1,800	926.00	1,666,800	貸付株式数	600株
シモジマ	5,000	961.00	4,805,000	貸付株式数	1,600株

ドウシシャ	7,700	1,524.00	11,734,800		
小津産業	1,500	1,469.00	2,203,500	貸付株式数	600株 (100株)
コナカ	8,400	335.00	2,814,000		
高速	3,700	1,768.00	6,541,600		
ハウス　ローゼ	900	1,617.00	1,455,300	貸付株式数	300株
Ｇ－７ホールディングス	9,200	1,523.00	14,011,600		
たけびし	2,700	1,508.00	4,071,600	貸付株式数	1,000株
イオン北海道	10,600	1,178.00	12,486,800	貸付株式数	4,600株
コ　ジ　マ	14,400	614.00	8,841,600	貸付株式数	5,600株
ヒマラヤ	2,300	917.00	2,109,100	貸付株式数	900株
コーナン商事	9,900	3,310.00	32,769,000	貸付株式数	4,300株
ネットワンシステムズ	26,000	3,400.00	88,400,000		
エコス	2,600	1,833.00	4,765,800	貸付株式数	1,000株
ワタミ	8,900	1,059.00	9,425,100	貸付株式数	2,500株
マルシェ	2,500	404.00	1,010,000	貸付株式数	900株
リックス	1,900	2,206.00	4,191,400	貸付株式数	600株
システムソフト	24,300	99.00	2,405,700	貸付株式数	9,600株
パンパシフィックＨＤ	165,000	2,384.00	393,360,000		
丸文	6,700	910.00	6,097,000		
西松屋チェーン	16,300	1,395.00	22,738,500	貸付株式数	6,500株
ゼンショーホールディングス	40,300	3,465.00	139,639,500	貸付株式数	13,500株
ハピネット	6,300	1,941.00	12,228,300		
幸楽苑ホールディングス	4,900	1,030.00	5,047,000	貸付株式数	1,900株
ハークスレイ	2,700	659.00	1,779,300	貸付株式数	1,000株
橋本総業ＨＬＤＧＳ	3,000	992.00	2,976,000	貸付株式数	200株
日本ライフライン	22,000	947.00	20,834,000	貸付株式数	200株
サイゼリヤ	12,200	2,813.00	34,318,600	貸付株式数	3,700株
タカショー	6,300	704.00	4,435,200	貸付株式数	2,500株
ＶＴホールディングス	27,700	508.00	14,071,600		
アルゴグラフィックス	6,400	3,800.00	24,320,000		
魚力	2,300	2,152.00	4,949,600	貸付株式数	800株
ＩＤＯＭ	22,200	748.00	16,605,600	貸付株式数	3,300株
日本エム・ディ・エム	4,300	1,036.00	4,454,800		
ポプラ	900	150.00	135,000	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	4,100	1,288.00	5,280,800	貸付株式数	1,400株
ユナイテッドアローズ	7,900	1,885.00	14,891,500	貸付株式数	2,800株
進和	4,700	2,058.00	9,672,600	貸付株式数	1,700株
エスケイジャパン	1,800	535.00	963,000		

ダイトロン	2,800	2,446.00	6,848,800		
ハイデイ日高	10,900	1,958.00	21,342,200	貸付株式数	3,100株
シークス	10,400	1,399.00	14,549,600		
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　Ｈ	4,600	210.00	966,000	貸付株式数	500株
コロワイド	34,000	1,789.00	60,826,000	貸付株式数	13,500株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	8,200	295.00	2,419,000	貸付株式数	3,100株
田中商事	2,100	564.00	1,184,400	貸付株式数	500株
オーハシテクニカ	3,500	1,399.00	4,896,500	貸付株式数	1,400株
壱番屋	5,800	4,555.00	26,419,000	貸付株式数	2,300株
白銅	2,600	2,493.00	6,481,800	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	2,800	205.00	574,000	貸付株式数	1,000株
ＰＬＡＮＴ	1,200	632.00	758,400	貸付株式数	100株
スギホールディングス	14,700	6,190.00	90,993,000		
ダイコー通産	700	1,148.00	803,600	貸付株式数	200株
薬王堂ホールディングス	4,100	2,580.00	10,578,000	貸付株式数	1,500株
島津製作所	84,800	4,180.00	354,464,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	7,200	511.00	3,679,200		
クボテック	2,400	230.00	552,000	貸付株式数	600株
長野計器	5,300	1,155.00	6,121,500		
ブイ・テクノロジー	3,600	2,693.00	9,694,800		
スター精密	13,200	1,755.00	23,166,000		
東京計器	5,600	1,177.00	6,591,200	貸付株式数	2,100株
愛知時計	2,700	1,369.00	3,696,300		
インターアクション	4,100	1,583.00	6,490,300	貸付株式数	1,500株 (100株)
オーバル	6,300	502.00	3,162,600	貸付株式数	2,900株
東京精密	15,300	4,340.00	66,402,000		
マニー	30,700	2,260.00	69,382,000	貸付株式数	10,500株
ニコン	108,200	1,334.00	144,338,800		
トプコン	36,800	1,647.00	60,609,600		
オリンパス	435,000	2,806.00	1,220,610,000		
理研計器	4,400	5,000.00	22,000,000	貸付株式数	2,100株
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,900	9,030.00	107,457,000		
キヤノン電子	7,500	1,580.00	11,850,000		
タムロン	5,300	3,465.00	18,364,500		
ＨＯＹＡ	150,300	14,060.00	2,113,218,000		
シ　ー　ド	4,300	502.00	2,158,600	貸付株式数	600株

ノーリツ鋼機	6,700	2,634.00	17,647,800		
A＆Dホロンホールディングス	10,400	1,043.00	10,847,200		
朝日インテック	92,000	2,414.00	222,088,000		
キヤノン	381,700	3,212.00	1,226,020,400		
リ　コ　ー	182,400	1,086.00	198,086,400		
シチズン時計	76,200	600.00	45,720,000		
リズム	2,100	1,764.00	3,704,400		
大研医器	6,700	456.00	3,055,200	貸付株式数	2,100株
メニコン	23,800	2,905.00	69,139,000		
シンシア	700	553.00	387,100	貸付株式数	200株
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	10,100	123.00	1,242,300		
中本パックス	2,100	1,567.00	3,290,700	貸付株式数	700株
スノーピーク	11,900	2,265.00	26,953,500	貸付株式数	4,700株 (100株)
パラマウントベッドＨＤ	16,300	2,681.00	43,700,300	貸付株式数	6,000株
トランザクション	5,300	1,286.00	6,815,800	貸付株式数	2,000株
粧美堂	2,000	358.00	716,000	貸付株式数	700株
ニホンフラッシュ	6,500	965.00	6,272,500	貸付株式数	900株
前田工繊	7,700	3,245.00	24,986,500	貸付株式数	2,800株
永大産業	7,600	226.00	1,717,600		
アートネイチャー	7,100	777.00	5,516,700	貸付株式数	300株
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	63,500	9,045.00	574,357,500		
アイフィスジャパン	2,000	628.00	1,256,000	貸付株式数	700株
ＳＨＯＥＩ	7,300	5,540.00	40,442,000		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	8,300	932.00	7,735,600	貸付株式数	3,400株
マーベラス	11,300	679.00	7,672,700		
パイロットコーポレーション	10,900	4,950.00	53,955,000		
萩原工業	4,300	1,063.00	4,570,900	貸付株式数	1,700株
エイベックス	11,900	1,529.00	18,195,100	貸付株式数	4,500株
フジシールインターナショナル	14,000	1,869.00	26,166,000	貸付株式数	4,500株
タカラトミー	32,000	1,256.00	40,192,000	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,700	1,945.00	9,141,500		
エステールホールディングス	1,600	630.00	1,008,000	貸付株式数	700株
レック	9,900	813.00	8,048,700		
タカノ	2,600	676.00	1,757,600	貸付株式数	1,000株
三光合成	10,100	459.00	4,635,900	貸付株式数	500株

プロネクサス	5,700	966.00	5,506,200	貸付株式数	2,300株
ホクシン	5,400	154.00	831,600	貸付株式数	2,100株
ウッドワン	2,300	932.00	2,143,600	貸付株式数	600株
大建工業	4,200	2,138.00	8,979,600		
き　も　と	10,200	238.00	2,427,600		
凸版印刷	90,900	2,132.00	193,798,800		
大日本印刷	82,500	2,841.00	234,382,500		
共同印刷	2,000	2,904.00	5,808,000	貸付株式数	700株
ＮＩＳＳＨＡ	13,200	1,759.00	23,218,800	貸付株式数	5,000株
光村印刷	600	1,172.00	703,200	貸付株式数	200株
藤森工業	5,600	3,195.00	17,892,000		
ヴィア・ホールディングス	9,700	116.00	1,125,200	貸付株式数	3,800株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,800	2,089.00	10,027,200	貸付株式数	1,700株
前澤化成工業	4,400	1,385.00	6,094,000	貸付株式数	1,300株
未来工業	2,500	1,488.00	3,720,000		
アシックス	64,200	2,955.00	189,711,000		
ツ　ツ　ミ	1,600	1,957.00	3,131,200	貸付株式数	700株
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	3,200	611.00	1,955,200	貸付株式数	1,200株
ジェイ　エス　ピー	4,800	1,487.00	7,137,600	貸付株式数	1,400株
ニ　チ　ハ	8,700	2,823.00	24,560,100	貸付株式数	100株
ローランド	5,100	4,060.00	20,706,000		
エフピコ	13,200	3,785.00	49,962,000		
小松ウオール工業	2,500	1,840.00	4,600,000		
ヤマハ	43,800	5,410.00	236,958,000		
河合楽器	1,900	2,579.00	4,900,100	貸付株式数	400株
クリナップ	7,800	670.00	5,226,000		
ピジョン	44,300	2,044.00	90,549,200	貸付株式数	300株
天馬	6,300	2,083.00	13,122,900		
兼松サステック	500	1,594.00	797,000	貸付株式数	100株
キングジム	6,100	894.00	5,453,400	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	20,700	1,599.00	33,099,300	貸付株式数	1,700株
リンテック	14,900	2,248.00	33,495,200		
信越ポリマー	12,700	1,247.00	15,836,900		
東　リ	15,800	211.00	3,333,800		
イトーキ	14,100	535.00	7,543,500		
任　天　堂	439,200	5,894.00	2,588,644,800	貸付株式数	175,600株
三菱鉛筆	9,800	1,394.00	13,661,200	貸付株式数	800株
松　風	3,200	2,430.00	7,776,000	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	13,400	1,324.00	17,741,600	貸付株式数	100株

コ　ク　ヨ	33,400	1,807.00	60,353,800		
ナカバヤシ	7,300	501.00	3,657,300	貸付株式数	1,000株
ニ　フ　コ	25,400	3,590.00	91,186,000		
立川ブラインド	3,200	1,142.00	3,654,400	貸付株式数	1,200株
グローブライド	5,600	2,678.00	14,996,800		
オカムラ	20,900	1,415.00	29,573,500		
バルカー	6,400	2,730.00	17,472,000		
ＭＵＴＯＨホールディングス	900	1,720.00	1,548,000	貸付株式数	300株
伊　藤　忠	453,500	4,287.00	1,944,154,500		
丸　紅	581,500	1,548.00	900,162,000		
スクロール	10,900	711.00	7,749,900		
高　島	1,300	2,970.00	3,861,000		
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,732.00	10,738,400	貸付株式数	2,400株
三陽商会	2,600	1,322.00	3,437,200	貸付株式数	700株
長瀬産業	34,900	2,019.00	70,463,100		
ナイガイ	2,300	262.00	602,600	貸付株式数	900株
蝶　理	4,200	1,987.00	8,345,400		
豊田通商	64,500	5,230.00	337,335,000		
オンワ－ドホールディングス	44,900	330.00	14,817,000		
三共生興	10,200	483.00	4,926,600		
兼　松	28,500	1,528.00	43,548,000		
美　津　濃	6,900	2,869.00	19,796,100		
ツカモトコーポレーション	1,000	1,317.00	1,317,000	貸付株式数	400株
ルックホールディングス	2,000	2,497.00	4,994,000	貸付株式数	800株
三井物産	538,600	3,983.00	2,145,243,800		
日本紙パルプ	3,900	5,030.00	19,617,000		
東京エレクトロン	49,100	45,090.00	2,213,919,000		
カメイ	7,800	1,201.00	9,367,800	貸付株式数	100株
東都水産	400	5,070.00	2,028,000	貸付株式数	100株
ＯＵＧホールディングス	1,100	2,410.00	2,651,000	貸付株式数	400株
スターゼン	5,600	2,077.00	11,631,200	貸付株式数	1,900株
セイコーグループ	10,700	3,165.00	33,865,500		
山　善	19,800	1,000.00	19,800,000	貸付株式数	11,600株
椿本興業	1,300	3,995.00	5,193,500	貸付株式数	400株
住友商事	455,900	2,247.00	1,024,407,300		
ＢＩＰＲＯＧＹ	25,700	3,285.00	84,424,500		
内田洋行	3,300	4,640.00	15,312,000		

三菱商事	460,200	4,605.00	2,119,221,000		
第一実業	2,600	4,240.00	11,024,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	17,000	3,110.00	52,870,000		
西華産業	2,700	1,551.00	4,187,700		
佐藤商事	5,000	1,196.00	5,980,000		
菱洋エレクトロ	6,300	2,348.00	14,792,400	貸付株式数	1,800株
東京産業	6,400	790.00	5,056,000	貸付株式数	200株
ユアサ商事	6,600	3,590.00	23,694,000		
神鋼商事	1,800	4,520.00	8,136,000		
トルク	7,100	234.00	1,661,400	貸付株式数	1,100株
阪和興業	13,200	3,580.00	47,256,000		
正栄食品	4,900	4,275.00	20,947,500	貸付株式数	1,900株
カナデン	5,900	1,103.00	6,507,700	貸付株式数	2,200株
菱電商事	5,900	1,686.00	9,947,400	貸付株式数	2,300株
ニプロ	58,800	1,017.00	59,799,600		
岩谷産業	16,700	5,770.00	96,359,000		
ナイス	2,500	1,318.00	3,295,000		
ニチモウ	800	2,649.00	2,119,200		
極東貿易	4,400	1,325.00	5,830,000	貸付株式数	400株
アステナホールディングス	13,200	417.00	5,504,400		
兼松エレクトロニクス	4,400	4,565.00	20,086,000		
三愛オブリ	20,300	1,292.00	26,227,600	貸付株式数	1,000株
稲畑産業	15,000	2,369.00	35,535,000	貸付株式数	2,000株
ＧＳＩクレオス	4,300	1,458.00	6,269,400	貸付株式数	1,400株
明和産業	9,800	701.00	6,869,800	貸付株式数	3,900株
クワザワホールディングス	2,400	426.00	1,022,400	貸付株式数	1,000株
ゴールドウイン	12,300	9,420.00	115,866,000		
ユニ・チャーム	145,300	5,083.00	738,559,900		
デサント	12,000	3,350.00	40,200,000		
キ　ン　グ	2,800	485.00	1,358,000	貸付株式数	1,400株
ワ　キ　タ	13,400	1,198.00	16,053,200		
ヤマトインターナシヨナル	4,800	248.00	1,190,400	貸付株式数	2,300株
東邦ホールディングス	18,400	2,130.00	39,192,000		
サンゲツ	18,400	2,101.00	38,658,400		
ミツウロコグループ	9,400	1,058.00	9,945,200		
シナネンホールディングス	2,400	3,800.00	9,120,000		
伊藤忠エネクス	18,000	1,020.00	18,360,000		
サンリオ	20,800	4,525.00	94,120,000	貸付株式数	500株
サンワ　テクノス	3,800	1,526.00	5,798,800		

リョーサン	7,800	2,842.00	22,167,600		
新光商事	9,700	1,125.00	10,912,500		
トーホー	3,200	1,731.00	5,539,200	貸付株式数	1,200株
三信電気	2,900	2,246.00	6,513,400		
東陽テクニカ	8,700	1,399.00	12,171,300		
モスフード　サービス	10,800	3,180.00	34,344,000	貸付株式数	3,600株
加賀電子	5,900	4,390.00	25,901,000		
三益半導体	6,400	2,558.00	16,371,200		
都築電気	3,600	1,334.00	4,802,400		
ソーダニツカ	5,900	599.00	3,534,100		
立花エレテック	5,100	1,776.00	9,057,600	貸付株式数	1,800株
木曽路	11,200	2,142.00	23,990,400	貸付株式数	1,200株
ＳＲＳホールディングス	12,200	847.00	10,333,400	貸付株式数	4,300株 (1,100株)
千　趣　会	13,800	409.00	5,644,200	貸付株式数	5,300株
タカキユー	6,100	79.00	481,900	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	10,800	1,237.00	13,359,600	貸付株式数	3,700株
ケーヨー	12,000	903.00	10,836,000	貸付株式数	5,500株
上新電機	6,600	1,905.00	12,573,000	貸付株式数	2,000株
日本瓦斯	39,400	2,103.00	82,858,200		
ロイヤルホールディングス	14,200	2,397.00	34,037,400	貸付株式数	5,600株
東　天　紅	600	816.00	489,600	貸付株式数	100株
いなげや	6,600	1,184.00	7,814,400	貸付株式数	2,900株
チヨダ	7,300	763.00	5,569,900	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	6,300	2,457.00	15,479,100		
リンガーハット	9,500	2,195.00	20,852,500	貸付株式数	3,800株
ＭｒＭａｘＨＤ	10,600	662.00	7,017,200		
テンアライド	7,800	260.00	2,028,000	貸付株式数	3,100株
ＡＯＫＩホールディングス	13,700	686.00	9,398,200	貸付株式数	2,400株
オークワ	11,100	942.00	10,456,200	貸付株式数	100株
コメリ	11,400	2,590.00	29,526,000		
青山商事	15,800	999.00	15,784,200	貸付株式数	100株
しまむら	8,600	12,490.00	107,414,000		
はせがわ	3,700	367.00	1,357,900		
高　島　屋	55,300	1,786.00	98,765,800		
松　屋	12,300	975.00	11,992,500	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	35,600	1,220.00	43,432,000	貸付株式数	12,100株
近鉄百貨店	2,200	2,465.00	5,423,000	貸付株式数	900株
丸井グループ	54,200	2,334.00	126,502,800		

クレディセゾン	43,500	1,757.00	76,429,500		
アクシアル　リテイリング	4,900	3,395.00	16,635,500	貸付株式数	1,700株
井　筒　屋	3,300	402.00	1,326,600	貸付株式数	1,300株
イオン	249,300	2,823.00	703,773,900		
イ　ズ　ミ	11,000	3,015.00	33,165,000	貸付株式数	1,300株
フオーバル	2,800	1,034.00	2,895,200	貸付株式数	1,000株
平　和　堂	11,900	2,031.00	24,168,900	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	11,200	1,868.00	20,921,600	貸付株式数	6,500株
ヤオコー	8,200	6,700.00	54,940,000	貸付株式数	3,300株
ゼビオホールディングス	10,100	942.00	9,514,200		
ケーズホールディングス	58,600	1,140.00	66,804,000		
ＰＡＬＴＡＣ	11,600	4,315.00	50,054,000	貸付株式数	100株
三谷産業	12,700	313.00	3,975,100	貸付株式数	4,500株
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	2,300	524.00	1,205,200	貸付株式数	700株
日産東京販売ＨＤ	8,900	298.00	2,652,200		
新生銀行	20,300	2,339.00	47,481,700		
あおぞら銀行	42,700	2,595.00	110,806,500		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,495,600	755.10	3,394,627,560	貸付株式数	1,740,200株
りそなホールディングス	877,500	660.90	579,939,750		
三井住友トラストＨＤ	127,400	4,407.00	561,451,800		
三井住友フィナンシャルＧ ※	501,300	4,673.00	2,342,574,900		
千葉銀行	190,200	834.00	158,626,800		
群馬銀行	131,500	451.00	59,306,500		
武蔵野銀行	8,300	1,883.00	15,628,900		
千葉興業銀行	14,700	376.00	5,527,200	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	27,600	212.00	5,851,200	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	21,600	1,948.00	42,076,800		
秋田銀行	4,200	1,684.00	7,072,800		
山形銀行	7,300	1,217.00	8,884,100	貸付株式数	300株
岩手銀行	4,500	1,935.00	8,707,500	貸付株式数	300株
東邦銀行	53,500	210.00	11,235,000	貸付株式数	800株
東北銀行	2,800	986.00	2,760,800		
ふくおかフィナンシャルＧ	54,400	2,691.00	146,390,400		
スルガ銀行	63,000	429.00	27,027,000		
八十二銀行	139,500	519.00	72,400,500		
山梨中央銀行	6,700	1,043.00	6,988,100	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	12,800	1,844.00	23,603,200		
福井銀行	5,700	1,464.00	8,344,800		

清水銀行	2,300	1,529.00	3,516,700		
富山銀行	900	1,746.00	1,571,400	貸付株式数	400株
滋賀銀行	11,300	2,616.00	29,560,800	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,100	2,335.00	23,583,500	貸付株式数	100株
百五銀行	62,100	350.00	21,735,000		
京都銀行	21,600	5,700.00	123,120,000		
紀陽銀行	24,200	1,521.00	36,808,200	貸付株式数	9,200株
ほくほくフィナンシャルG	43,600	929.00	40,504,400		
山陰合同銀行	42,200	755.00	31,861,000	貸付株式数	3,600株
鳥取銀行	1,700	1,101.00	1,871,700		
百十四銀行	5,900	1,794.00	10,584,600	貸付株式数	1,100株
四国銀行	9,900	919.00	9,098,100	貸付株式数	3,800株
阿波銀行	9,700	2,042.00	19,807,400		
大分銀行	3,900	1,980.00	7,722,000		
宮崎銀行	4,200	2,318.00	9,735,600		
佐賀銀行	3,500	1,610.00	5,635,000	貸付株式数	200株
琉球銀行	14,900	835.00	12,441,500	貸付株式数	1,900株
セブン銀行	242,100	261.00	63,188,100		
みずほフィナンシャルG	992,400	1,717.00	1,703,950,800		
高知銀行	1,800	670.00	1,206,000	貸付株式数	100株
山口フィナンシャルG	74,600	816.00	60,873,600		
芙蓉総合リース	6,300	8,790.00	55,377,000		
みずほリース	10,200	3,305.00	33,711,000	貸付株式数	4,000株
東京センチュリー	12,800	4,720.00	60,416,000	貸付株式数	4,800株
ＳＢＩホールディングス	99,200	2,618.00	259,705,600		
日本証券金融	27,700	1,026.00	28,420,200		
アイフル	113,700	408.00	46,389,600		
日本アジア投資	5,700	291.00	1,658,700	貸付株式数	100株
長野銀行	2,000	1,248.00	2,496,000	貸付株式数	800株
名古屋銀行	4,400	3,215.00	14,146,000		
北洋銀行	102,500	245.00	25,112,500		
大光銀行	1,800	1,184.00	2,131,200	貸付株式数	300株
愛媛銀行	8,700	881.00	7,664,700		
トマト銀行	1,800	998.00	1,796,400		
京葉銀行	30,800	545.00	16,786,000		
栃木銀行	30,600	321.00	9,822,600		
北日本銀行	2,100	1,937.00	4,067,700	貸付株式数	300株
東和銀行	11,200	547.00	6,126,400		
福島銀行	5,700	225.00	1,282,500		
大東銀行	1,800	647.00	1,164,600	貸付株式数	200株

リコーリース	6,600	3,650.00	24,090,000		
イオンフィナンシャルサービス	39,800	1,469.00	58,466,200	貸付株式数	15,400株
ア　コ　ム	122,800	321.00	39,418,800		
ジャックス	7,400	3,905.00	28,897,000		
オ　リ　コ	18,000	1,197.00	21,546,000		
オリックス	458,300	2,210.50	1,013,072,150		
三菱ＨＣキャピタル	267,600	654.00	175,010,400		
ジャフコ　グループ	22,900	2,407.00	55,120,300		
九州　リースサービス	3,500	676.00	2,366,000	貸付株式数	1,300株
トモニホールディングス	53,300	349.00	18,601,700		
大和証券Ｇ本社	490,800	608.00	298,406,400		
野村ホールディングス	1,263,100	500.70	632,434,170		
岡三証券グループ	61,400	387.00	23,761,800	貸付株式数	21,300株
丸三証券	23,200	422.00	9,790,400	貸付株式数	1,600株
東洋証券	23,100	283.00	6,537,300	貸付株式数	8,700株 (100株)
東海東京ＨＤ	75,900	357.00	27,096,300		
光世証券	2,100	402.00	844,200	貸付株式数	500株
水戸証券	19,200	226.00	4,339,200		
いちよし証券	12,800	612.00	7,833,600	貸付株式数	100株
松井証券	40,800	786.00	32,068,800		
ＳＯＭＰＯホールディングス	117,700	6,059.00	713,144,300		
日本取引所グループ	192,500	1,975.50	380,283,750		
マネックスＧ	76,700	430.00	32,981,000	貸付株式数	30,500株
極東証券	8,900	616.00	5,482,400	貸付株式数	3,000株
岩井コスモホールディング	8,000	1,274.00	10,192,000		
アイザワ証券グループ	10,000	687.00	6,870,000	貸付株式数	100株
フィデアホール	6,500	1,361.00	8,846,500	貸付株式数	200株
池田泉州ＨＤ	85,200	232.00	19,766,400		
アニコム　ホールディングス	23,500	725.00	17,037,500	貸付株式数	400株
ＭＳ＆ＡＤ	154,700	4,100.00	634,270,000		
マネーパートナーズＧＰ	7,400	278.00	2,057,200		
スパークス・グループ	7,700	1,707.00	13,143,900		
小林洋行	3,700	221.00	817,700	貸付株式数	700株
第一生命ＨＬＤＧＳ	349,100	2,543.50	887,935,850		
東京海上ＨＤ	690,300	2,827.00	1,951,478,100		
アドバンテッジリスクマネ	3,400	411.00	1,397,400		

イー・ギャランティ	11,100	2,459.00	27,294,900	貸付株式数	4,400株
アサックス	3,400	608.00	2,067,200	貸付株式数	1,500株
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,500	2,080.00	7,280,000		
Ｔ＆Ｄホールディングス	184,200	1,668.00	307,245,600		
アドバンスクリエイト	4,100	1,072.00	4,395,200	貸付株式数	1,100株
三井不動産	297,700	2,776.50	826,564,050		
三菱地所	434,300	1,940.00	842,542,000		
平和不動産	11,100	4,090.00	45,399,000		
東京建物	65,200	1,921.00	125,249,200		
京阪神ビルディング	8,800	1,282.00	11,281,600	貸付株式数	2,300株
住友不動産	123,800	3,716.00	460,040,800		
太平洋興発	2,600	748.00	1,944,800		
テーオーシー	12,300	727.00	8,942,100	貸付株式数	4,800株
東京楽天地	1,100	4,355.00	4,790,500	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	9,800	2,748.00	26,930,400		
フジ住宅	9,500	656.00	6,232,000		
空港施設	7,900	539.00	4,258,100		
明和地所	3,400	631.00	2,145,400		
ゴールドクレスト	6,500	1,764.00	11,466,000		
リログループ	39,800	2,263.00	90,067,400	貸付株式数	200株
エスリード	3,200	1,888.00	6,041,600		
日神グループＨＬＤＧＳ	11,000	430.00	4,730,000	貸付株式数	4,400株
日本エスコン	15,400	838.00	12,905,200	貸付株式数	4,900株
ＭＩＲＡＲＴＨホールディング	34,700	390.00	13,533,000		
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,400	802.00	2,726,800	貸付株式数	600株
イオンモール	35,400	1,655.00	58,587,000		
毎日コムネット	2,500	713.00	1,782,500	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,700	1,012.00	2,732,400	貸付株式数	1,100株
ランド	410,600	10.00	4,106,000	貸付株式数	133,800株
カチタス	18,400	3,165.00	58,236,000		
東祥	5,000	1,226.00	6,130,000	貸付株式数	1,500株
トーセイ	11,400	1,402.00	15,982,800	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,600	1,993.00	3,188,800	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	11,300	1,172.00	13,243,600		
インテリックス	1,700	542.00	921,400	貸付株式数	600株
ランドビジネス	2,400	228.00	547,200	貸付株式数	1,000株
サンネクスタグループ	2,100	989.00	2,076,900	貸付株式数	900株
グランディハウス	5,700	548.00	3,123,600		

東武鉄道	76,500	3,310.00	253,215,000		
相鉄ホールディングス	23,100	2,190.00	50,589,000		
東急	195,100	1,749.00	341,229,900		
京浜急行	79,000	1,440.00	113,760,000	貸付株式数	9,700株
小田急電鉄	105,500	1,802.00	190,111,000		
京王電鉄	36,800	5,120.00	188,416,000		
京成電鉄	44,900	3,915.00	175,783,500		
富士急行	8,600	4,920.00	42,312,000	貸付株式数	3,200株
東日本旅客鉄道	118,000	7,811.00	921,698,000		
西日本旅客鉄道	88,900	5,836.00	518,820,400		
東海旅客鉄道	53,600	16,630.00	891,368,000		
西武ホールディングス	84,200	1,380.00	116,196,000		
鴻池運輸	11,900	1,581.00	18,813,900		
西日本鉄道	18,600	2,806.00	52,191,600		
ハマキョウレックス	5,500	3,425.00	18,837,500		
サカイ引越センター	3,300	4,595.00	15,163,500	貸付株式数	1,400株
近鉄グループＨＬＤＧＳ	69,400	4,900.00	340,060,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	92,700	4,290.00	397,683,000		
南海電鉄	33,300	3,010.00	100,233,000	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	28,700	3,460.00	99,302,000		
神戸電鉄	2,000	3,235.00	6,470,000	貸付株式数	700株
名古屋鉄道	76,900	2,259.00	173,717,100		
山陽電鉄	5,300	2,235.00	11,845,500	貸付株式数	600株
アルプス物流	5,600	1,160.00	6,496,000		
トランコム	2,000	7,920.00	15,840,000	貸付株式数	500株
ヤマトホールディングス	88,900	2,293.00	203,847,700		
山　九	17,600	4,945.00	87,032,000		
日　新	5,300	2,034.00	10,780,200		
丸　運	3,600	222.00	799,200	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	4,300	3,220.00	13,846,000	貸付株式数	1,500株
センコーグループＨＬＤＧＳ	36,800	1,016.00	37,388,800	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,500	3,650.00	5,475,000		
ニッコンホールディングス	22,200	2,419.00	53,701,800		
日石輸送	700	2,274.00	1,591,800	貸付株式数	200株
福山通運	5,800	3,500.00	20,300,000		
セイノーホールディングス	43,200	1,204.00	52,012,800	貸付株式数	16,300株
エスライン	2,000	823.00	1,646,000	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,000	3,365.00	6,730,000	貸付株式数	100株
日立物流	13,300	8,890.00	118,237,000		

ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディ	16,800	1,460.00	24,528,000	貸付株式数	5,000株 (2,400株)
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,700	1,226.00	8,214,200	貸付株式数	800株
日本郵船	185,800	3,037.00	564,274,600	貸付株式数	74,300株
商船三井	122,400	3,365.00	411,876,000	貸付株式数	47,300株
川崎汽船	59,200	2,598.00	153,801,600	貸付株式数	20,000株
ＮＳユナイテッド海運	3,700	3,780.00	13,986,000		
明治海運	6,700	721.00	4,830,700	貸付株式数	3,000株
飯野海運	25,500	933.00	23,791,500		
共栄タンカー	1,300	950.00	1,235,000	貸付株式数	500株
九州旅客鉄道	49,200	3,025.00	148,830,000		
ＳＧホールディングス	133,300	2,130.00	283,929,000		
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳ	25,900	8,090.00	209,531,000		
日本航空	170,700	2,733.00	466,523,100		
ＡＮＡホールディングス	189,100	2,944.50	556,804,950		
ビーウィズ	2,100	1,187.00	2,492,700	貸付株式数	800株 (300株)
パスコ	1,400	1,331.00	1,863,400	貸付株式数	400株
ＴＲＥホールディングス	15,100	1,571.00	23,722,100	貸付株式数	4,600株
人・夢・技術グループ	3,200	2,106.00	6,739,200	貸付株式数	100株
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,900	3,700.00	7,030,000	貸付株式数	700株
シルバーライフ	1,700	1,557.00	2,646,900	貸付株式数	600株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	800	1,618.00	1,294,400	貸付株式数	200株
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	3,600	3,460.00	12,456,000	貸付株式数	1,400株
コーア商事ＨＬＤＧＳ	5,100	621.00	3,167,100		
ＫＰＰグループホールディン	17,200	972.00	16,718,400	貸付株式数	6,800株
ナルミヤ・インターナショナル	1,100	860.00	946,000	貸付株式数	600株
ブックオフＧＨＤ	4,500	1,314.00	5,913,000	貸付株式数	1,800株
ギフトホールディングス	1,600	3,950.00	6,320,000	貸付株式数	400株
三菱倉庫	14,900	3,340.00	49,766,000		
三井倉庫ＨＯＬＤ	6,500	3,535.00	22,977,500		
住友倉庫	19,100	2,002.00	38,238,200	貸付株式数	7,600株
渋沢倉庫	2,800	2,078.00	5,818,400	貸付株式数	600株

ヤマタネ	3,300	1,696.00	5,596,800	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	9,200	257.00	2,364,400	貸付株式数	3,200株
乾汽船	8,800	1,827.00	16,077,600	貸付株式数	3,500株
日本トランスシティ	14,000	501.00	7,014,000		
ケイヒン	1,200	1,537.00	1,844,400		
中央倉庫	3,300	932.00	3,075,600	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,200	1,006.00	1,207,200	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,800	938.00	4,502,400		
ファイズホールディングス	1,300	999.00	1,298,700	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,283.00	2,566,000		
上　組	34,500	2,799.00	96,565,500		
サンリツ	1,500	729.00	1,093,500		
キムラユニティー	3,300	778.00	2,567,400	貸付株式数	400株
キユーソー流通システム	4,200	1,033.00	4,338,600	貸付株式数	1,600株 (400株)
東海運	4,100	283.00	1,160,300	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,400	1,437.00	6,322,800	貸付株式数	1,600株
内外トランスライン	2,500	2,204.00	5,510,000	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,800	568.00	1,590,400	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,200	1,747.00	3,843,400	貸付株式数	700株
ＴＢＳホールディングス	35,800	1,568.00	56,134,400		
日本テレビＨＬＤＳ	61,900	1,059.00	65,552,100		
朝日放送グループＨＤ	6,700	622.00	4,167,400	貸付株式数	2,600株
テレビ朝日ＨＤ	17,100	1,371.00	23,444,100	貸付株式数	200株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	61,800	508.00	31,394,400		
テレビ東京ＨＤ	5,000	1,841.00	9,205,000		
日本ＢＳ放送	2,500	917.00	2,292,500	貸付株式数	900株
ビジョン	9,200	1,377.00	12,668,400	貸付株式数	3,600株
スマートバリュー	1,700	470.00	799,000	貸付株式数	600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	6,300	2,351.00	14,811,300	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	3,200	280.00	896,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
コネクシオ	4,700	1,199.00	5,635,300		
日本通信	64,500	222.00	14,319,000	貸付株式数	24,600株
クロップス	1,100	1,113.00	1,224,300		
日本電信電話	894,000	3,820.00	3,415,080,000		
ＫＤＤＩ	539,100	4,111.00	2,216,240,100		
ソフトバンク	1,120,800	1,497.50	1,678,398,000		
光通信	8,200	19,170.00	157,194,000		

エムティーアイ	6,400	506.00	3,238,400	貸付株式数	1,400株
GMOインターネットグループ	25,900	2,535.00	65,656,500		
ファイバーゲート	3,700	940.00	3,478,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
アイドママーケティングコミュ	1,600	286.00	457,600	貸付株式数	600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	36,900	2,543.00	93,836,700		
学研ホールディングス	11,700	1,026.00	12,004,200	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	11,900	861.00	10,245,900	貸付株式数	100株
昭文社ホールディングス	3,000	294.00	882,000	貸付株式数	1,300株
インプレスホールディングス	6,200	214.00	1,326,800		
東京電力ＨＤ	627,300	499.00	313,022,700		
中部電力	256,400	1,288.00	330,243,200		
関西電力	268,600	1,166.00	313,187,600		
中国電力	111,000	715.00	79,365,000		
北陸電力	65,900	537.00	35,388,300		
東北電力	170,300	653.00	111,205,900		
四国電力	59,500	753.00	44,803,500		
九州電力	160,600	718.00	115,310,800		
北海道電力	67,300	454.00	30,554,200		
沖縄電力	16,300	1,054.00	17,180,200		
電源開発	52,400	2,118.00	110,983,200		
エフオン	5,100	548.00	2,794,800	貸付株式数	1,900株
イーレックス	12,400	2,522.00	31,272,800	貸付株式数	4,000株
レノバ	18,500	2,731.00	50,523,500	貸付株式数	7,400株
東京瓦斯	147,100	2,526.00	371,574,600		
大阪瓦斯	140,900	2,122.00	298,989,800		
東邦瓦斯	27,400	2,691.00	73,733,400		
北海道瓦斯	4,100	1,692.00	6,937,200	貸付株式数	1,400株
広島ガス	14,500	340.00	4,930,000		
西部ガスＨＬＤＧＳ	6,500	1,678.00	10,907,000	貸付株式数	600株
静岡ガス	15,800	1,100.00	17,380,000	貸付株式数	700株
メタウォーター	8,600	1,789.00	15,385,400		
アイネット	4,200	1,305.00	5,481,000		
松　竹	4,000	11,900.00	47,600,000		
東　宝	43,600	5,290.00	230,644,000		
エイチ・アイ・エス	18,700	2,015.00	37,680,500	貸付株式数	7,400株
東　映	1,900	18,910.00	35,929,000		

ラックランド	2,200	2,959.00	6,509,800	貸付株式数	800株
ＮＴＴデータ	218,800	2,102.00	459,917,600		
共立メンテナンス	12,200	6,100.00	74,420,000	貸付株式数	5,200株
イチネンホールディングス	7,500	1,252.00	9,390,000		
建設技術研究所	3,700	3,255.00	12,043,500		
スペース	5,100	890.00	4,539,000	貸付株式数	700株
アインホールディングス	10,100	6,730.00	67,973,000	貸付株式数	2,900株
燦ホールディングス	3,200	1,821.00	5,827,200		
ピー・シー・エー	4,200	1,282.00	5,384,400	貸付株式数	1,600株
スバル興業	500	9,070.00	4,535,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,600	1,141.00	2,966,600	貸付株式数	1,000株
タナベコンサルティンググル	2,700	662.00	1,787,400	貸付株式数	1,000株
ビジネスＢ太田昭和	3,000	1,951.00	5,853,000	貸付株式数	600株
ナ　ガ　ワ	1,900	7,660.00	14,554,000	貸付株式数	800株
東京都競馬	6,000	4,030.00	24,180,000	貸付株式数	2,300株
常磐興産	2,500	1,199.00	2,997,500	貸付株式数	1,000株
カナモト	13,000	2,245.00	29,185,000		
ＤＴＳ	15,300	3,295.00	50,413,500	貸付株式数	100株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	35,100	6,190.00	217,269,000		
シーイーシー	9,800	1,513.00	14,827,400		
カプコン	69,300	4,175.00	289,327,500		
西尾レントオール	6,600	3,090.00	20,394,000	貸付株式数	1,500株
アイ・エス・ビー	3,500	1,308.00	4,578,000	貸付株式数	1,200株
アゴーラ　ホスピタリティーＧ	40,300	23.00	926,900	貸付株式数	15,600株
日本空港ビルデング	24,200	6,220.00	150,524,000	貸付株式数	10,300株
トランス・コスモス	8,900	3,235.00	28,791,500	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	31,200	1,032.00	32,198,400		
ジャステック	4,200	1,198.00	5,031,600	貸付株式数	1,600株
ＳＣＳＫ	56,900	2,202.00	125,293,800		
藤田観光	3,200	2,980.00	9,536,000	貸付株式数	1,000株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,300	1,730.00	7,439,000	貸付株式数	1,600株
日本管財	7,500	2,542.00	19,065,000		
トーカイ	6,300	1,869.00	11,774,700	貸付株式数	100株
白　洋　舎	700	1,988.00	1,391,600	貸付株式数	300株
セコム	72,800	8,485.00	617,708,000		
ＮＳＷ	2,700	2,170.00	5,859,000		

セントラル警備保障	3,900	2,439.00	9,512,100	貸付株式数	1,500株
アイネス	4,800	1,444.00	6,931,200	貸付株式数	2,300株
丹青社	13,900	798.00	11,092,200		
メイテツク	28,500	2,548.00	72,618,000		
ＴＫＣ	12,500	3,735.00	46,687,500		
富士ソフト	7,900	8,140.00	64,306,000	貸付株式数	400株
応用地質	7,000	2,096.00	14,672,000		
船井総研ホールディン	15,000	2,795.00	41,925,000	貸付株式数	4,800株
ＮＳＤ	24,800	2,560.00	63,488,000		
進学会ホールディングス	2,600	305.00	793,000	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	600	1,739.00	1,043,400	貸付株式数	200株
オ　オ　バ	4,500	681.00	3,064,500		
コナミグループ	29,900	6,450.00	192,855,000		
いであ	1,600	1,717.00	2,747,200	貸付株式数	600株
学　究　社	2,800	1,786.00	5,000,800		
ベネッセホールディングス	26,700	1,991.00	53,159,700		
イオンディライト	7,900	2,925.00	23,107,500		
ナック	3,000	932.00	2,796,000	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータＨＬＤＳ	4,800	2,944.00	14,131,200	貸付株式数	1,400株
ダイセキ	14,600	4,700.00	68,620,000	貸付株式数	5,800株
ステップ	2,900	1,795.00	5,205,500	貸付株式数	200株
日鉄物産	5,000	5,100.00	25,500,000		
泉州電業	3,600	2,788.00	10,036,800	貸付株式数	1,400株
元気寿司	2,300	3,180.00	7,314,000	貸付株式数	900株
トラスコ中山	15,400	2,087.00	32,139,800		
ヤマダホールディングス	302,300	477.00	144,197,100		
オートバックスセブン	25,700	1,458.00	37,470,600	貸付株式数	9,300株
モリト	5,000	758.00	3,790,000		
アークランズ	10,800	1,498.00	16,178,400		
ニトリホールディングス	29,800	15,565.00	463,837,000		
グルメ杵屋	6,100	997.00	6,081,700	貸付株式数	2,400株 (100株)
愛　眼	6,500	176.00	1,144,000	貸付株式数	2,700株
ケーユーホールディングス	4,300	1,300.00	5,590,000		
吉野家ホールディングス	28,800	2,321.00	66,844,800	貸付株式数	11,500株
加藤産業	9,000	3,495.00	31,455,000		
北恵	1,700	687.00	1,167,900	貸付株式数	500株
イノテック	4,600	1,302.00	5,989,200		
イエローハット	13,000	1,724.00	22,412,000	貸付株式数	4,600株
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,500	3,995.00	13,982,500	貸付株式数	1,200株

ＪＢＣＣホールディングス	5,000	1,959.00	9,795,000		
ＪＫホールディングス	5,800	1,042.00	6,043,600	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	11,900	1,221.00	14,529,900	貸付株式数	300株
日　伝	4,900	1,700.00	8,330,000	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	6,600	1,389.00	9,167,400	貸付株式数	2,500株
ミロク情報サービス	6,300	1,501.00	9,456,300	貸付株式数	700株
北沢産業	4,000	205.00	820,000	貸付株式数	700株
杉本商事	3,100	2,062.00	6,392,200	貸付株式数	1,200株
因幡電機産業	19,100	2,782.00	53,136,200		
王将フードサービス	4,900	6,060.00	29,694,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	1,000	2,637.00	2,637,000	貸付株式数	100株
ミニストップ	4,700	1,423.00	6,688,100	貸付株式数	2,000株
アークス	13,100	2,099.00	27,496,900	貸付株式数	5,100株
バローホールディングス	13,600	1,758.00	23,908,800		
東　テ　ク	2,500	3,275.00	8,187,500		
ミスミグループ本社	111,000	3,350.00	371,850,000		
アルテック	3,800	314.00	1,193,200		
ベ　ル　ク	3,600	5,720.00	20,592,000	貸付株式数	700株
大　庄	4,100	1,061.00	4,350,100	貸付株式数	1,500株
タキヒヨー	1,700	900.00	1,530,000	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	11,000	80,810.00	888,910,000		
ソフトバンクグループ	403,400	5,952.00	2,401,036,800		
蔵王産業	900	1,773.00	1,595,700		
スズケン	26,900	3,695.00	99,395,500		
サンドラッグ	27,800	3,660.00	101,748,000		
サックスバーホールディング	7,100	800.00	5,680,000	貸付株式数	2,400株
ジェコス	4,700	803.00	3,774,100		
ヤマザワ	800	1,310.00	1,048,000	貸付株式数	600株
や　ま　や	1,700	2,476.00	4,209,200	貸付株式数	600株
グローセル	8,100	432.00	3,499,200	貸付株式数	3,000株
ベルーナ	17,800	689.00	12,264,200	貸付株式数	100株
合計			199,365,246,780		

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

ソニーグループ	20,000株	キーエンス	5,000株
本田技研	30,000株	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	200,000株
三井住友フィナンシャルＧ	30,000株		

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

貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「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

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	304,345,621	298,172,503
国債証券	85,097,080,600	104,845,798,810
地方債証券	3,514,853,500	2,911,753,400
特殊債券	2,703,089,900	2,016,980,400
社債券	2,976,109,700	2,780,464,900
未収入金	403,578,000	100,751,000
未収利息	195,282,238	218,481,441
前払費用	2,741,434	3,435,238
流動資産合計	95,197,080,993	113,175,837,692
資産合計	95,197,080,993	113,175,837,692
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	－
未払解約金	17,470,022	99,099,215
流動負債合計	117,470,022	99,099,215
負債合計	117,470,022	99,099,215
純資産の部		
元本等		
元本　※1	66,960,247,306	83,142,525,531

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	28,119,363,665	29,934,212,946
元本等合計	95,079,610,971	113,076,738,477
純資産合計	95,079,610,971	113,076,738,477
負債純資産合計	95,197,080,993	113,175,837,692

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年12月1日 至　2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1.　※1　期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	63,632,169,674円	66,960,247,306円
期中追加設定元本額	13,191,022,279円	28,030,628,143円
期中一部解約元本額	9,862,944,647円	11,848,349,918円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	59,050,508円	52,917,204円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	412,666,474円	281,234,952円

	ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	49,180,012円	46,312,087円
	ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	693,952,196円	572,435,304円
	ＤＣダイワ日本債券インデックス	9,573,099,389円	10,377,310,449円
	ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	704,912円	1,548,164,674円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	10,117,083,683円	8,977,064,441円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,686,540,655円	1,543,317,679円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	219,254,803円	189,833,127円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	314,922,939円	241,971,948円
	ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	61,401,829円	63,243,630円
	ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	26,594,045,062円	26,333,485,063円
	ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	6,074,653,568円	22,413,934,040円
	ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	2,139,796,937円	2,111,247,399円
	ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	965,018,800円	872,287,058円
	ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,784,763,908円	6,396,124,679円
	ダイワライフスタイル２５	477,075,499円	432,831,898円
	ダイワライフスタイル５０	581,511,996円	548,823,097円
	ダイワライフスタイル７５	155,524,136円	139,986,802円
計		66,960,247,306円	83,142,525,531円
2.	期末日における受益権の総数	66,960,247,306口	83,142,525,531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　2021年12月1日 至　2022年11月30日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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	2022年11月30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	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2022年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△500,217,670	△4,707,923,020
地方債証券	△20,927,900	△97,363,200
特殊債券	△11,147,300	△79,586,200
社債券	5,480,800	△92,144,400
合計	△526,812,070	△4,977,016,820

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4199円 (14,199円)	1.3600円 (13,600円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	４３１　２年国債	300,000,000	300,255,000	
	４３３　２年国債	1,000,000,000	1,000,870,000	
	４３４　２年国債	100,000,000	100,087,000	
	４３５　２年国債	100,000,000	100,093,000	
	４３６　２年国債	2,300,000,000	2,302,277,000	
	４３８　２年国債	130,000,000	130,102,700	
	４３９　２年国債	650,000,000	650,487,500	
	４４０　２年国債	180,000,000	180,126,000	
	１３８　５年国債	1,200,000,000	1,202,328,000	
	１３９　５年国債	950,000,000	951,966,500	
	１４０　５年国債	1,120,000,000	1,122,520,000	
	１４１　５年国債	1,240,000,000	1,243,013,200	
	１４２　５年国債	1,040,000,000	1,042,662,400	
	１４３　５年国債	2,500,000,000	2,506,600,000	
	１４４　５年国債	1,180,000,000	1,183,457,400	
	１４５　５年国債	1,250,000,000	1,253,850,000	
	１４６　５年国債	780,000,000	782,496,000	

１４７　５年国債	1,200,000,000	1,200,000,000	
１４８　５年国債	1,050,000,000	1,049,622,000	
１４９　５年国債	950,000,000	949,097,500	
１５０　５年国債	1,250,000,000	1,247,725,000	
１５１　５年国債	1,240,000,000	1,236,540,400	
１５３　５年国債	850,000,000	846,719,000	
１５４　５年国債	190,000,000	189,908,800	
１　４０年国債	70,000,000	85,554,700	
２　４０年国債	110,000,000	129,148,800	
３　４０年国債	150,000,000	176,842,500	
４　４０年国債	180,000,000	210,465,000	
５　４０年国債	185,000,000	207,629,200	
６　４０年国債	105,000,000	114,945,600	
７　４０年国債	121,000,000	126,557,530	
８　４０年国債	230,000,000	222,812,500	
９　４０年国債	220,000,000	155,551,000	
１０　４０年国債	275,000,000	228,822,000	
１１　４０年国債	320,000,000	255,900,800	
１２　４０年国債	380,000,000	270,358,600	
１３　４０年国債	360,000,000	254,142,000	
１４　４０年国債	430,000,000	324,237,200	
１５　４０年国債	850,000,000	699,924,000	
３３２　１０年国債	250,000,000	251,787,500	
３３３　１０年国債	700,000,000	705,999,000	
３３４　１０年国債	900,000,000	909,000,000	
３３５　１０年国債	690,000,000	696,658,500	
３３６　１０年国債	275,000,000	277,961,750	
３３７　１０年国債	400,000,000	402,668,000	
３３８　１０年国債	580,000,000	585,533,200	
３３９　１０年国債	590,000,000	596,242,200	
３４０　１０年国債	760,000,000	768,732,400	
３４１　１０年国債	500,000,000	504,655,000	
３４２　１０年国債	880,000,000	882,754,400	
３４３　１０年国債	780,000,000	782,347,800	
３４４　１０年国債	780,000,000	782,067,000	
３４５　１０年国債	950,000,000	951,919,000	
３４６　１０年国債	780,000,000	780,998,400	
３４７　１０年国債	1,100,000,000	1,100,495,000	
３４８　１０年国債	1,050,000,000	1,049,496,000	

３４９　１０年国債	1,550,000,000	1,548,047,000	
３５０　１０年国債	550,000,000	549,131,000	
３５１　１０年国債	1,000,000,000	997,790,000	
３５２　１０年国債	1,500,000,000	1,496,115,000	
３５３　１０年国債	930,000,000	926,931,000	
３５４　１０年国債	680,000,000	677,239,200	
３５５　１０年国債	1,580,000,000	1,571,815,600	
３５６　１０年国債	710,000,000	705,470,200	
３５７　１０年国債	940,000,000	932,489,400	
３５８　１０年国債	900,000,000	891,594,000	
３５９　１０年国債	1,180,000,000	1,166,878,400	
３６０　１０年国債	1,000,000,000	987,380,000	
３６１　１０年国債	1,070,000,000	1,055,244,700	
３６２　１０年国債	760,000,000	748,600,000	
３６３　１０年国債	1,200,000,000	1,180,968,000	
３６４　１０年国債	1,210,000,000	1,189,744,600	
３６５　１０年国債	1,130,000,000	1,112,033,000	
３６６　１０年国債	900,000,000	901,233,000	
３６７　１０年国債	960,000,000	956,860,800	
３６８　１０年国債	220,000,000	218,946,200	
１　３０年国債	16,000,000	18,817,120	
２　３０年国債	24,000,000	27,738,960	
３　３０年国債	30,000,000	34,570,500	
４　３０年国債	36,000,000	43,454,520	
５　３０年国債	28,000,000	32,485,880	
６　３０年国債	24,000,000	28,476,960	
７　３０年国債	55,000,000	65,184,350	
８　３０年国債	27,000,000	30,803,220	
９　３０年国債	43,000,000	47,361,060	
１０　３０年国債	45,000,000	48,234,600	
１１　３０年国債	40,000,000	45,286,800	
１２　３０年国債	60,000,000	70,452,600	
１３　３０年国債	75,000,000	87,330,750	
１４　３０年国債	82,000,000	99,138,820	
１５　３０年国債	50,000,000	61,086,500	
１６　３０年国債	250,000,000	305,895,000	
１７　３０年国債	130,000,000	157,717,300	
１８　３０年国債	80,000,000	96,237,600	
１９　３０年国債	57,000,000	68,630,280	

２１　３０年国債	60,000,000	72,346,200	
２２　３０年国債	170,000,000	209,392,400	
２４　３０年国債	92,000,000	113,485,680	
２５　３０年国債	150,000,000	181,167,000	
２６　３０年国債	180,000,000	219,915,000	
２７　３０年国債	150,000,000	185,344,500	
２８　３０年国債	170,000,000	210,106,400	
２９　３０年国債	200,000,000	244,208,000	
３０　３０年国債	220,000,000	265,284,800	
３１　３０年国債	300,000,000	356,661,000	
３２　３０年国債	285,000,000	343,179,900	
３３　３０年国債	280,000,000	323,780,800	
３４　３０年国債	270,000,000	321,108,300	
３５　３０年国債	250,000,000	289,107,500	
３６　３０年国債	350,000,000	404,652,500	
３７　３０年国債	450,000,000	511,866,000	
３８　３０年国債	300,000,000	335,400,000	
３９　３０年国債	230,000,000	261,059,200	
４０　３０年国債	150,000,000	167,349,000	
４１　３０年国債	210,000,000	230,160,000	
４２　３０年国債	205,000,000	224,481,150	
４３　３０年国債	260,000,000	284,450,400	
４４　３０年国債	300,000,000	327,903,000	
４５　３０年国債	250,000,000	263,307,500	
４６　３０年国債	210,000,000	220,886,400	
４７　３０年国債	370,000,000	395,914,800	
４８　３０年国債	280,000,000	288,218,000	
４９　３０年国債	220,000,000	226,107,200	
５０　３０年国債	310,000,000	280,773,200	
５１　３０年国債	340,000,000	272,550,800	
５２　３０年国債	385,000,000	322,849,450	
５３　３０年国債	250,000,000	213,820,000	
５４　３０年国債	310,000,000	277,028,400	
５５　３０年国債	260,000,000	231,496,200	
５６　３０年国債	340,000,000	301,607,200	
５７　３０年国債	330,000,000	291,654,000	
５８　３０年国債	400,000,000	352,200,000	
５９　３０年国債	300,000,000	256,854,000	
６０　３０年国債	410,000,000	366,966,400	

６１　３０年国債	200,000,000	169,710,000	
６２　３０年国債	430,000,000	344,679,400	
６３　３０年国債	300,000,000	232,914,000	
６４　３０年国債	220,000,000	170,156,800	
６５　３０年国債	200,000,000	154,980,000	
６６　３０年国債	200,000,000	154,694,000	
６７　３０年国債	300,000,000	242,403,000	
６８　３０年国債	290,000,000	233,519,600	
６９　３０年国債	350,000,000	289,009,000	
７０　３０年国債	300,000,000	246,684,000	
７１　３０年国債	260,000,000	213,096,000	
７２　３０年国債	320,000,000	261,667,200	
７３　３０年国債	363,000,000	296,440,320	
７４　３０年国債	320,000,000	283,395,200	
７５　３０年国債	330,000,000	315,839,700	
７６　３０年国債	40,000,000	39,095,600	
６５　２０年国債	175,000,000	178,647,000	
６６　２０年国債	185,000,000	188,661,150	
６７　２０年国債	55,000,000	56,400,850	
６８　２０年国債	120,000,000	123,524,400	
６９　２０年国債	110,000,000	113,087,700	
７０　２０年国債	83,000,000	86,149,020	
７１　２０年国債	125,000,000	129,353,750	
７２　２０年国債	105,000,000	109,043,550	
７３　２０年国債	120,000,000	124,988,400	
７４　２０年国債	73,000,000	76,184,260	
７５　２０年国債	80,000,000	83,890,400	
７６　２０年国債	51,000,000	53,245,530	
７７　２０年国債	130,000,000	136,022,900	
７８　２０年国債	61,000,000	63,980,460	
７９　２０年国債	50,000,000	52,570,500	
８０　２０年国債	53,000,000	55,859,880	
８２　２０年国債	87,000,000	92,146,050	
８３　２０年国債	93,000,000	98,975,250	
８５　２０年国債	58,000,000	62,007,220	
８６　２０年国債	80,000,000	86,055,200	
８７　２０年国債	55,000,000	58,981,450	
８８　２０年国債	100,000,000	108,108,000	
８９　２０年国債	78,000,000	84,048,120	

９０　２０年国債	20,000,000	21,648,400	
９２　２０年国債	310,000,000	335,695,900	
９３　２０年国債	100,000,000	108,271,000	
９４　２０年国債	130,000,000	141,310,000	
９５　２０年国債	50,000,000	55,020,000	
９６　２０年国債	55,000,000	60,023,700	
９７　２０年国債	40,000,000	44,004,400	
９８　２０年国債	320,000,000	350,505,600	
９９　２０年国債	100,000,000	109,942,000	
１００　２０年国債	155,000,000	171,929,100	
１０１　２０年国債	350,000,000	391,912,500	
１０３　２０年国債	170,000,000	190,275,900	
１０４　２０年国債	10,000,000	11,082,500	
１０５　２０年国債	126,000,000	140,214,060	
１０６　２０年国債	150,000,000	167,785,500	
１０７　２０年国債	90,000,000	100,525,500	
１０８　２０年国債	300,000,000	331,485,000	
１０９　２０年国債	55,000,000	60,986,200	
１１０　２０年国債	260,000,000	291,543,200	
１１１　２０年国債	200,000,000	226,302,000	
１１２　２０年国債	150,000,000	168,754,500	
１１３　２０年国債	310,000,000	349,999,300	
１１４　２０年国債	70,000,000	79,248,400	
１１５　２０年国債	180,000,000	205,032,600	
１１６　２０年国債	200,000,000	228,526,000	
１１７　２０年国債	200,000,000	227,090,000	
１１８　２０年国債	95,000,000	107,479,200	
１１９　２０年国債	93,000,000	103,836,360	
１２０　２０年国債	317,000,000	349,229,390	
１２１　２０年国債	200,000,000	225,256,000	
１２２　２０年国債	200,000,000	223,724,000	
１２３　２０年国債	200,000,000	229,022,000	
１２４　２０年国債	300,000,000	341,169,000	
１２５　２０年国債	130,000,000	150,425,600	
１２６　２０年国債	110,000,000	125,496,800	
１２７　２０年国債	250,000,000	283,190,000	
１２８　２０年国債	250,000,000	284,057,500	
１２９　２０年国債	200,000,000	225,574,000	
１３０　２０年国債	140,000,000	158,348,400	

１３１　２０年国債	150,000,000	168,370,500	
１３２　２０年国債	100,000,000	112,585,000	
１３３　２０年国債	430,000,000	487,916,700	
１３４　２０年国債	30,000,000	34,132,500	
１３５　２０年国債	92,000,000	103,838,560	
１３６　２０年国債	550,000,000	615,791,000	
１３８　２０年国債	400,000,000	444,564,000	
１３９　２０年国債	370,000,000	414,659,000	
１４０　２０年国債	500,000,000	565,310,000	
１４１　２０年国債	400,000,000	452,436,000	
１４２　２０年国債	190,000,000	216,752,000	
１４３　２０年国債	210,000,000	235,624,200	
１４４　２０年国債	490,000,000	544,929,000	
１４５　２０年国債	450,000,000	509,476,500	
１４６　２０年国債	350,000,000	396,294,500	
１４７　２０年国債	400,000,000	448,664,000	
１４８　２０年国債	450,000,000	499,725,000	
１４９　２０年国債	532,000,000	590,413,600	
１５０　２０年国債	530,000,000	581,860,500	
１５１　２０年国債	480,000,000	515,260,800	
１５２　２０年国債	460,000,000	493,304,000	
１５３　２０年国債	680,000,000	736,841,200	
１５４　２０年国債	570,000,000	609,934,200	
１５５　２０年国債	440,000,000	459,078,400	
１５６　２０年国債	370,000,000	357,146,200	
１５７　２０年国債	560,000,000	524,367,200	
１５８　２０年国債	350,000,000	340,116,000	
１５９　２０年国債	310,000,000	304,280,500	
１６０　２０年国債	460,000,000	456,145,200	
１６１　２０年国債	420,000,000	409,315,200	
１６２　２０年国債	580,000,000	563,151,000	
１６３　２０年国債	480,000,000	464,294,400	
１６４　２０年国債	600,000,000	569,640,000	
１６５　２０年国債	300,000,000	283,629,000	
１６６　２０年国債	600,000,000	582,588,000	
１６７　２０年国債	400,000,000	375,188,000	
１６８　２０年国債	420,000,000	386,034,600	
１６９　２０年国債	320,000,000	287,984,000	
１７０　２０年国債	420,000,000	376,080,600	

	１７１　２０年国債	500,000,000	445,765,000	
	１７２　２０年国債	200,000,000	180,704,000	
	１７３　２０年国債	510,000,000	459,168,300	
	１７４　２０年国債	600,000,000	538,272,000	
	１７５　２０年国債	400,000,000	364,124,000	
	１７６　２０年国債	580,000,000	526,187,600	
	１７７　２０年国債	530,000,000	470,300,800	
	１７８　２０年国債	420,000,000	378,672,000	
	１７９　２０年国債	380,000,000	341,665,600	
	１８０　２０年国債	490,000,000	464,745,400	
	１８１　２０年国債	500,000,000	482,355,000	
	１８２　２０年国債	140,000,000	139,433,000	
	２７　メキシコ国債	100,000,000	97,237,300	
	１１　フイリピン共和国	100,000,000	100,244,200	
国債証券　合計			104,845,798,810	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	100,760,200	
	１６　東京都２０年	100,000,000	110,254,200	
	３－５　北海道公債	100,000,000	97,322,200	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,710,300	
	３１　神奈川県２０年	100,000,000	102,339,300	
	４２０　大阪府公債	200,000,000	199,324,800	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	100,742,300	
	３　兵庫県公債１２年	200,000,000	202,041,200	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	109,591,800	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	100,820,600	
	２１－５　愛知県公債	100,000,000	112,696,600	
	２９－５　広島県公債	100,000,000	99,989,800	
	４　埼玉県３０年	100,000,000	98,654,500	
	９　埼玉県２０年	100,000,000	112,943,400	
	２９－１　福岡県公債	100,000,000	99,928,600	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	104,612,400	
	１６　千葉県２０年	100,000,000	109,576,900	
	２８－２　新潟県公債	100,000,000	99,971,000	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	100,740,100	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,051,300	
	２７－１　滋賀県公債	100,000,000	101,064,800	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	112,369,000	
	２０－１　神戸市２０年	100,000,000	111,451,300	
	４　川崎市公債３０年	100,000,000	114,919,500	

	２３－４　福岡市２０年	100,000,000	112,341,700	
	２－２　岡山県公債	100,000,000	97,535,600	
地方債証券　合計			2,911,753,400	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	103,878,600	
	２４７　道路機構	200,000,000	173,425,800	
	８６　政保道路機構	100,000,000	111,428,500	
	２２３　政保道路機構	100,000,000	108,959,400	
	２３６　政保道路機構	100,000,000	100,575,600	
	２６１　政保道路機構	200,000,000	201,865,800	
	２８４　政保道路機構	200,000,000	183,621,200	
	２９８　政保道路機構	100,000,000	96,276,500	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	104,811,000	
	１　地方公共団１５年	100,000,000	105,046,400	
	３１　地方公共団２０	100,000,000	110,146,000	
	６５　地方公共団体	100,000,000	100,669,800	
	７１　地方公共団体	100,000,000	100,630,200	
	１２７　都市再生	100,000,000	99,315,800	
	８０　住宅支援機構	100,000,000	105,060,800	
	１２３　住宅支援機構	100,000,000	111,494,900	
	１９　利付商工債	100,000,000	99,774,100	
特殊債券　合計			2,016,980,400	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,368,600	
	６３　中日本高速道	100,000,000	100,946,800	
	１２　アサヒグループＨＤ	100,000,000	99,622,100	
	１１日本たばこ産業	100,000,000	101,044,100	
	５　野村不動産ＨＤ	100,000,000	101,520,700	
	２３　森ビル	100,000,000	93,675,300	
	１４　セブンアンドアイ	100,000,000	99,661,200	
	２０　ＺＨＤ	100,000,000	97,181,800	
	１８　楽天グループ	100,000,000	86,407,800	
	１７　パナソニツク	100,000,000	100,154,000	
	１５　デンソー	100,000,000	99,480,900	
	６　楽天カード	100,000,000	95,907,300	
	１　日生２０２１基金	100,000,000	99,745,000	
	７　凸版印刷	100,000,000	103,542,100	
	１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	100,839,700	
	１６　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	99,570,800	
	７８　トヨタファイナンス	100,000,000	99,528,800	
	７　三井住友海上	100,000,000	99,403,200	

	１３　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	103,230,800	
	１０７東日本旅客鉄	100,000,000	98,947,600	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	110,291,200	
	１５　ソフトバンク	100,000,000	97,226,500	
	５０９　関西電力	100,000,000	99,650,000	
	４８２　九州電力	100,000,000	99,936,900	
	３３２　北海道電力	100,000,000	96,030,100	
	１１　東京電力パワー	100,000,000	99,077,600	
	６５　東京瓦斯	100,000,000	97,144,600	
	４　フアーストリテイリング	100,000,000	101,329,400	
社債券　合計			2,780,464,900	
合計			112,554,997,510	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,248,475,444	2,031,852,254
コール・ローン	9,574,164,291	17,666,040,102
株式	229,141,995,652	267,590,825,704
投資証券	5,638,901,532	6,560,957,279
派生商品評価勘定	448,705,586	654,308,499
未収入金	24,502,132	1,175,053
未収配当金	248,294,417	373,891,289
差入委託証拠金	4,653,123,326	4,463,843,737
流動資産合計	250,978,162,380	299,342,893,917
資産合計	250,978,162,380	299,342,893,917
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	130,578,047	869,807,209
未払金	4,990,970	5,561,220
未払解約金	65,382,000	94,261,100
流動負債合計	200,951,017	969,629,529
負債合計	200,951,017	969,629,529
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	61,024,141,090	69,133,888,947
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	189,753,070,273	229,239,375,441
元本等合計	250,777,211,363	298,373,264,388
純資産合計	250,777,211,363	298,373,264,388
負債純資産合計	250,978,162,380	299,342,893,917

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年12月1日 至　2022年11月30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、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．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、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
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	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. ※1　期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	54,067,455,177円	61,024,141,090円
期中追加設定元本額	13,499,704,777円	13,890,679,058円
期中一部解約元本額	6,543,018,864円	5,780,931,201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	372,377,534円	308,081,421円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,453,234円	3,459,588円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	59,956,664円	38,681,400円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	7,408,815円	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	236,485,519円	180,994,510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）	36,674,409円	67,499,826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）	508,352,729円	507,554,812円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	2,520,260,966円	2,997,935,211円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	513,644,174円	637,435,268円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	15,304,858円	18,410,629円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	32,174,123円	45,911,834円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	4,063,382,462円	5,903,409,265円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,116,648,157円	1,346,263,819円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	171,426,649円	249,849,751円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	38,249,671,210円	43,789,686,887円
ダイワ・ライフ・バランス３０	500,854,698円	521,693,855円
ダイワ・ライフ・バランス５０	919,288,192円	1,000,508,647円
ダイワ・ライフ・バランス７０	740,101,154円	822,473,467円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,732,619,609円	1,893,327,736円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,075,244円	12,179,865円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	10,707,802円	12,114,090円
ダイワつみたてインデックス外国株式	811,486,824円	1,381,872,090円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,690,959円	1,875,196円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,170,527円	2,222,293円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,559,196円	4,706,722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）	－円	4,098,586円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	107,882,488円	72,721,941円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	208,152,302円	53,797,340円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,461,676,506円	1,210,030,069円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	73,896,117円	62,518,246円
ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）	211,630,253円	－円

	ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	212,845,169円	173,081,567円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	927,057,365円	1,145,121,735円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	324,437,993円	424,216,950円
	ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	1,929,148,713円	1,263,595,028円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,822,903,027円	2,883,082,448円
	ダイワライフスタイル２５	12,346,386円	10,488,019円
	ダイワライフスタイル５０	49,688,514円	43,394,568円
	ダイワライフスタイル７５	39,700,549円	33,119,707円
	計	61,024,141,090円	69,133,888,947円
2.	期末日における受益権の総数	61,024,141,090口	69,133,888,947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　2021年12月1日 至　2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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	2022年11月30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	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2022年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	41,450,751,465	△39,581,029,860
投資証券	1,091,405,878	△1,505,805,187
合計	42,542,157,343	△41,086,835,047

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	2021年11月30日 現在				2022年11月30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	15,914,463,645	－	16,312,448,688	397,985,043	23,750,625,017	－	24,154,881,137	404,256,120
合計	15,914,463,645	－	16,312,448,688	397,985,043	23,750,625,017	－	24,154,881,137	404,256,120

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種　類	2021年11月30日 現在				2022年11月30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	9,828,774,794	－	9,748,917,290	△79,857,504	17,573,621,210	－	16,953,866,380	△619,754,830
アメリカ・ドル	7,046,626,660	－	7,027,555,314	△19,071,346	12,336,972,570	－	11,834,462,290	△502,510,280
イギリス・ポンド	308,287,051	－	301,604,400	△6,682,651	828,018,030	－	813,955,170	△14,062,860
イスラエル・シュケル	－	－	－	－	32,484,240	－	32,263,680	△220,560
オーストラリア・ドル	286,703,319	－	274,744,314	△11,959,005	594,996,870	－	584,194,590	△10,802,280
カナダ・ドル	439,283,847	－	428,403,360	△10,880,487	847,777,660	－	806,418,570	△41,359,090
スイス・フラン	443,805,440	－	440,052,480	△3,752,960	829,345,070	－	815,725,680	△13,619,390

ユーロ	1,304,068,477	－	1,276,557,422	△27,511,055	2,104,026,770	－	2,066,846,400	△37,180,370
合計	9,828,774,794	－	9,748,917,290	△79,857,504	17,573,621,210	－	16,953,866,380	△619,754,830

（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）

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	4.1095円	4.3159円
（1万口当たり純資産額）	(41,095円)	(43,159円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,900	142.820	699,818.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	12,300	170.510	2,097,273.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,500	173.110	1,298,325.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,400	106.070	572,778.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,600	155.650	404,690.000	

SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	37.280	786,608.000	
ABBOTT LABORATORIES	72,366	105.000	7,598,430.000	
HOWMET AEROSPACE INC	15,583	37.220	579,999.260	
VERISK ANALYTICS INC	6,500	176.930	1,150,045.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	13,900	44.660	620,774.000	
AMPHENOL CORP-CL A	24,700	77.400	1,911,780.000	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,800	354.950	638,910.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	25,300	67.530	1,708,509.000	
QORVO INC	4,420	93.980	415,391.600	
AFLAC INC	25,300	70.880	1,793,264.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,100	144.960	739,296.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,100	70.210	498,491.000	
ADOBE INC	19,520	326.780	6,378,745.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,600	106.400	915,040.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,800	363.320	1,743,936.000	
GARMIN LTD	6,300	89.810	565,803.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,200	302.180	2,780,056.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,200	216.720	6,111,504.000	
WR BERKLEY CORP	8,642	75.040	648,495.680	
AUTOZONE INC	820	2,556.050	2,095,961.000	
DOLLAR TREE INC	9,271	146.500	1,358,201.500	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	47,800	8.670	414,426.000	
CELANESE CORP	4,450	105.550	469,697.500	
DR HORTON INC	13,816	84.220	1,163,583.520	
DENTSPLY SIRONA INC	8,900	30.210	268,869.000	
AUTODESK INC	9,000	195.180	1,756,620.000	
MOODY'S CORP	6,900	289.530	1,997,757.000	
DEVON ENERGY CORP	25,900	67.500	1,748,250.000	
ALBEMARLE CORP	4,800	270.020	1,296,096.000	
ATMOS ENERGY CORP	5,800	118.640	688,112.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,200	55.070	561,714.000	
CITIGROUP INC	80,473	47.570	3,828,100.610	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,400	257.060	4,472,844.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,300	94.650	2,016,045.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	383.060	586,081.800	
HESS CORP	11,600	141.980	1,646,968.000	

DAVITA INC	2,750	71.650	197,037.500	
DANAHER CORP	28,650	259.020	7,420,923.000	
FORTIVE CORP	14,100	65.600	924,960.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	23,100	105.340	2,433,354.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,300	96.450	2,247,285.000	
BUNGE LTD	6,300	104.160	656,208.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,195	123.940	1,635,388.300	
APPLE INC	670,000	141.170	94,583,900.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,600	108.550	1,259,180.000	
BOEING CO/THE	23,300	175.320	4,084,956.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,215	108.130	672,027.950	
BECTON DICKINSON AND CO	11,799	241.020	2,843,794.980	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,400	108.500	585,900.000	
NISOURCE INC	16,500	27.230	449,295.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,300	97.600	517,280.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	31,771	44.840	1,424,611.640	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	173,704	38.340	6,659,811.360	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	53,250	315.130	16,780,672.500	
ANSYS INC	3,600	240.630	866,268.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	55,117	45.910	2,530,421.470	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	29,000	88.210	2,558,090.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	88,300	79.030	6,978,349.000	
JPMORGAN CHASE & CO	121,470	136.560	16,587,943.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,300	120.500	1,120,650.000	
LKQ CORP	11,100	52.930	587,523.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,812	71.120	911,189.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,400	163.520	1,864,128.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,500	324.480	1,460,160.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,400	252.850	2,376,790.000	
SERVICENOW INC	8,300	396.850	3,293,855.000	
CATERPILLAR INC	22,100	235.120	5,196,152.000	
BROWN & BROWN INC	9,700	57.360	556,392.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,300	47.050	484,615.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,100	239.500	502,950.000	
CMS ENERGY CORP	12,000	60.200	722,400.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	50.730	755,877.000	
DELTA AIR LINES INC	6,200	34.610	214,582.000	

CORNING INC	33,200	33.410	1,109,212.000	
CISCO SYSTEMS INC	171,350	48.280	8,272,778.000	
MORGAN STANLEY	54,152	91.080	4,932,164.160	
MSCI INC	3,400	486.320	1,653,488.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	590.740	649,814.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	260.830	339,079.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,400	51.630	485,322.000	
BROADCOM INC	16,712	521.390	8,713,469.680	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,000	204.790	1,023,950.000	
ARAMARK	9,600	40.570	389,472.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,900	114.130	901,627.000	
CENTENE CORP	24,207	84.420	2,043,554.940	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,400	123.250	542,300.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,200	41.790	844,158.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,700	195.680	1,702,416.000	
GARTNER INC	3,350	340.080	1,139,268.000	
SPLUNK INC	6,700	75.890	508,463.000	
DOMINION ENERGY INC	33,541	59.770	2,004,745.570	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,400	99.790	1,636,556.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	60.490	320,597.000	
DEERE & CO	12,000	440.970	5,291,640.000	
QUANTA SERVICES INC	6,000	144.550	867,300.000	
POOL CORP	1,700	320.750	545,275.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,684	99.830	1,166,413.720	
VMWARE INC-CLASS A	8,700	118.030	1,026,861.000	
CABLE ONE INC	200	719.970	143,994.000	
BURLINGTON STORES INC	2,700	192.490	519,723.000	
NASDAQ INC	14,300	66.100	945,230.000	
VAIL RESORTS INC	1,700	256.300	435,710.000	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,900	7.430	155,287.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,000	73.720	663,480.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,000	139.960	419,880.000	
WESTLAKE CORP	1,600	107.170	171,472.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,700	96.300	1,415,610.000	
COGNEX CORP	6,900	47.750	329,475.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,300	53.400	389,820.000	
TELEFLEX INC	1,900	226.150	429,685.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,500	179.830	629,405.000	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,100	223.500	692,850.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	900	399.550	359,595.000	
CATALENT INC	6,900	47.180	325,542.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,800	182.440	1,058,152.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,400	322.720	774,528.000	
CARLISLE COS INC	2,200	255.530	562,166.000	
IDEX CORP	3,100	231.060	716,286.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,900	75.970	2,499,413.000	
ROLLINS INC	9,207	39.830	366,714.810	
AMETEK INC	9,600	139.010	1,334,496.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,000	79.490	794,900.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	54.790	353,395.500	
HEICO CORP	1,800	156.570	281,826.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,600	100.660	261,716.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	449.120	718,592.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,800	84.840	916,272.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,700	324.150	551,055.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	18,260	528.960	9,658,809.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,250	56.920	184,990.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,400	343.940	825,456.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,300	101.670	538,851.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,200	1,552.720	1,863,264.000	
UGI CORP	8,500	37.840	321,640.000	
CUMMINS INC	5,800	246.420	1,429,236.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,300	74.340	2,401,182.000	
CDW CORP/DE	5,600	184.080	1,030,848.000	
SIGNATURE BANK	2,650	135.580	359,287.000	
COSTAR GROUP INC	16,400	78.250	1,283,300.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,400	219.130	525,912.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,000	292.070	1,168,280.000	
MERCADOLIBRE INC	1,890	889.260	1,680,701.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,000	185.900	557,700.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,516	138.750	1,597,845.000	
DEXCOM INC	16,200	110.390	1,788,318.000	
NORDSON CORP	2,090	230.800	482,372.000	
COPART INC	17,400	64.440	1,121,256.000	

DIAMONDBACK ENERGY INC	7,000	146.740	1,027,180.000	
SEAGEN INC	5,700	117.370	669,009.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,100	191.830	594,673.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,300	239.910	791,703.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,090	609.880	1,274,649.200	
BIO-TECHNE CORP	1,580	327.070	516,770.600	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,900	121.740	474,786.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,000	78.760	708,840.000	
KINDER MORGAN INC	84,381	18.880	1,593,113.280	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	235.810	2,310,938.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,600	256.080	409,728.000	
COTERRA ENERGY INC	33,000	28.070	926,310.000	
T-MOBILE US INC	25,927	148.620	3,853,270.740	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	35.310	238,342.500	
COCA-COLA CO/THE	170,450	62.480	10,649,716.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,800	51.570	453,816.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	113.560	789,242.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,400	26.300	326,120.000	
CSX CORP	89,900	32.170	2,892,083.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,800	239.780	911,164.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,325	102.450	647,996.250	
AMAZON.COM INC	378,800	92.420	35,008,696.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25,700	74.850	1,923,645.000	
EXXON MOBIL CORP	174,205	110.540	19,256,620.700	
AES CORP	27,100	28.260	765,846.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	332.800	532,480.000	
EOG RESOURCES INC	24,200	141.290	3,419,218.000	
EQT CORP	14,100	42.660	601,506.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,500	91.030	591,695.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	799.620	399,810.000	
ABIOMED INC	1,900	377.330	716,927.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,500	167.900	1,091,350.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,400	150.940	1,871,656.000	
FORD MOTOR CO	163,423	13.750	2,247,066.250	
EXACT SCIENCES CORP	7,100	41.190	292,449.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,237	19.720	122,993.640	
ENTEGRIS INC	6,200	72.390	448,818.000	

AERCAP HOLDINGS NV	5,600	60.240	337,344.000	
FORTINET INC	28,200	51.590	1,454,838.000	
MARKEL CORP	550	1,290.610	709,835.500	
NEXTERA ENERGY INC	81,280	82.490	6,704,787.200	
MASIMO CORP	2,200	140.650	309,430.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	59,908	37.510	2,247,149.080	
INSULET CORP	2,900	288.560	836,824.000	
US BANCORP	58,400	44.590	2,604,056.000	
UNITED RENTALS INC	3,000	342.730	1,028,190.000	
F5 NETWORKS INC	2,500	149.820	374,550.000	
FASTENAL CO	23,800	50.270	1,196,426.000	
FISERV INC	25,433	101.520	2,581,958.160	
GENERAL ELECTRIC CO	45,506	85.660	3,898,043.960	
GENERAL MOTORS CO	57,300	39.750	2,277,675.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,800	251.220	2,461,956.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,250	383.710	5,467,867.500	
ALPHABET INC-CL A	248,800	95.190	23,683,272.000	
ALPHABET INC-CL C	233,340	95.440	22,269,969.600	
OWENS CORNING	3,900	89.630	349,557.000	
GENERAL MILLS INC	24,900	82.840	2,062,716.000	
FIRSTENERGY CORP	22,418	39.800	892,236.400	
GENUINE PARTS CO	5,950	180.550	1,074,272.500	
FIFTH THIRD BANCORP	28,400	36.000	1,022,400.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,050	225.610	1,816,160.500	
HALLIBURTON CO	37,300	37.160	1,386,068.000	
HOME DEPOT INC	42,550	315.960	13,444,098.000	
ASSURANT INC	2,250	126.390	284,377.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	59,500	15.300	910,350.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,710	228.020	389,914.200	
HERSHEY CO/THE	6,000	230.490	1,382,940.000	
HUMANA INC	5,200	533.140	2,772,328.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,900	164.690	1,795,121.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,320	35.090	116,498.800	
HENRY SCHEIN INC	5,600	80.600	451,360.000	
HP INC	47,300	28.880	1,366,024.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	53,800	15.460	831,748.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	42.890	292,852.920	

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,900	59.140	467,206.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	43.070	127,056.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,400	58.980	908,292.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	30,403	39.040	1,186,933.120	
ENPHASE ENERGY INC	5,600	303.390	1,698,984.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	37,200	146.490	5,449,428.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,300	36.330	519,519.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	65.740	341,848.000	
ZOETIS INC	19,500	147.850	2,883,075.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,699	174.990	1,697,228.010	
CHENIERE ENERGY INC	9,500	172.650	1,640,175.000	
ALLEGION PLC	3,650	110.770	404,310.500	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	20.460	265,427.580	
WASTE CONNECTIONS INC	10,637	140.820	1,497,902.340	
JUNIPER NETWORKS INC	13,400	31.870	427,058.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,400	151.520	666,688.000	
JOHNSON & JOHNSON	108,900	176.090	19,176,201.000	
PLUG POWER INC	21,100	14.900	314,390.000	
ABBVIE INC	73,072	158.200	11,559,990.400	
HOLOGIC INC	10,100	74.370	751,137.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	13,900	133.160	1,850,924.000	
KROGER CO	28,600	49.350	1,411,410.000	
KLA CORP	6,200	374.330	2,320,846.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,900	484.100	4,792,590.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	190.200	589,620.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	39.790	417,795.000	
LOWE'S COS INC	27,200	207.470	5,643,184.000	
ELI LILLY & CO	33,385	363.950	12,150,470.750	
LAM RESEARCH CORP	5,680	442.050	2,510,844.000	
LOEWS CORP	8,600	57.780	496,908.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	38.090	253,260.410	
MCDONALD'S CORP	30,650	271.410	8,318,716.500	
3M CO	23,490	126.130	2,962,793.700	
META PLATFORMS INC CLASS A	94,800	109.460	10,376,808.000	
S&P GLOBAL INC	14,439	347.140	5,012,354.460	

MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,600	357.540	929,604.000	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,320	290.850	674,772.000	
ALCOA CORP	7,700	47.700	367,290.000	
PHILLIPS 66	19,900	108.970	2,168,503.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	35.860	575,553.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,400	83.750	871,000.000	
METLIFE INC	28,400	76.070	2,160,388.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	35,200	42.910	1,510,432.000	
ARISTA NETWORKS INC	10,200	133.710	1,363,842.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,898	264.460	1,824,245.080	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	900	1,412.210	1,270,989.000	
BAKER HUGHES CO	40,823	28.650	1,169,578.950	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,800	259.630	1,246,224.000	
MERCK & CO. INC.	104,621	108.840	11,386,949.640	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	69.460	1,441,364.460	
MASCO CORP	9,800	49.870	488,726.000	
M & T BANK CORP	7,399	170.920	1,264,637.080	
MARSH & MCLENNAN COS	20,770	168.680	3,503,483.600	
BLACK KNIGHT INC	6,350	60.750	385,762.500	
HEICO CORP-CLASS A	3,020	122.430	369,738.600	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,502	161.260	1,854,812.520	
WORKDAY INC-CLASS A	8,200	143.300	1,175,060.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,900	31.670	91,843.000	
BLOCK INC CLASS A	21,512	62.110	1,336,110.320	
TRANSUNION	8,000	60.460	483,680.000	
VISTRA CORP	17,600	24.230	426,448.000	
NOVOCURE LTD	3,850	74.680	287,518.000	
NETAPP INC	9,200	71.790	660,468.000	
NIKE INC -CL B	52,500	106.250	5,578,125.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,900	253.360	2,508,264.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,900	74.220	1,699,638.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,105	115.370	935,073.850	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	26.510	376,442.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,100	528.350	3,222,935.000	
APTIV PLC	11,200	101.880	1,141,056.000	
NEWMONT CORP	32,811	45.760	1,501,431.360	
MCKESSON CORP	6,100	381.780	2,328,858.000	

XYLEM INC	7,300	109.880	802,124.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	64,100	97.790	6,268,339.000	
NUCOR CORP	11,100	146.990	1,631,589.000	
WESTERN UNION CO	15,246	14.470	220,609.620	
GODADDY INC - CLASS A	6,800	75.070	510,476.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	12.870	211,608.540	
EVERGY INC	9,350	58.070	542,954.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,824	69.110	2,683,126.640	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,150	269.240	309,626.000	
OKTA INC	6,200	51.250	317,750.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,900	61.460	178,234.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	89.430	500,808.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	12.250	211,986.250	
LINDE PLC	20,846	331.970	6,920,246.620	
WIX.COM LTD	2,310	84.550	195,310.500	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	30.840	487,272.000	
KKR & CO INC	23,300	50.550	1,177,815.000	
PAYCHEX INC	13,400	120.150	1,610,010.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	849.730	2,294,271.000	
ALTRIA GROUP INC	74,900	45.820	3,431,918.000	
P G & E CORP	61,700	15.170	935,989.000	
PFIZER INC	232,113	49.490	11,487,272.370	
CIGNA CORP	13,100	320.700	4,201,170.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	43.520	513,579.520	
XCEL ENERGY INC	22,500	68.850	1,549,125.000	
STERIS PLC	4,100	178.390	731,399.000	
SEA LTD-ADR	15,500	54.260	841,030.000	
FOX CORP - CLASS B	6,033	29.940	180,628.020	
FOX CORP - CLASS A	12,799	31.720	405,984.280	
STRYKER CORP	14,080	227.200	3,198,976.000	
LYFT INC-A	12,500	10.760	134,500.000	
DOW INC	30,118	50.650	1,525,476.700	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,500	58.530	263,385.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,400	70.570	663,358.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,300	294.290	1,559,737.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	60,900	27.760	1,690,584.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,500	240.780	2,287,410.000	

PROCTER & GAMBLE CO/THE	99,267	145.480	14,441,363.160	
EXELON CORP	40,522	40.000	1,620,880.000	
TELADOC HEALTH INC	6,500	27.130	176,345.000	
INGERSOLL-RAND INC	16,808	52.820	887,798.560	
NVR INC	130	4,557.920	592,529.600	
CONOCOPHILLIPS	53,502	124.250	6,647,623.500	
TWILIO INC - A	7,000	45.750	320,250.000	
DOCUSIGN INC	8,300	44.560	369,848.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,100	321.980	676,158.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,700	64.110	365,427.000	
PEPSICO INC	57,200	182.590	10,444,148.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,820	150.890	274,619.800	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	22.540	272,734.000	
MONGODB INC	2,800	142.300	398,440.000	
SNAP INC - A	45,800	9.820	449,756.000	
CORTEVA INC	29,868	65.570	1,958,444.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,500	106.590	1,652,145.000	
AMCOR PLC	61,400	12.110	743,554.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,400	138.000	1,159,200.000	
ROKU INC	4,800	54.180	260,064.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,500	147.140	1,103,550.000	
ACCENTURE PLC-CL A	26,200	287.980	7,545,076.000	
PENTAIR PLC	6,675	44.680	298,239.000	
QUALCOMM INC	46,300	118.380	5,480,994.000	
INVESCO LTD	14,100	18.840	265,644.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,550	147.930	377,221.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	89.840	952,304.000	
DATADOG INC - CLASS A	10,000	72.060	720,600.000	
PINTEREST INC- CLASS A	23,800	24.000	571,200.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,500	736.080	3,312,360.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,100	136.650	1,243,515.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	2,017.160	3,429,172.000	
ROSS STORES INC	14,500	116.790	1,693,455.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,830	132.690	508,202.700	
RESMED INC	6,100	223.200	1,361,520.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,930	149.010	734,619.300	
ROBERT HALF INTL INC	4,500	76.210	342,945.000	

MODERNA INC	13,900	173.150	2,406,785.000	
HUBSPOT INC	1,880	282.680	531,438.400	
PERKINELMER INC	5,100	133.650	681,615.000	
CARRIER GLOBAL CORP	35,087	43.520	1,526,986.240	
OTIS WORLDWIDE CORP	17,538	76.880	1,348,321.440	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,900	114.670	447,213.000	
AVANTOR INC	24,800	21.310	528,488.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,000	29.880	239,040.000	
DYNATRACE INC	8,100	36.390	294,759.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	18,300	48.690	891,027.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	38,685	22.910	886,273.350	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	26.530	291,830.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,400	43.070	620,208.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,230	48.590	156,945.700	
MATCH GROUP INC	11,600	46.880	543,808.000	
CHEVRON CORP	77,218	181.030	13,978,774.540	
ZSCALER INC	3,500	134.850	471,975.000	
EDISON INTERNATIONAL	15,800	63.510	1,003,458.000	
ETSY INC	5,200	121.880	633,776.000	
TESLA INC	109,150	180.830	19,737,594.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,200	136.560	1,256,352.000	
GEN DIGITAL INC	23,600	22.620	533,832.000	
UNITY SOFTWARE INC	7,900	36.020	284,558.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	80.510	531,527.020	
SYNOPSYS INC	6,300	323.660	2,039,058.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,950	40.200	158,790.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,500	44.610	468,405.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	385.280	1,889,798.400	
VIATRIS INC	49,021	11.180	548,054.780	
DOORDASH INC - A	7,850	53.340	418,719.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	14,600	29.830	435,518.000	
AIRBNB INC-CLASS A	15,600	95.380	1,487,928.000	
CBRE GROUP INC - A	13,600	76.460	1,039,856.000	
SOUTHERN CO/THE	44,000	65.730	2,892,120.000	
SYSCO CORP	21,100	85.090	1,795,399.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,903	187.210	1,853,940.630	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	58.500	146,250.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,600	61.380	282,348.000	

STEEL DYNAMICS INC	7,850	102.640	805,724.000	
SCHLUMBERGER LTD	58,452	51.050	2,983,974.600	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	44.000	272,800.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	12.810	98,637.000	
AT&T INC	296,191	19.010	5,630,590.910	
APA CORP	14,400	46.590	670,896.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,050	39.250	237,462.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	18,000	70.720	1,272,960.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,700	48.870	425,169.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,200	241.570	2,464,014.000	
SEMPRA ENERGY	13,000	161.320	2,097,160.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,800	37.500	292,500.000	
CLARIVATE PLC	13,400	9.170	122,878.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,500	7.080	484,980.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	51.450	434,752.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,900	43.110	211,239.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,100	172.980	6,590,538.000	
SALESFORCE.COM INC	41,066	151.680	6,228,890.880	
WESTROCK CO	10,700	36.720	392,904.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	16,609	65.850	1,093,702.650	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	28,834	65.400	1,885,743.600	
TERADYNE INC	6,600	89.190	588,654.000	
UNION PACIFIC CORP	25,980	212.770	5,527,764.600	
MARATHON OIL CORP	29,900	30.350	907,465.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	123.470	2,961,798.360	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	61,479	97.430	5,989,898.970	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,400	184.890	5,620,656.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,804	212.500	1,658,350.000	
AMEREN CORPORATION	10,700	87.240	933,468.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,766	528.000	20,468,448.000	
APPLOVIN CORP CLASS A	4,900	13.440	65,856.000	
VERISIGN INC	4,100	194.960	799,336.000	
LUCID GROUP INC	16,800	9.760	163,968.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	13,200	28.850	380,820.000	

VALERO ENERGY CORP	16,942	135.200	2,290,558.400	
ULTA BEAUTY INC	2,200	449.880	989,736.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,888	39.570	430,838.160	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	130.550	369,456.500	
ELEVANCE HEALTH INC	10,000	515.360	5,153,600.000	
WALT DISNEY CO/THE	75,262	94.690	7,126,558.780	
WELLS FARGO & CO	156,722	47.570	7,455,265.540	
WASTE MANAGEMENT INC	17,200	165.080	2,839,376.000	
WILLIAMS COS INC	50,400	34.320	1,729,728.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,600	219.010	1,007,446.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	145.980	350,352.000	
WALMART INC	62,600	152.970	9,575,922.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,700	119.000	1,035,300.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	80.290	361,305.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	55,900	2.830	158,197.000	
WABTEC CORP	7,111	98.700	701,855.700	
TJX COMPANIES INC	48,400	80.160	3,879,744.000	
WATERS CORP	2,500	330.160	825,400.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	266.820	587,004.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,400	41.080	1,248,832.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	238.500	1,159,825.500	
WESTERN DIGITAL CORP	12,700	36.030	457,581.000	
WEC ENERGY GROUP INC	13,000	96.980	1,260,740.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,400	58.290	1,189,116.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	68,150	209.060	14,247,439.000	
PPL CORP	30,400	29.020	882,208.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	13,524	94.430	1,277,071.320	
PULTEGROUP INC	9,850	44.090	434,286.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	95,453	11.140	1,063,346.420	
PPG INDUSTRIES INC	9,800	131.830	1,291,934.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,200	91.760	752,432.000	
NVIDIA CORP	103,580	156.390	16,198,876.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,113	164.370	2,812,863.810	

ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	21.420	74,970.000	
TYSON FOODS INC-CL A	12,100	66.450	804,045.000	
NETFLIX INC	18,390	280.960	5,166,854.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,200	539.750	8,743,950.000	
NRG ENERGY INC	9,850	41.910	412,813.500	
GLOBE LIFE INC	3,855	117.300	452,191.500	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,400	121.570	899,618.000	
TEXTRON INC	8,900	70.330	625,937.000	
NEWS CORP - CLASS A	15,287	18.560	283,726.720	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	250	2,506.380	626,595.000	
OMNICOM GROUP	8,300	78.760	653,708.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,220	122.770	640,859.400	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	20,900	1.050	21,945.000	
ORACLE CORP	66,233	80.850	5,354,938.050	
MASTERCARD INC - A	35,900	343.130	12,318,367.000	
ONEOK INC	18,500	64.910	1,200,835.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	37,352	5.470	204,315.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,400	425.250	1,871,100.000	
AMERCO NON VOTING SERIES N	3,600	60.180	216,648.000	
YUM! BRANDS INC	11,700	126.040	1,474,668.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	6,600	101.350	668,910.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,400	54.920	406,408.000	
BANK OF AMERICA CORP	299,901	37.000	11,096,337.000	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,900	408.780	776,682.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,700	97.120	747,824.000	
AMERICAN EXPRESS CO	26,500	154.420	4,092,130.000	
ANALOG DEVICES INC	21,491	163.890	3,522,159.990	
ADVANCED MICRO DEVICES	67,027	73.390	4,919,111.530	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	61.440	2,025,799.680	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,600	90.270	595,782.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,300	59.930	557,349.000	
AVERY DENNISON CORP	3,430	188.420	646,280.600	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,600	59.620	1,287,792.000	
EMERSON ELECTRIC CO	24,600	94.310	2,320,026.000	

AON PLC-CLASS A	8,800	302.730	2,664,024.000	
AMGEN INC	22,600	281.990	6,372,974.000	
EATON CORP PLC	16,536	162.150	2,681,312.400	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	253.640	1,699,388.000	
APPLIED MATERIALS INC	36,000	103.250	3,717,000.000	
CME GROUP INC	14,900	174.810	2,604,669.000	
ECOLAB INC	10,600	144.910	1,536,046.000	
EQUIFAX INC	5,100	188.920	963,492.000	
GILEAD SCIENCES INC	51,900	85.760	4,450,944.000	
KEURIG DR PEPPER INC	32,300	38.100	1,230,630.000	
HORMEL FOODS CORP	12,400	48.190	597,556.000	
STATE STREET CORP	15,213	73.930	1,124,697.090	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,140	80.390	4,834,654.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,800	55.340	1,151,072.000	
CAMPBELL SOUP CO	8,600	52.620	452,532.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	80.230	399,545.400	
CARDINAL HEALTH INC	11,300	78.650	888,745.000	
FEDEX CORP	10,200	177.820	1,813,764.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	102.080	1,710,248.320	
FMC CORP	5,150	127.710	657,706.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,513	102.400	1,076,531.200	
INTEL CORP	169,200	28.900	4,889,880.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,000	34.310	548,960.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,450	75.830	1,019,913.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,900	224.370	2,894,373.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.410	247,426.000	
ILLUMINA INC	6,500	208.570	1,355,705.000	
SEALED AIR CORP	5,800	52.030	301,774.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	14,900	258.800	3,856,120.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	131.030	569,980.500	
SNAP-ON INC	2,200	239.180	526,196.000	
CARMAX INC	6,600	67.120	442,992.000	
DUKE ENERGY CORP	31,828	97.940	3,117,234.320	
TARGET CORP	19,400	166.370	3,227,578.000	
DOVER CORP	6,000	139.370	836,220.000	
WW GRAINGER INC	1,900	590.990	1,122,881.000	
CINTAS CORP	3,800	450.690	1,712,622.000	
CONAGRA BRANDS INC	19,900	36.960	735,504.000	

CLOROX COMPANY	5,100	147.430	751,893.000	
ENTERGY CORP	8,400	112.810	947,604.000	
MICROSOFT CORP	294,100	240.330	70,681,053.000	
INCYTE CORP	7,600	77.800	591,280.000	
CVS HEALTH CORP	54,169	100.880	5,464,568.720	
MEDTRONIC PLC	54,998	76.480	4,206,247.040	
MICRON TECHNOLOGY INC	46,200	55.120	2,546,544.000	
BLACKROCK INC	6,300	714.000	4,498,200.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	26,000	30.580	795,080.000	
HASBRO INC	5,400	62.170	335,718.000	
KELLOGG CO	10,400	72.400	752,960.000	
KEYCORP	38,600	18.570	716,802.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	57,211	66.050	3,778,786.550	
COOPER COS INC/THE	2,000	307.440	614,880.000	
CHUBB LTD	17,599	216.680	3,813,351.320	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	106.230	286,821.000	
ALLSTATE CORP	11,400	133.380	1,520,532.000	
EBAY INC	24,900	43.770	1,089,873.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	45,550	77.640	3,536,502.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	85.250	443,300.000	
DISH NETWORK CORP-A	9,600	15.680	150,528.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,600	214.940	2,063,424.000	
TRIMBLE INC	10,200	56.390	575,178.000	
LENNAR CORP-A	10,600	86.400	915,840.000	
LEAR CORP	2,500	140.150	350,375.000	
PROGRESSIVE CORP	24,200	131.120	3,173,104.000	
PACCAR INC	14,437	104.260	1,505,201.620	
BIOGEN INC	6,100	291.410	1,777,601.000	
IDEXX LABORATORIES INC	3,500	408.960	1,431,360.000	
STARBUCKS CORP	47,400	98.660	4,676,484.000	
PTC INC	4,600	123.070	566,122.000	
EVERSOURCE ENERGY	14,300	80.650	1,153,295.000	
INTUIT INC	11,080	379.710	4,207,186.800	
BORGWARNER INC	9,700	41.930	406,721.000	
BEST BUY CO INC	8,850	84.160	744,816.000	
BALL CORP	13,004	54.740	711,838.960	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,097	44.500	2,629,816.500	
ELECTRONIC ARTS INC	11,600	127.590	1,480,044.000	

	VULCAN MATERIALS CO	5,500	178.450	981,475.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,600	316.330	3,353,098.000	
	VF CORP	13,400	32.460	434,964.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	25,225	19.750	498,193.750	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	100.940	222,068.000	
	CARNIVAL CORP	40,900	9.750	398,775.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	15.140	330,052.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	184,790	35.480	6,556,349.200	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	48.600	422,820.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	48,600	3.980	193,428.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 1,414,769,604.940 (196,469,055,038)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	305,297	24.005	7,328,654.480	
	HALEON PLC	204,162	2.853	582,576.260	
	BP PLC	788,177	4.920	3,878,224.920	
	UNILEVER PLC	104,121	41.245	4,294,470.640	
	BARCLAYS PLC	683,263	1.610	1,100,053.430	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	336,390	0.891	299,790.760	
	PRUDENTIAL PLC	112,204	9.648	1,082,544.190	
	NATWEST GROUP PLC	218,395	2.605	568,918.970	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	21.370	150,957.680	
	BAE SYSTEMS PLC	128,820	8.104	1,043,957.280	
	AVIVA PLC	115,648	4.486	518,796.920	
	AVEVA GROUP PLC	4,948	31.760	157,148.480	
	GSK	165,976	14.178	2,353,207.720	
	INFORMA PLC	60,095	6.104	366,819.880	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	178,792	1.314	235,022.080	
	AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	5.648	214,635.290	
	DCC PLC	3,964	44.750	177,389.000	
	OCADO GROUP PLC	23,827	6.170	147,012.590	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,900	112.100	325,090.000	
	HALMA PLC	15,260	21.280	324,732.800	
	ENTAIN PLC	24,059	13.975	336,224.520	
	JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.244	124,076.650	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	5.960	179,801.280	
	M&G PLC	104,504	1.922	200,908.940	

RELX PLC	78,540	22.900	1,798,566.000	
DIAGEO PLC	93,276	37.680	3,514,639.680	
RIO TINTO PLC	45,886	55.630	2,552,638.180	
STANDARD CHARTERED PLC	104,659	6.090	637,373.310	
TESCO PLC	306,336	2.330	713,762.880	
SMITH & NEPHEW PLC	35,311	10.780	380,652.580	
GLENCORE PLC	402,288	5.508	2,215,802.300	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	8.506	112,704.500	
SMITHS GROUP PLC	15,383	15.960	245,512.680	
PEARSON PLC	28,363	9.840	279,091.920	
SAINSBURY (J) PLC	71,864	2.231	160,328.580	
NEXT PLC	5,311	57.400	304,851.400	
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.021	149,753.130	
WHITBREAD PLC	8,127	25.860	210,164.220	
BUNZL PLC	13,562	30.660	415,810.920	
VODAFONE GROUP PLC	1,081,003	0.918	992,793.150	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,601	67.120	375,939.120	
KINGFISHER PLC	78,711	2.408	189,536.080	
WPP PLC	45,847	8.684	398,135.340	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	27,881	10.260	286,059.060	
SEVERN TRENT PLC	10,232	27.140	277,696.480	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,706	5.356	400,125.330	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,182	59.400	1,733,410.800	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,732	11.535	250,678.620	
SCHRODERS PLC	27,352	4.508	123,302.810	
SSE PLC	43,575	16.760	730,317.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,500	3.981	157,249.500	
ASTRAZENECA PLC	63,233	110.600	6,993,569.800	
FERGUSON PLC	8,777	94.900	832,937.300	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	239,689	2.544	609,768.810	
3I GROUP PLC	39,073	13.405	523,773.560	
ASHTEAD GROUP PLC	17,854	49.910	891,093.140	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	7.860	315,296.040	
NATIONAL GRID PLC	148,817	10.085	1,500,819.440	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.463	1,320,268.520	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	21.230	810,158.030	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	37.830	160,096.560	

	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	87,850	33.505	2,943,414.250	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,800	15.850	218,730.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	819,921	5.103	4,184,056.860	
	ANGLO AMERICAN PLC	51,856	32.895	1,705,803.120	
	MONDI PLC	19,853	15.560	308,912.680	
	COMPASS GROUP PLC	72,800	18.305	1,332,604.000	
	PERSIMMON PLC	12,832	12.700	162,966.400	
	BT GROUP PLC	345,300	1.228	424,201.050	
	COCA-COLA HBC AG-DI	7,800	20.180	157,404.000	
	BURBERRY GROUP PLC	16,061	21.400	343,705.400	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,523	47.450	356,966.350	
	INTERTEK GROUP PLC	6,481	39.440	255,610.640	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,450	80.440	1,081,918.000	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	14.965	98,769.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,500	20.270	152,025.000	
	ANTOFAGASTA PLC	15,300	13.640	208,692.000	
	ABRDN PLC	84,362	2.052	173,110.820	
	EXPERIAN PLC	37,575	28.690	1,078,026.750	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 74,742,607.850 (12,424,463,703)	
イスラエル・シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	51,498	20.450	1,053,134.100	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	243.000	443,718.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,541	151.500	687,961.500	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	89,000	6.255	556,695.000	
	ICL GROUP LTD	30,461	28.580	870,575.380	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,100	578.400	636,240.000	
	BANK HAPOALIM BM	54,645	32.990	1,802,738.550	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	66,426	31.480	2,091,090.480	
	NICE LTD	2,731	650.900	1,777,607.900	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,407	126.900	813,048.300	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 10,732,809.210 (432,897,127)	

オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	THE LOTTERY CORPORATION LTD	84,950	4.560	387,372.000	
	TELSTRA GROUP LTD	156,394	4.000	625,576.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	2.910	305,823.540	
	BHP GROUP LTD	197,318	44.820	8,843,792.760	
	SOUTH32 LTD	177,077	4.070	720,703.390	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	74,059	36.830	2,727,592.970	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,005	19.460	1,284,457.300	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	125,031	31.690	3,962,232.390	
	WESTPAC BANKING CORP	136,277	23.830	3,247,480.910	
	SANTOS LTD	125,413	7.330	919,277.290	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	116,889	24.910	2,911,704.990	
	RIO TINTO LTD	14,467	107.830	1,559,976.610	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,887	7.970	549,029.390	
	AURIZON HOLDINGS LTD	67,600	3.740	252,824.000	
	XERO LTD	5,135	69.500	356,882.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	27.890	220,331.000	
	COLES GROUP LTD	52,080	17.060	888,484.800	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,400	55.570	300,078.000	
	IDP EDUCATION LTD	7,900	29.450	232,655.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	44,584	10.540	469,915.360	
	EVOLUTION MINING LTD	65,600	2.670	175,152.000	
	REECE LTD	10,500	15.500	162,750.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	51,260	7.040	360,870.400	
	SEEK LTD	12,845	22.230	285,544.350	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,529	13.660	376,046.140	
	NEWCREST MINING LTD	34,097	19.630	669,324.110	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	66,519	108.090	7,190,038.710	
	AMPOL LTD	8,800	28.510	250,888.000	
	ORICA LTD	17,751	14.970	265,732.470	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	56,269	12.960	729,246.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	47,331	34.990	1,656,111.690	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	6.190	219,553.110	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,415	29.400	512,001.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,198	178.000	2,527,244.000	

	ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,909	35.450	812,124.050	
	CSL LTD	18,775	302.580	5,680,939.500	
	WESFARMERS LTD	44,206	48.360	2,137,802.160	
	COCHLEAR LTD	2,510	211.420	530,664.200	
	BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	17.110	304,558.000	
	SUNCORP GROUP LTD	48,015	12.000	576,180.000	
	ASX LTD	7,365	69.330	510,615.450	
	COMPUTERSHARE LTD	20,689	27.660	572,257.740	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	96,410	4.800	462,768.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,328	31.680	548,951.040	
	BRAMBLES LTD	56,158	12.020	675,019.160	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,666	83.770	558,410.820	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,973	65.440	456,313.120	
	REA GROUP LTD	2,023	122.750	248,323.250	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	65.600	144,320.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 60,365,938.910 (5,601,355,471)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	33,500	61.250	2,051,875.000	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	77.980	740,810.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	2,109.030	1,687,224.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	11,687	88.290	1,031,845.230	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,900	51.260	917,554.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,150	199.300	1,424,995.000	
	BCE INC	4,930	64.010	315,569.300	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,800	192.780	1,503,684.000	
	SUNCOR ENERGY INC	58,230	45.430	2,645,388.900	
	METRO INC/CN	9,600	77.850	747,360.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	13,400	98.420	1,318,828.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	48,200	69.670	3,358,094.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,600	64.190	2,349,354.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	73,700	89.590	6,602,783.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,400	32.040	365,256.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	57,550	133.770	7,698,463.500	
	TOURMALINE OIL CORP	12,900	81.100	1,046,190.000	
	TC ENERGY CORP	39,750	61.260	2,435,085.000	

PEMBINA PIPELINE CORP	22,329	48.320	1,078,937.280	
BARRICK GOLD CORP	72,100	21.580	1,555,918.000	
CAE INC	12,600	28.700	361,620.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	154.200	1,050,410.400	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	36.580	237,770.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	108.190	378,665.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,150	64.230	395,014.500	
HYDRO ONE LTD	13,100	36.610	479,591.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,760	121.260	819,717.600	
NORTHLAND POWER INC	9,400	37.640	353,816.000	
WSP GLOBAL INC	5,000	160.150	800,750.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	101.810	335,973.000	
PARKLAND CORP	5,800	28.000	162,400.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	28.930	173,580.000	
EMERA INC	10,400	51.580	536,432.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	141.940	468,402.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	36.320	174,336.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,400	61.380	883,872.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	97.110	155,376.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,600	11.460	281,916.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,517	67.760	1,254,711.920	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	9.910	264,597.000	
AIR CANADA	6,500	18.920	122,980.000	
KINROSS GOLD CORP	53,000	5.470	289,910.000	
BANK OF MONTREAL	27,300	130.540	3,563,742.000	
POWER CORP OF CANADA	22,200	33.480	743,256.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	46,300	50.450	2,335,835.000	
NUTRIEN LTD	22,319	110.870	2,474,507.530	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,300	42.620	225,886.000	
CAMECO CORP	15,800	31.650	500,070.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	169.680	254,520.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	38.220	271,362.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,300	20.790	110,187.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	38.810	100,906.000	
TELUS CORP	10,800	28.560	308,448.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	19,400	48.010	931,394.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	148.900	327,580.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	80.710	3,761,086.000	

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	786.000	786,000.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	81.840	924,792.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	2,937	169.860	498,878.820	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	20.740	161,772.000	
	BLACKBERRY LTD	22,400	6.550	146,720.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,800	62.670	1,491,546.000	
	ENBRIDGE INC	82,100	55.520	4,558,192.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	57,125	61.060	3,488,052.500	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	78,000	23.950	1,868,100.000	
	BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	9.260	104,638.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	37,720	108.920	4,108,462.400	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,400	75.540	332,376.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	38.170	286,275.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,750	169.990	4,037,262.500	
	CGI INC - CLASS A	8,700	115.630	1,005,981.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	68.840	199,636.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,000	36.720	697,680.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	38.810	120,311.000	
	TMX GROUP LTD	2,300	138.200	317,860.000	
	OPEN TEXT CORP	11,000	39.410	433,510.000	
	SAPUTO INC	10,200	32.260	329,052.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	23,300	31.320	729,756.000	
	FORTIS INC	19,300	53.450	1,031,585.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	72.370	318,428.000	
	LUNDIN MINING CORP	24,600	8.240	202,704.000	
	CENOVUS ENERGY INC	55,500	27.680	1,536,240.000	
	DOLLARAMA INC	11,200	81.440	912,128.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	22.420	248,862.000	
	KEYERA CORP	8,800	30.410	267,608.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	19.370	553,982.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 98,464,224.380 (10,059,105,163)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	107,400	3.670	394,158.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	50,800	30.800	1,564,640.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	77,900	34.950	2,722,605.000	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,975	5.470	295,243.250	
	KEPPEL CORP LTD	62,700	7.530	472,131.000	
	UOL GROUP LTD	20,000	6.490	129,800.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.260	132,986.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	145,700	12.370	1,802,309.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.875	208,250.000	
	VENTURE CORP LTD	11,200	17.300	193,760.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,350	2.730	970,105.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	62,700	3.490	218,823.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,700	9.140	326,298.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,000	4.090	327,200.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 9,758,308.750 (985,979,516)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	CS GROUP ANR RIGHTS AG	104,049	0.099	10,300.850	
	UBS GROUP AG-REG	140,483	17.350	2,437,380.050	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	372.800	439,904.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	645.500	180,740.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,360	32.430	206,254.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,061	309.250	8,677,864.250	
	SIKA AG-REG	5,834	232.800	1,358,155.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	97,400.000	389,600.000	
	ABB LTD-REG	65,605	29.430	1,930,755.150	
	SWISS RE AG	12,047	84.520	1,018,212.440	
	NESTLE SA-REG	112,433	111.260	12,509,295.580	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	908.400	817,560.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,601	179.300	287,059.300	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,049	2.902	301,950.190	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	53.940	469,709.520	
	SGS SA-REG	252	2,185.000	550,620.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	170.800	159,527.200	
	TEMENOS AG - REG	2,500	57.300	143,250.000	
	VAT GROUP AG	1,050	257.800	270,690.000	
	ALCON INC	19,959	64.160	1,280,569.440	
	SIG GROUP N AG	13,000	20.060	260,780.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,159	245.500	284,534.500	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,010	452.000	2,716,520.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	142.300	256,140.000	
	CLARIANT AG-REG	8,678	15.590	135,290.020	
	NOVARTIS AG-REG	86,320	83.300	7,190,456.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	1,920.000	270,720.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	87.700	109,625.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	20,849	119.950	2,500,837.550	
	SWISSCOM AG-REG	1,036	504.800	522,972.800	
	GEBERIT AG-REG	1,433	445.600	638,544.800	
	GIVAUDAN-REG	369	3,126.000	1,153,494.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,389	105.500	463,039.500	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,110	241.800	510,198.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,929	55.480	384,420.920	
	LONZA GROUP AG-REG	2,974	486.300	1,446,256.200	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	45.740	86,906.000	
	HOLCIM LTD	21,829	48.930	1,068,092.970	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,237	503.000	622,211.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,135	225.200	480,802.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,025	78.300	236,857.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	9,760.000	409,920.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 55,188,016.730 (8,039,238,397)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	SAGAX CLASS B	7,924	222.900	1,766,259.600	
	INVESTOR CLASS A	21,458	198.550	4,260,485.900	
	VOLVO CAR CLASS B	24,808	49.735	1,233,825.880	
	ERICSSON LM-B SHS	125,588	64.480	8,097,914.240	
	VOLVO AB-B SHS	64,930	190.680	12,380,852.400	
	SKF AB-B SHARES	16,495	173.100	2,855,284.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	145.580	1,251,988.000	
	SWEDISH MATCH AB	65,778	115.200	7,577,625.600	
	TELE2 AB-B SHS	24,423	93.260	2,277,688.980	
	GETINGE AB-B SHS	9,200	238.500	2,194,200.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	70,028	119.550	8,371,847.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	62,759	104.300	6,545,763.700	
	SWEDBANK AB - A SHARES	38,966	167.450	6,524,856.700	

	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	31,425	117.620	3,696,208.500	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	26,069	141.600	3,691,370.400	
	SKANSKA AB-B SHS	14,638	170.800	2,500,170.400	
	SANDVIK AB	45,700	192.000	8,774,400.000	
	INVESTOR AB-B SHS	78,394	191.420	15,006,179.480	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	115,575	128.960	14,904,552.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	201.400	1,611,200.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,906	430.300	1,680,751.800	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	88.280	1,054,946.000	
	TELIA CO AB	110,667	28.850	3,192,742.950	
	ALFA LAVAL AB	12,700	295.500	3,752,850.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,161	116.400	7,817,540.400	
	ASSA ABLOY AB-B	43,126	238.400	10,281,238.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	265.000	1,389,395.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	46.890	1,231,706.520	
	INDUTRADE AB	11,371	219.800	2,499,345.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,032	219.100	1,540,711.200	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	468.000	1,404,000.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	205.200	1,169,640.000	
	LIFCO AB-B SHS	9,500	176.800	1,679,600.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,208	97.860	6,381,254.880	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,204	255.400	6,692,501.600	
	EMBRACER GROUP AB	26,594	44.925	1,194,735.450	
	BOLIDEN AB	11,387	380.500	4,332,753.500	
	EPIROC AB-A	27,436	197.450	5,417,238.200	
	EPIROC AB-B	16,780	170.000	2,852,600.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	17,050	80.320	1,369,456.000	
	NORDEA BANK ABP	146,748	109.860	16,121,735.280	
	EQT AB	12,318	236.000	2,907,048.000	
	EVOLUTION AB	7,867	1,043.400	8,208,427.800	
	KINNEVIK AB - B	10,431	158.650	1,654,878.150	
	HEXAGON AB-B SHS	83,750	117.900	9,874,125.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	263.700	1,634,940.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 222,858,835.610 (2,928,365,100)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	70,105	879.900	61,685,389.500	

	DANSKE BANK A/S	29,678	127.150	3,773,557.700	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	131	14,690.000	1,924,390.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	43,042	176.080	7,578,835.360	
	GN STORE NORD A/S	5,465	168.300	919,759.500	
	CARLSBERG AS-B	4,180	903.800	3,777,884.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,800	409.900	3,607,120.000	
	COLOPLAST-B	5,112	863.400	4,413,700.800	
	DSV PANALPINA A/S	8,280	1,106.500	9,161,820.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,575.000	582,750.000	
	DEMANT A/S	4,275	200.600	857,565.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	15,085.000	3,469,550.000	
	TRYG A/S	14,990	164.550	2,466,604.500	
	PANDORA A/S	4,000	503.800	2,015,200.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,300	435.800	1,873,940.000	
	GENMAB A/S	2,829	3,180.000	8,996,220.000	
	ORSTED A/S	8,140	604.200	4,918,188.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 122,022,474.360 (2,356,253,980)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	52,500	4.740	248,850.000	
	MERCURY NZ LTD	30,000	5.245	157,350.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,530	5.175	416,742.750	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,113	7.820	407,523.660	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,200	22.810	552,002.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 1,782,468.410 (153,524,004)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB BANK	40,025	190.800	7,636,770.000	
	NORSK HYDRO ASA	57,866	73.080	4,228,847.280	
	ORKLA ASA	32,317	69.380	2,242,153.460	
	TELENOR ASA	29,131	97.920	2,852,507.520	
	EQUINOR ASA	42,051	377.000	15,853,227.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,124	465.300	3,314,797.200	
	MOWI ASA	17,800	153.650	2,734,970.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,050	187.600	1,510,180.000	

	AKER BP ASA	13,597	339.600	4,617,541.200	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,723	400.000	1,489,200.000	
	SALMAR ASA	2,452	332.800	816,025.600	
	ADEVINTA ASA	12,000	76.300	915,600.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 48,211,819.260 (670,144,288)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	29,169	22.250	649,010.250	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,902	30.960	554,245.920	
	EXOR NV	4,500	73.900	332,550.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	4,600	106.450	489,670.000	
	BAYER AG-REG	39,442	55.960	2,207,174.320	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	18.535	148,280.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,328	10.210	830,358.880	
	COMMERZBANK AG	42,031	8.012	336,752.370	
	VOLKSWAGEN AG	1,200	181.700	218,040.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	7,451	137.840	1,027,045.840	
	SIEMENS AG-REG	30,742	133.080	4,091,145.360	
	E.ON SE	90,136	9.086	818,975.690	
	UNIPER SE	6,650	4.788	31,840.200	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,293	84.750	1,126,581.750	
	GEA GROUP AG	5,800	38.900	225,620.000	
	CONTINENTAL AG	4,342	57.880	251,314.960	
	BASF SE	36,875	49.060	1,809,087.500	
	ALLIANZ SE-REG	16,411	205.600	3,374,101.600	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,168	68.380	490,147.840	
	RHEINMETALL AG	1,813	193.450	350,724.850	
	RWE AG	25,791	41.740	1,076,516.340	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	7.592	166,644.400	
	BRENNTAG SE	6,090	60.580	368,932.200	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	16,483	26.270	433,008.410	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	19.140	73,478.460	
	SAP SE	41,960	103.080	4,325,236.800	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,625	301.500	1,695,937.500	
	ZALANDO SE	8,783	29.250	256,902.750	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,708	52.480	299,555.840	

KION GROUP AG	2,700	27.110	73,197.000	
COVESTRO AG	7,300	38.230	279,079.000	
RATIONAL AG	190	582.500	110,675.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	353.400	427,614.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,035	58.000	350,030.000	
DELIVERY HERO SE	6,443	39.380	253,725.340	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	126.900	202,024.800	
BECHTLE AG	3,238	34.010	110,124.380	
NEMETSCHEK SE	2,284	45.650	104,264.600	
SCOUT24 AG	3,600	51.100	183,960.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	2.336	88,768.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,097	50.440	559,732.680	
KNORR-BREMSE AG	2,800	54.000	151,200.000	
HELLOFRESH SE	6,516	22.660	147,652.560	
SIEMENS ENERGY AG	17,290	15.670	270,934.300	
BEIERSDORF AG	3,980	102.950	409,741.000	
MERCK KGAA	5,189	172.100	893,026.900	
ADIDAS AG	7,200	120.940	870,768.000	
PUMA SE	4,163	47.850	199,199.550	
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	64.500	264,514.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	130,122	19.464	2,532,694.600	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,070	29.660	239,356.200	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	32,500	62.540	2,032,550.000	
QIAGEN N.V.	9,105	47.180	429,573.900	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,430	30.600	1,604,358.000	
HANNOVER RUECK SE	2,378	181.200	430,893.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,796	37.840	1,505,880.640	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,628	172.500	1,315,830.000	
MTU AERO ENGINES AG	2,104	197.400	415,329.600	
SYMRISE AG	5,228	107.650	562,794.200	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.268	93,695.610	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,200	80.150	176,330.000	
VONOVIA SE	28,770	23.800	684,726.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,800	61.560	172,368.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,900	14.080	491,392.000	
NN GROUP NV	11,292	40.330	455,406.360	
ARCELORMITTAL	25,700	25.940	666,658.000	

HEINEKEN NV	10,407	88.700	923,100.900	
AEGON NV	72,059	4.670	336,515.530	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,983	27.940	1,173,005.020	
AKZO NOBEL N.V.	7,100	68.280	484,788.000	
KONINKLIJKE DSM NV	7,017	119.950	841,689.150	
WOLTERS KLUWER	10,540	104.300	1,099,322.000	
ING GROEP NV	156,862	11.662	1,829,324.640	
KONINKLIJKE KPN NV	132,781	2.911	386,525.490	
ASML HOLDING NV	16,320	559.800	9,135,936.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	12.280	205,076.000	
IMCD NV	2,246	139.150	312,530.900	
ADYEN NV	870	1,427.000	1,241,490.000	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	20.940	151,186.800	
PROSUS NV	35,480	60.270	2,138,379.600	
JDE PEET'S NV	3,700	29.200	108,040.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,883	256.150	482,330.450	
RANDSTAD NV	4,720	55.740	263,092.800	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	72.500	308,125.000	
OCI NV	4,386	39.940	175,176.840	
TOTALENERGIES SE	99,542	58.940	5,867,005.480	
MICHELIN (CGDE)	26,740	26.440	707,005.600	
AIR LIQUIDE SA	20,995	138.760	2,913,266.200	
KERING	3,004	552.600	1,660,010.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,787	138.880	3,025,778.560	
BOUYGUES SA	9,062	29.720	269,322.640	
BNP PARIBAS	44,602	53.570	2,389,329.140	
THALES SA	4,291	121.850	522,858.350	
DANONE	25,708	50.300	1,293,112.400	
CARREFOUR SA	24,454	16.510	403,735.540	
VIVENDI	29,591	8.550	253,003.050	
L'OREAL	9,688	347.500	3,366,580.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	19,987	44.180	883,025.660	
LEGRAND SA	10,737	78.060	838,130.220	
PERNOD RICARD SA	8,411	186.950	1,572,436.450	
EURAZEO SE	1,724	60.500	104,302.000	
SOCIETE GENERALE SA	31,964	24.075	769,533.300	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	11,146	702.000	7,824,492.000	

ACCOR SA	6,717	24.880	167,118.960	
CAPGEMINI SE	6,574	172.750	1,135,658.500	
VALEO SA	8,400	17.630	148,092.000	
PUBLICIS GROUPE	9,179	63.000	578,277.000	
BUREAU VERITAS SA	11,605	25.170	292,097.850	
EIFFAGE	3,285	94.440	310,235.400	
SODEXO SA	3,491	91.040	317,820.640	
IPSEN	1,400	108.800	152,320.000	
AMUNDI SA	2,250	52.600	118,350.000	
TELEPERFORMANCE	2,315	214.000	495,410.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	26.200	94,320.000	
EURONEXT NV	3,300	71.780	236,874.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,296	67.040	355,043.840	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,100	315.700	347,270.000	
SEB SA	997	76.800	76,569.600	
ESSILORLUXOTTICA	11,549	175.500	2,026,849.500	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	151.200	151,200.000	
WORLDLINE SA	9,606	44.810	430,444.860	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	37.410	155,737.830	
AXA SA	76,206	27.355	2,084,615.130	
EDENRED	10,044	52.620	528,515.280	
RENAULT SA	7,755	33.780	261,963.900	
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,484.000	1,887,648.000	
STMICROELECTRONICS NV	27,439	35.750	980,944.250	
REMY COINTREAU	900	161.800	145,620.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	26,758	34.755	929,974.290	
WENDEL	930	87.050	80,956.500	
ORANGE	80,096	9.844	788,465.020	
ALSTOM	12,525	24.560	307,614.000	
SANOFI	45,721	88.190	4,032,134.990	
VINCI SA	21,423	96.590	2,069,247.570	
AIRBUS SE	23,736	109.180	2,591,496.480	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,179	24.320	636,673.280	
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	9.606	471,923.560	
BIOMERIEUX	1,691	96.060	162,437.460	
ENGIE	73,328	14.360	1,052,990.080	
EDF	22,120	12.000	265,440.000	
SAFRAN SA	13,722	116.500	1,598,613.000	
ARKEMA	2,395	83.940	201,036.300	

ADP	1,110	145.700	161,727.000	
GETLINK SE	17,345	15.905	275,872.220	
BOLLORE	35,675	5.235	186,758.620	
UCB SA	4,976	77.140	383,848.640	
KBC GROUP NV	9,843	52.520	516,954.360	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	77.060	323,652.000	
SOLVAY SA	2,984	94.140	280,913.760	
UMICORE	8,269	34.220	282,965.180	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,872	56.200	1,959,806.400	
AGEAS	6,290	37.810	237,824.900	
D'IETEREN GROUP	1,036	178.000	184,408.000	
PROXIMUS	6,035	10.155	61,285.420	
ELIA GROUP SA/NV	1,333	134.200	178,888.600	
SOFINA	600	211.000	126,600.000	
ARGENX SE	2,229	364.300	812,024.700	
PRYSMIAN SPA	10,040	33.720	338,548.800	
ASSICURAZIONI GENERALI	44,600	16.940	755,524.000	
MEDIOBANCA SPA	24,407	9.256	225,911.190	
TENARIS SA	18,608	16.380	304,799.040	
UNICREDIT SPA	83,217	12.960	1,078,492.320	
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.217	82,422.960	
INTESA SANPAOLO	663,075	2.134	1,415,333.580	
ATLANTIA SPA	19,531	22.930	447,845.830	
POSTE ITALIANE SPA	21,074	9.422	198,559.220	
MONCLER SPA	8,261	48.000	396,528.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,217	40.010	168,722.170	
ENI SPA	101,329	14.196	1,438,466.480	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	21,064	10.035	211,377.240	
DIASORIN SPA	1,000	128.900	128,900.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	9.386	120,140.800	
NEXI SPA	19,900	8.340	165,966.000	
AMPLIFON SPA	4,700	27.110	127,417.000	
ENEL SPA	326,535	5.106	1,667,287.710	
SNAM SPA	79,350	4.797	380,641.950	
TERNA SPA	55,464	7.198	399,229.870	
CNH INDUSTRIAL NV	40,265	15.200	612,028.000	
FINECOBANK SPA	23,200	15.120	350,784.000	
STELLANTIS NV	88,350	14.710	1,299,628.500	

FERRARI NV	5,061	208.500	1,055,218.500	
TELEFONICA SA	210,478	3.590	755,616.020	
ENDESA SA	12,100	17.545	212,294.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,700	5.624	1,505,544.800	
IBERDROLA SA	239,538	10.655	2,552,277.390	
REPSOL SA	57,201	14.635	837,136.630	
GRIFOLS SA	11,830	9.944	117,637.520	
BANCO SANTANDER SA	682,335	2.835	1,934,760.890	
AMADEUS IT GROUP SA	18,086	50.860	919,853.960	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.220	270,066.000	
CAIXABANK SA	174,927	3.548	620,640.990	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.830	238,143.080	
AENA SME SA	2,900	121.350	351,915.000	
CELLNEX TELECOM SA	21,460	32.610	699,810.600	
ACCIONA SA	1,028	181.300	186,376.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	43,794	24.920	1,091,346.480	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	18.010	169,546.140	
ENAGAS SA	9,884	17.300	170,993.200	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	16.985	266,664.500	
FERROVIAL SA	19,018	25.530	485,529.540	
UPM-KYMMENE OYJ	21,428	34.660	742,694.480	
NOKIA OYJ	217,254	4.571	993,068.030	
WARTSILA OYJ ABP	19,124	8.170	156,243.080	
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	14.040	300,456.000	
ELISA OYJ	5,725	49.560	283,731.000	
SAMPO OYJ-A SHS	19,622	48.330	948,331.260	
FORTUM OYJ	16,900	15.020	253,838.000	
KESKO OYJ-B SHS	10,400	20.530	213,512.000	
KONE OYJ-B	13,375	48.500	648,687.500	
NESTE OYJ	16,985	46.690	793,029.650	
ORION OYJ-CLASS B	4,000	50.420	201,680.000	
VERBUND AG	2,740	85.700	234,818.000	
OMV AG	5,650	49.580	280,127.000	
ERSTE GROUP BANK AG	13,546	29.420	398,523.320	
VOESTALPINE AG	4,250	26.200	111,350.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,948	34.730	345,494.040	

	KINGSPAN GROUP PLC	6,076	54.040	328,347.040	
	JERONIMO MARTINS	11,416	21.340	243,617.440	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	109,400	4.420	483,548.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	20,196	11.590	234,071.640	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,594	21.730	251,937.620	
	KERRY GROUP PLC-A	6,272	90.860	569,873.920	
	CRH PLC	30,632	38.370	1,175,349.840	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,704	138.650	929,509.600	
ユーロ　小計				ユーロ 176,596,804.590 (25,355,769,203)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	58,000	40.000	2,320,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	94,000	45.650	4,291,100.000	
	MTR CORP	66,500	37.250	2,477,125.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,500	92.700	5,608,350.000	
	SINO LAND CO	142,000	9.990	1,418,580.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,669	44.250	4,941,353.250	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	21,500	60.200	1,294,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	70,000	56.500	3,955,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	59,507	24.300	1,446,020.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	482,475	6.600	3,184,335.000	
	HANG SENG BANK LTD	32,900	119.400	3,928,260.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	18.520	1,176,020.000	
	WH GROUP LTD	361,000	4.500	1,624,500.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	51,100	300.000	15,330,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	87,000	13.460	1,171,020.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	78,000	14.380	1,121,640.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	17.580	791,100.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	47.150	4,298,618.350	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	38.900	1,030,850.000	
	AIA GROUP LTD	509,600	76.200	38,831,520.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	15.240	822,960.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	36.050	2,595,600.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	74,100	21.300	1,578,330.000	
	ESR CAYMAN LTD	86,200	16.660	1,436,092.000	

	SANDS CHINA LTD	104,400	19.880	2,075,472.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	13.520	1,108,640.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	57,500	88.900	5,111,750.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	159,000	24.950	3,967,050.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 118,935,585.700 (2,114,674,714)	
合計				267,590,825,704 [267,590,825,704]	

(2)　株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,837	996,901.230	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,607	1,598,278.220	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,200	438,278.000	
		VORNADO REALTY TRUST	6,297	159,377.070	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,500	1,325,475.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	14,800	940,984.000	
		EQUINIX INC	3,808	2,555,015.680	
		AMERICAN TOWER CORP	18,900	4,105,458.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	29,043	541,942.380	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,000	422,630.000	
		KIMCO REALTY CORP	25,000	568,000.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	15,500	308,915.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,000	567,270.000	
		INVITATION HOMES INC	25,200	804,384.000	
		VICI PROPERTIES INC	39,800	1,340,066.000	
		VENTAS INC	16,500	749,100.000	
		WEYERHAEUSER CO	30,814	978,652.640	
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,900	2,490,069.000	
		IRON MOUNTAIN INC	11,800	635,548.000	
		SUN COMMUNITIES INC	5,000	724,050.000	
		PROLOGIS INC	38,154	4,342,306.740	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,400	976,128.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,200	494,550.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,700	579,123.000	

	WELLTOWER INC	18,800	1,300,960.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,900	561,516.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,800	777,216.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,200	471,096.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	17,900	379,659.000	
	REALTY INCOME CORP	24,895	1,550,958.500	
	PUBLIC STORAGE	6,500	1,888,900.000	
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	414,666.000	
	UDR INC	12,900	525,675.000	
	WP CAREY INC	8,000	625,760.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	1,283,250.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,600	859,712.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,200	314,116.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 39,595,986.460 (5,498,694,640)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	175,735.300	
	SEGRO PLC	48,274	390,247.010	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	143,243.560	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 709,225.870 (117,894,616)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	40,978	322,087.080	
	LENDLEASE GROUP	25,300	192,786.000	
	TRANSURBAN GROUP	119,689	1,698,386.910	
	APA GROUP	45,041	505,810.430	
	SCENTRE GROUP	203,007	596,840.580	
	GPT GROUP	73,031	319,145.470	
	MIRVAC GROUP	144,900	321,678.000	
	STOCKLAND	91,123	346,267.400	
	GOODMAN GROUP	65,537	1,224,886.530	
	VICINITY CENTRES	151,865	308,285.950	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 5,836,174.350 (541,538,618)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	

		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	147,220.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	123,366.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 270,586.000 (27,643,066)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	144,500	398,820.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220,070	457,745.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	140,800	226,688.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	101,300	175,249.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 1,258,502.600 (127,159,103)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	239,108.000	
		GECINA SA	1,817	172,160.750	
		KLEPIERRE	8,527	189,981.560	
		COVIVIO	2,000	112,700.000	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	159,258.240	
	ユーロ　小計			ユーロ 873,208.550 (125,375,284)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	90,800	4,776,080.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	594,920.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	163,000	1,527,310.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 6,898,310.000 (122,651,952)	
投資証券　合計				6,560,957,279 [6,560,957,279]	
合計				6,560,957,279 [6,560,957,279]	

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 597銘柄 投資証券 37銘柄	97.3%	2.7%	73.6%
イギリス・ポンド	株式 79銘柄 投資証券 3銘柄	99.1%	0.9%	4.6%
イスラエル・シュケル	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄 投資証券 10銘柄	91.2%	8.8%	2.2%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資証券 4銘柄	88.6%	11.4%	0.4%
スイス・フラン	株式 42銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 224銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	9.3%
香港・ドル	株式 28銘柄 投資証券 3銘柄	94.5%	5.5%	0.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	700,635,449	744,126,868

コール・ローン	1,607,697,128	2,484,935,442
国債証券	230,341,773,353	236,705,030,930
派生商品評価勘定	431,286	191,337
未収入金	2,787,836	30,062
未収利息	1,240,818,660	1,496,086,797
前払費用	21,860,457	72,896,925
流動資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361
資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,725,909	25,202,627
未払金	252,029,658	3,816,639
未払解約金	25,134,000	121,960,511
流動負債合計	283,889,567	150,979,777
負債合計	283,889,567	150,979,777
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	74,475,307,643	76,340,507,617
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	159,156,806,959	165,011,810,967
元本等合計	233,632,114,602	241,352,318,584
純資産合計	233,632,114,602	241,352,318,584
負債純資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年12月1日 至　2022年11月30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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 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	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1．※1　期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	72,688,498,430円	74,475,307,643円
期中追加設定元本額	10,294,827,028円	9,175,662,845円
期中一部解約元本額	8,508,017,815円	7,310,462,871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	498,388,691円	447,343,827円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	10,756,510円	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	79,498,163円	51,739,813円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,023,940円	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	312,397,465円	243,846,488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）	211,430,078円	347,889,324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）	505,972,682円	589,471,225円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,311,980,333円	2,679,395,542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）	842,742,592円	612,758,959円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	744,003円	992,049円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	7,190,607円	12,619,026円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,686,822,876円	2,022,055,185円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,443,360,479円	1,843,024,587円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	229,923,693円	342,801,665円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	49,590,694,433円	50,603,926,450円
ダイワ・ライフ・バランス３０	964,870,268円	1,059,415,494円
ダイワ・ライフ・バランス５０	601,682,079円	676,505,626円
ダイワ・ライフ・バランス７０	393,993,399円	451,133,774円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	578,219,728円	638,338,066円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	439,097,748円	501,969,526円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	160,496,213円	192,677,874円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円	31,943,484円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円	13,831,284円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円	1,384,617,622円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,367,466円	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,453,811円	1,528,422円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	1,909,053円	2,590,775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）	317,987円	159,668,286円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	163,610,849円	115,798,326円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	135,308,646円	36,264,152円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,912,241,392円	3,287,759,159円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	231,133,046円	199,611,808円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円	150,551,922円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779円	49,437,293円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,367,106,464円	1,733,569,277円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円	5,720,730,269円
ダイワライフスタイル２５	33,014,942円	28,448,488円
ダイワライフスタイル５０	65,372,616円	58,536,147円

ダイワライフスタイル７５	17,425,714円	14,977,183円
計	74,475,307,643円	76,340,507,617円
2. 期末日における受益権の総数	74,475,307,643口	76,340,507,617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 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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	2022年11月30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	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△9,023,697,557	△40,716,680,142
合計	△9,023,697,557	△40,716,680,142

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2021年11月30日 現在				2022年11月30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	1,712,299,150	－	1,706,004,527	△6,294,623	2,152,583,358	－	2,127,572,068	△25,011,290
アメリカ・ドル	755,807,619	－	756,096,737	289,118	941,267,656	－	934,036,875	△7,230,781
イギリス・ポンド	66,758,721	－	66,834,123	75,402	179,447,652	－	179,112,796	△334,856
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	90,011,493	－	88,942,453	△1,069,040
オフショア・人民元	－	－	－	－	88,623,078	－	84,987,194	△3,635,884
カナダ・ドル	61,806,931	－	59,980,905	△1,826,026	176,541,309	－	169,074,798	△7,466,511
シンガポール・ドル	31,361,148	－	31,422,799	61,651	51,909,276	－	50,075,168	△1,834,108

デンマーク・クローネ	53,986,987	－	52,312,950	△1,674,037	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	－	－	－	－	32,514,295	－	31,607,270	△907,025
ユーロ	742,577,744	－	739,357,013	△3,220,731	592,268,599	－	589,735,514	△2,533,085
合計	1,712,299,150	－	1,706,004,527	△6,294,623	2,152,583,358	－	2,127,572,068	△25,011,290

（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）

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.1370円	3.1615円
（1万口当たり純資産額）	(31,370円)	(31,615円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	4,926,655.410	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,106,013.920	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,758,843.840	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	900,246.600	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	775,107.160	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	786,051.180	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	822,435.180	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,650,208.310	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,274,090.160	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	960,777.510	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	583,811.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	560,436.960	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,002,550.280	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,173,014.400	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,142,499.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,282,382.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,103,364.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,775,105.860	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,080,471.850	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,526,232.240	

		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,386,986.700	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,439,501.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,466,028.800	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,273,839.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,424,864.160	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,159,656.300	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,281,416.570	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,330,422.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,278,448.900	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,909,660.980	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,012,353.640	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,984,941.040	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,090,722.200	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,981,424.510	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,933,513.040	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,656,297.270	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,671,666.690	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,304,910.020	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,451,772.470	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,963,898.750	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,488,413.120	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,536,739.100	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,408,470.250	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,532,844.470	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,518,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	551,418.250	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,490,004.180	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,396,887.200	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,101,250.620	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,146,891.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,914,810.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,007,438.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,894,391.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,430,950.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	817,960.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,427,276.900	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,434,075.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,385,891.600	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,409,940.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,960,443.450	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,226,860.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,396,255.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,969,472.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,672,960.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,887,590.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,093,671.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,303,472.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,462,515.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,878,800.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,157,665.500	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,907,640.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,394,375.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,072,870.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,995,975.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,355,345.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,056,096.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,677,276.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,984,367.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,495,688.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,605,068.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,513,760.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,791,569.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,266,062.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,152,380.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,834,754.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,426,566.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,888,430.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,328,820.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,707,923.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,411,900.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,457,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,417,075.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,415,325.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	3,934,840.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,537,977.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,727,422.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,887,020.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	1,964,060.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,432,020.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,444,025.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,127,638.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,898,280.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,383,300.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,969,103.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,371,275.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,205,884.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,352,825.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,836,250.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,560,856.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,381,035.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,641,184.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,802,060.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,346,035.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,591,848.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,245,185.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,309,550.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,092,102.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,326,536.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,534,308.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,775,120.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,283,200.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,839,680.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	945,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,733,150.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,504,437.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,347,730.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,819,800.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,829,480.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,284,700.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,367,275.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,593,750.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,285,500.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,864,170.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,668,814.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	266,226.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,837,820.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,373,700.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,384,624.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,421,096.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,457,081.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,061,648.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,104,696.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,176,650.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	2,997,190.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,711,580.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,871,775.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	2,990,295.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,059,048.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,344,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,238,750.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,838,363.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,151,250.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	2,975,385.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,583,200.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,371,840.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,136,980.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	2,000,000.000	1,915,780.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,908,502.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,568,800.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,383,960.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,172,140.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,358,095.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,551,036.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,247,250.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,859,630.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,237,200.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	890,950.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,797,960.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	5,956,650.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,865,149.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,796,898.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,729,650.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,436,600.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,334,250.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,370,652.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,665,230.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,888,420.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,483,800.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,577,720.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,827,260.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,378,644.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,781,403.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,013,235.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,215,380.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,730,496.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,899,476.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,470,520.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,913,580.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,868,820.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,328,700.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,458,200.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,136,560.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,792,730.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,410,568.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,659,639.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,562,176.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,287,680.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,257,800.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,281,600.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,417,350.000	

		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	6,964,425.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,305,050.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,100,615.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,861,160.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,184,820.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,384,860.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,312,638.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,892,320.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,843,920.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,193,960.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,250,720.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,583,560.000	
		0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,793,200.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,877,208.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,052,094.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,394,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,458,880.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,577,320.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	932,810.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,868,270.000	

		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,885,032.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,471,784.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,791,052.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,799,459.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,931,250.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,441,950.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,843,720.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	915,580.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,714,450.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,741,130.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,695,100.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,935,920.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,920,620.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,647,512.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,888,190.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,133,550.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,337,340.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,362,345.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,823,030.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,845,650.000	

		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,356,720.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,602,260.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,887,140.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,931,320.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,847,880.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,905,470.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,902,830.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,855,429.600	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	974,450.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,426,050.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	7,500,000.000	6,888,225.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	3,700,000.000	3,150,772.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	1,000,000.000	908,590.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,867,931.300	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,111,796.800	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,802,825.100	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,409,500.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,342,605.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,254,000.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,481,800.000	

	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,499,200.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,509,660.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,398,640.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	997,420.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 864,609,414.840 (120,068,309,439)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	893,416.050	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	1,116,122.020	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,382,388.650	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,200,267.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,170,367.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,272,882.500	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,292,081.700	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,378,710.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	694,865.600	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,745,820.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	869,808.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	574,991.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,291,995.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,785,183.000	

		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	835,106.300	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,051,661.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	737,970.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,367,745.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,368,000.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	564,454.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,226,482.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,253,408.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,955,900.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	297,105.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	448,745.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	800,000.000	492,728.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	93,460.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	900,000.000	643,077.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	594,146.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	236,241.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	195,687.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	2,100,000.000	1,738,002.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	441,676.600	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,052,200.000	

		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,088,512.490	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,454,345.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,528,436.480	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,491,621.540	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,574,567.810	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,035,423.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,541,954.460	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,287,132.000	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,437,103.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,789,888.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,536,499.440	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,586,999.460	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,751,037.600	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,384,568.640	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,740,266.810	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,666,289.280	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,799,402.460	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,534,509.900	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,081,287.480	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,530,385.560	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド	

			67,102,924.230 (11,154,519,095)	
イスラエル・シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,989,162.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,051,456.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,009,520.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,204,182.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,704,636.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,479,608.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,132,044.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,475,895.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,045,232.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,494,176.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,330,913.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,434.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	850,743.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	252,459.000	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 21,202,460.000 (855,180,022)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,104,660.350	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	569,837.040	

		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,339,119.540	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,801,056.600	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,354,815.680	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,803,096.960	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,099,810.950	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,176,300.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	725,590.800	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,626,772.400	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,111,643.260	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,054,409.360	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,446,240.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,814,614.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,680,924.400	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,163,721.900	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,410,421.600	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,383,511.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,266,632.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,645,320.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	870,996.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,465,584.000	

	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,008,925.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,081,200.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,353,440.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,225,432.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 38,584,074.840 (3,580,216,304)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,313,516.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,155,800.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,171,650.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,132,900.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,285,840.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,191,920.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,116,610.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,405,230.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	37,000,000.000	37,276,760.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,336,240.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,257,760.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	12,986,250.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,125,090.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	7,983,426.000	

		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,089,530.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	8,000,000.000	8,618,000.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,868,440.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,513,005.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,037,450.000	
		3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,249,040.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,751,240.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,413,100.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,297,450.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,537,200.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,722,615.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,070,510.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	6,931,449.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,372,790.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,187,320.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,543,890.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,632,440.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,011,220.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,825,070.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,116,336.000	

		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,963,900.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	14,962,950.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,547,355.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	4,931,200.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	3,977,840.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,924,600.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	12,000,000.000	11,715,360.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	2,000,000.000	1,988,260.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,349,805.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	2,200,000.000	2,174,436.000	
	オフショア・人民元　小計			**オフショア・人民元** 388,062,793.000 (7,534,316,739)	
	カナダ・ドル		**カナダ・ドル**	**カナダ・ドル**	
		2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	563,787.400	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,140,555.240	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,386,465.080	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,235,014.440	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,026,166.350	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,026,165.410	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,374,371.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,265,523.980	

		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,116,002.400	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	907,904.550	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,128,015.600	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	616,167.500	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,968,037.100	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,167,613.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,173,072.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,342,768.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,050,386.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	661,199.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,649,031.800	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,648,660.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,887,816.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,141,404.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	274,407.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,020,866.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	944,230.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,450,000.000	1,079,423.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	966,220.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	183,678.000	

		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,884,650.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,852,914.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,636.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	385,896.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,376,610.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,513.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	391,596.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	195,934.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	980,930.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	736,558.900	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	353,718.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	202,996.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 46,591,902.950 (4,759,828,805)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	788,212.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	921,837.020	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	797,269.500	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	393,056.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	585,892.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	617,937.500	

		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	516,873.600	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	679,056.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	437,760.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	687,082.500	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	540,705.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	482,650.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	320,600.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	443,070.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	699,225.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	535,650.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	165,454.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,460.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	231,993.600	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	233,637.800	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,817.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 10,365,238.520 (1,047,303,700)	
	スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	5,812,000.250	
		1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	7,951,170.000	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,612,316.600	

	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,867,741.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,728,365.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,421,044.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,906,880.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,325,150.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 46,624,668.150 (612,648,139)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	18,287,679.960	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	4,821,236.940	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,954,673.900	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,729,944.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,706,948.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,239,580.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	414,205.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	957,480.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 45,111,747.800 (871,107,850)	
ニュージーランド・ドル		ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	603,438.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	400,000.000	380,456.000	

	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	412,756.400	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	560,268.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	430,943.000	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	235,994.500	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20240515	700,000.000	658,973.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	322,600.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	436,920.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	368,222.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	284,996.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	613,177.600	
ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 5,308,745.500 (457,242,250)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,072,559.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,200,294.450	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,099,824.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,188,384.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,299,030.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,530,142.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	5,992,908.000	

	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,003,630.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,563,167.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 34,949,939.750 (485,804,163)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,742,991.550	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,624,443.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,712,063.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,811,500.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,122,866.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,742,300.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,019,480.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,703,988.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	891,930.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,192,140.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	436,860.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	785,939.450	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	2,996,029.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,176,662.250	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 31,959,193.650 (981,527,559)	

	マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,325,397.620	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,197,083.600	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,535,862.160	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,298,154.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	728,404.950	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,371,261.380	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,853,259.040	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,368,237.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,067,379.740	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,740,317.670	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,206,043.200	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	949,464.900	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,546,016.500	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,516.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,184,621.200	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,036,034.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,201,416.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,231,488.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	632,100.000	

		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	649,161.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,266,410.300	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,254,516.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	400,008.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,237,002.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,604,330.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,439,510.500	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,596,672.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	478,590.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	412,068.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	510,995.000	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 38,885,320.260 (1,197,267,345)	
	メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
		5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,350,684.400	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,817,911.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	22,992,704.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,065,780.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	898,140.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	3,000,000.000	2,636,250.000	
		8% Mexican Bonos 20231207	28,033,000.000	27,286,481.210	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,833,609.170	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,130,502.400	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,413,184.240	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,513,209.840	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,700,088.140	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	29,769,108.250	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	18,672,893.820	

	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,104,716.400	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 273,185,262.870 (1,972,998,605)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	318,267.040	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	269,991.090	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	768,308.960	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	297,205.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	736,328.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	405,365.600	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	451,545.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	442,510.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	192,866.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	225,686.200	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	269,988.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	416,505.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	219,864.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	493,314.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	183,922.000	
	0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	308,920.500	
	1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	275,046.000	
	1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	259,831.800	

		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,340,061.730	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,070,837.260	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	645,083.040	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	170,752.800	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,191,808.000	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	465,334.200	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,115,676.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,148,659.200	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	773,232.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	826,649.600	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	464,009.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	255,452.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	177,863.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	984,372.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	456,144.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,690.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	157,134.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	262,503.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	434,875.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	264,345.000	

		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	298,617.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,646,891.670	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,594,116.400	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	950,750.540	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,408,078.980	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	999,019.080	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	665,001.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,035,078.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,019,445.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	533,281.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	510,720.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,384,686.800	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	580,008.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,377,300.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	565,579.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,037,866.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	583,931.400	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,079,076.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,298,624.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	265,196.100	

		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	328,128.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	588,888.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	400,868.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,020,089.680	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,397,109.060	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,544,674.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,090,201.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,512,497.800	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,856,177.200	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,978,244.400	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	4,089,600.460	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,744,137.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,448,477.220	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,395,449.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,123,843.840	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,556,785.300	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	3,024,483.840	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,582,395.680	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,977,085.480	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,125,349.740	

		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,080,884.740	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,264,186.880	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,257,569.600	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,926,328.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,099,987.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,474,468.700	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,772,206.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,744,325.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	1,994,608.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,651,640.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,770,876.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,531,792.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,646,484.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,825,080.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,562,634.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,041,732.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	773,271.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,077,216.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,791,900.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	684,871.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,065,904.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	596,309.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,800,000.000	1,515,600.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	400,000.000	348,012.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,650,212.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,197,684.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	202,778.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,200,000.000	721,620.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,116,504.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	97,489.000	
		0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	97,266.000	
		0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	515,027.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,869,638.400	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,637,321.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,291,472.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,177,433.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,965.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,065,096.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,207,050.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	92,064.000	

		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,915,670.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	418,291.100	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,350,248.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,967,927.840	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,190,001.340	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,264,028.860	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,273,249.160	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,785,627.860	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,996,100.360	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,599,186.680	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,803,725.960	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	6,062,284.320	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,404,025.920	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	6,086,000.000	6,091,964.280	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,200,847.060	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,856,623.650	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,352,529.520	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,934,095.280	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,839,219.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,145,144.690	

		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,533,644.400	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,113,677.780	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,761,518.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,294,855.800	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,233,740.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,254,047.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,000,670.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,449,693.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,550,832.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,305,990.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,244,489.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,904,734.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,116,444.400	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,604,944.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,752,025.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,798,460.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,550,934.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,350,080.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	689,842.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	97,407.000	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	991,140.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,756,176.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,831,819.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,500,000.000	930,315.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	2,100,000.000	1,687,161.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,999,410.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	164,956.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	278,616.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,300,000.000	1,256,125.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	973,260.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,327,401.990	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,127,411.000	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,158,639.210	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,508,546.160	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,193,369.450	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,512,970.480	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,711,175.130	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,836,855.780	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,078,692.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,367,912.000	

		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,258,524.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,064,856.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	687,555.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,198,050.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	736,584.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	720,562.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,087,606.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	646,416.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	792,603.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,827.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	513,198.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	298,677.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	958,955.700	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,287,355.800	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,759,148.080	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,809,465.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,377,354.840	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,407,590.090	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,745,544.500	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,814,215.040	

		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,338,570.100	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,275,313.460	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,941,980.880	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	997,917.840	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	756,162.880	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,312,320.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,454,930.300	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,285,674.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,250,000.000	1,175,262.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,574,477.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,566,608.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,152,840.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,978,746.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,260,298.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,481,889.500	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,533,198.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,198,054.500	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,650,759.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,855,863.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,170,696.000	

		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,034,354.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,119,050.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,638,902.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,236,612.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,152,247.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,196,135.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,135,035.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,460,430.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,652,900.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,823,451.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,987,480.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,571,990.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,096,470.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,536,910.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,069,321.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	784,560.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	484,554.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,620,453.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,399,914.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	459,830.000	

		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	993,938.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,448,520.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	302,183.200	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	684,856.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,509,151.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	956,800.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,165,620.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,776,887.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,331,967.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	753,039.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	285,222.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	569,632.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231129	200,000.000	195,222.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	275,676.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	477,475.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	769,440.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	3,300,000.000	2,950,794.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	275,400.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240530	100,000.000	98,605.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	194,210.000	

		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	504,835.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	303,447.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,638,720.420	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,361,677.550	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,096,778.250	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,529,592.440	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,785,621.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,304,303.400	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,223,328.140	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,543,988.170	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,167,579.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,591,521.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,027,586.680	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,245,339.600	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,242,819.000	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,329,520.460	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,994,262.820	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,372,936.160	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,946,069.040	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,078,677.600	

		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	879,980.400	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	750,888.970	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,515,775.800	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	776,043.360	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,105,799.050	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	617,610.360	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	973,493.000	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	832,360.550	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,035,659.600	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	491,727.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	746,640.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	671,190.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	700,440.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	884,697.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	475,554.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	270,788.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	458,680.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	681,512.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	653,232.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	277,932.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	82,526.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	974,275.500	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,623,242.980	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	951,755.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	441,755.860	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	800,216.400	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	762,079.530	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	923,658.600	

		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	700,123.220	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	398,822.250	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	413,654.450	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	528,608.540	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,177,997.680	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,015,490.650	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,951,698.240	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,187,681.760	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,700,586.620	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,872,612.160	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,603,630.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,530,401.900	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,828,940.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,663,270.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,954,654.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,264,904.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,200,000.000	1,098,684.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,728,697.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,496,272.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,974,352.500	

		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,226,929.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,452,576.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,166,893.600	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,383,275.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	844,830.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,226,408.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,157,960.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	944,528.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	464,440.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,770,362.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	289,917.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	365,306.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	439,525.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,384,454.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,562,313.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	412,152.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	813,447.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,736,049.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	444,180.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	94,363.000	

		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	88,820.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,000,000.000	970,070.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,022,650.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,733,424.760	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,980,985.140	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,158,000.000	1,434,565.140	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,732,830.040	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,406,172.150	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,961,834.330	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,214,142.350	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	1,937,023.950	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,018,207.100	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,705,353.180	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,012,571.700	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,116,669.860	
	ユーロ　小計			ユーロ 565,028,283.290 (81,126,760,915)	
国債証券　合計				236,705,030,930 [236,705,030,930]	
合計				236,705,030,930 [236,705,030,930]	

（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	264銘柄	100%	50.7%
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券	44銘柄	100%	3.2%
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	100%	2.0%
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%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	361銘柄	100%	34.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	919,046,466円
Ⅱ	負債総額	4,355,808円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	914,690,658円
Ⅳ	発行済数量	592,745,033口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5431円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	213,840,797,534円
Ⅱ	負債総額	8,550,063,296円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	205,290,734,238円
Ⅳ	発行済数量	147,745,976,638口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3895円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	113,175,837,692円
Ⅱ	負債総額	99,099,215円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	113,076,738,477円
Ⅳ	発行済数量	83,142,525,531口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3600円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	299,342,893,917円
Ⅱ	負債総額	969,629,529円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	298,373,264,388円
Ⅳ	発行済数量	69,133,888,947口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3159円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	241,503,298,361円
Ⅱ	負債総額	150,979,777円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	241,352,318,584円
Ⅳ	発行済数量	76,340,507,617口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1615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

2022年11月末日現在

資本金の額	**151億7,427万2,500円**
発行可能株式総数	**799万9,980株**
発行済株式総数	**260万8,525株**

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

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。

2022年11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	81	277,536
追加型株式投資信託	770	21,155,993
株式投資信託　　合計	851	21,433,528
単位型公社債投資信託	79	159,741
追加型公社債投資信託	14	1,428,018
公社債投資信託　合計	93	1,587,759
総合計	944	23,021,287

３【委託会社等の経理状況】

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

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年４月１日から2022年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第64期事業年度に係る中間会計期間（2022年４月１日から2022年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,860		3,168
有価証券		333		486
前払費用		237		332
未収委託者報酬		13,150		13,811
未収収益		49		52
関係会社短期貸付金		18,700		24,900
その他		207		45
流動資産計		37,539		42,799
固定資産				
有形固定資産	※1	224	※1	203
建物		6		4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

（単位:百万円）

	前事業年度 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		68		65
未払金		8,405		9,856
未払収益分配金		13		26
未払償還金		39		12
未払手数料		4,734		4,917
その他未払金	※2	3,617	※2	4,900
未払費用		3,777		4,246
未払法人税等		804		980
未払消費税等		631		1,016
賞与引当金		950		866
その他		88		2
流動負債計		14,725		17,033
固定負債				
退職給付引当金		2,452		2,399
役員退職慰労引当金		74		13
その他		3		1
固定負債計		2,530		2,415
負債合計		17,256		19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

（単位:百万円）

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	△109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自　2021年４月１日 至　2022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	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	－	－	－	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	947	947	38,566
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 9,388
当期純利益	－	－	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

５．その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年８月12日）を適用する予定であります。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年３月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

（貸借対照表関係）

※１ 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

※２ 関係会社項目

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

	前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
未払金	3,473百万円	4,694百万円

３ 保証債務

前事業年度（2021年３月31日）

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

当事業年度（2022年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	―	―	2,608
合　　計	2,608	―	―	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

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

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

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

① 剰余金の配当の総額　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日
⑤ 効力発生日　2021年６月23日

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	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
2021年６月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 ３月31日	2021年 ６月23日

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

2022年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①	剰余金の配当の総額	12,737百万円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	4,883円
④	基準日	2022年３月31日
⑤	効力発生日	2022年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

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。なお、2019年７月４日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「2019年適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

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

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

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

前事業年度（2021年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（※1）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度（2022年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券（※１）	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

（※１）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券486百万円、投資有価証券10,022百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2021年３月31日）

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

当事業年度（2022年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2021年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

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

当事業年度（2022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	66	55	11
（２）その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

４．減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,574　百万円	2,452　百万円
勤務費用	155	152
退職給付の支払額	△ 378	△ 303
その他	101	98
退職給付債務の期末残高	2,452	2,399

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

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,452百万円	2,399百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399
退職給付引当金	2,452	2,399
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
勤務費用	155　百万円	152　百万円
その他	108	67
確定給付制度に係る退職給付費用	263	219

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度186百万円、当事業年度189百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	750	734
賞与引当金	243	227

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	△254	△ 356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△ 159
その他有価証券評価差額金	△453	△ 562
繰延税金負債合計	△612	△ 722
繰延税金資産の純額	973	885

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

前事業年度（2021年３月31日）

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

当事業年度（2022年３月31日）

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が74,402百万円、その他545百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(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）	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 －

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(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）	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,900	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	527	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（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）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 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）	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
１株当たり純資産額　14,784.79円	１株当たり純資産額　16,078.50円
１株当たり当期純利益　3,599.54円	１株当たり当期純利益　4,883.43円

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
当期純利益（百万円）	9,389	12,738
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2022年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	※１	196
無形固定資産		
ソフトウエア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （2022年９月30日）
負債の部	
流動負債	
未払金	5,646

未払費用		4,193
未払法人税等		1,623
賞与引当金		486
その他	※２	655
流動負債合計		12,605
固定負債		
退職給付引当金		2,344
役員退職慰労引当金		33
その他		1
固定負債合計		2,379
負債合計		14,984
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,692
利益剰余金合計		7,067
株主資本合計		33,737
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		394
評価・換算差額等合計		394
純資産合計		34,131
負債・純資産合計		49,116

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	※１	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	※２	579
営業外費用	※３	274
経常利益		8,686
特別利益		―
特別損失	※４	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,737	△12,737	△12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△7,232	△7,232	△7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△576	△576	△576
当中間期変動額合計	△576	△576	△7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウエアについては、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・参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（会計方針の変更）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

（追加情報）

（連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用）

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年８月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(１)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2022年９月30日現在）
有形固定資産	326百万円

※２　消費税等の取扱い

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

３　保証債務

当中間会計期間（2022年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却損	244百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　　**（単位：千株）**

	当事業年度期首株式数	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
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

（金融商品関係）

当中間会計期間（2022年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	－	7,364
資産合計	57	7,306	－	7,364

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,454百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（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	57	55	2
（２）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,692	3,171	△478
小計	2,692	3,171	△478
合計	7,364	6,797	567

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,084.78円
１株当たり中間純利益	2,110.46円

（注１）　潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（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　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
普通株主に帰属しない金額(百万円)	－
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

・監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2022年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	
	日本生命保険相互会社	1,450,000百万円	（注9）	
	三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	（注8）	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	（注3）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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。

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

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について
・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
・使用開始日を記載することがあります。
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
・次の事項を記載することがあります。
①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
・ファンドの形態等を記載することがあります。
・図案を採用することがあります。
・ファンドの管理番号等を記載することがあります。
・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2022年５月23日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1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	深井　康治
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル２５の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワライフスタイル２５の2022年11月30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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月28日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年４月１日から2023年３月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年４月１日から2022年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2022年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年４月１日から2022年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。