【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】	2024年2月27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】	佐竹　優子 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・バランス７０
【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・バランス７０

(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】

2024年2月28日から2024年8月29日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	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	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
一般	年2回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	（　　）	TOPIX
大型株	年4回	北米		なし	その他（合成インデックス）
中小型株	年6回（隔月）	欧州			
債券	年12回（毎月）	アジア			
一般	日々	オセアニア			
公債	その他（　）	中南米			
社債		アフリカ			
その他債券		中近東（中東）			
クレジット属性（　　）		エマージング			
不動産投信					
その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券））					
資産複合（　　）					
資産配分固定型					
資産配分変更型					

（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。

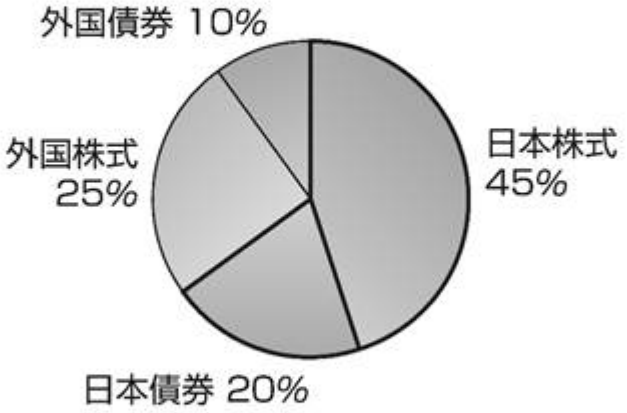
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜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	45%	25%	70%
債 券	20%	10%	30%
合 計	65%	35%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

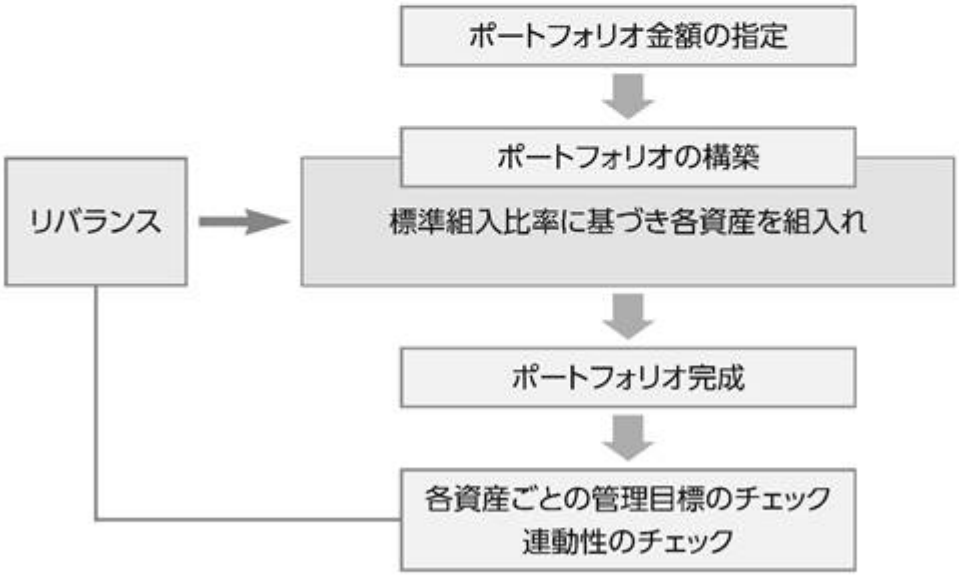
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

・安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
(c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

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

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

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

主な投資制限

- ●株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ●外貨建資産への実質投資割合は、信託財産総額の75％以下とします。

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

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

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

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

NOMURA-BPI総合指数とは

NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

3．外国株式インデックスマザーファンド

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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

4．外国債券インデックスマザーファンド

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

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

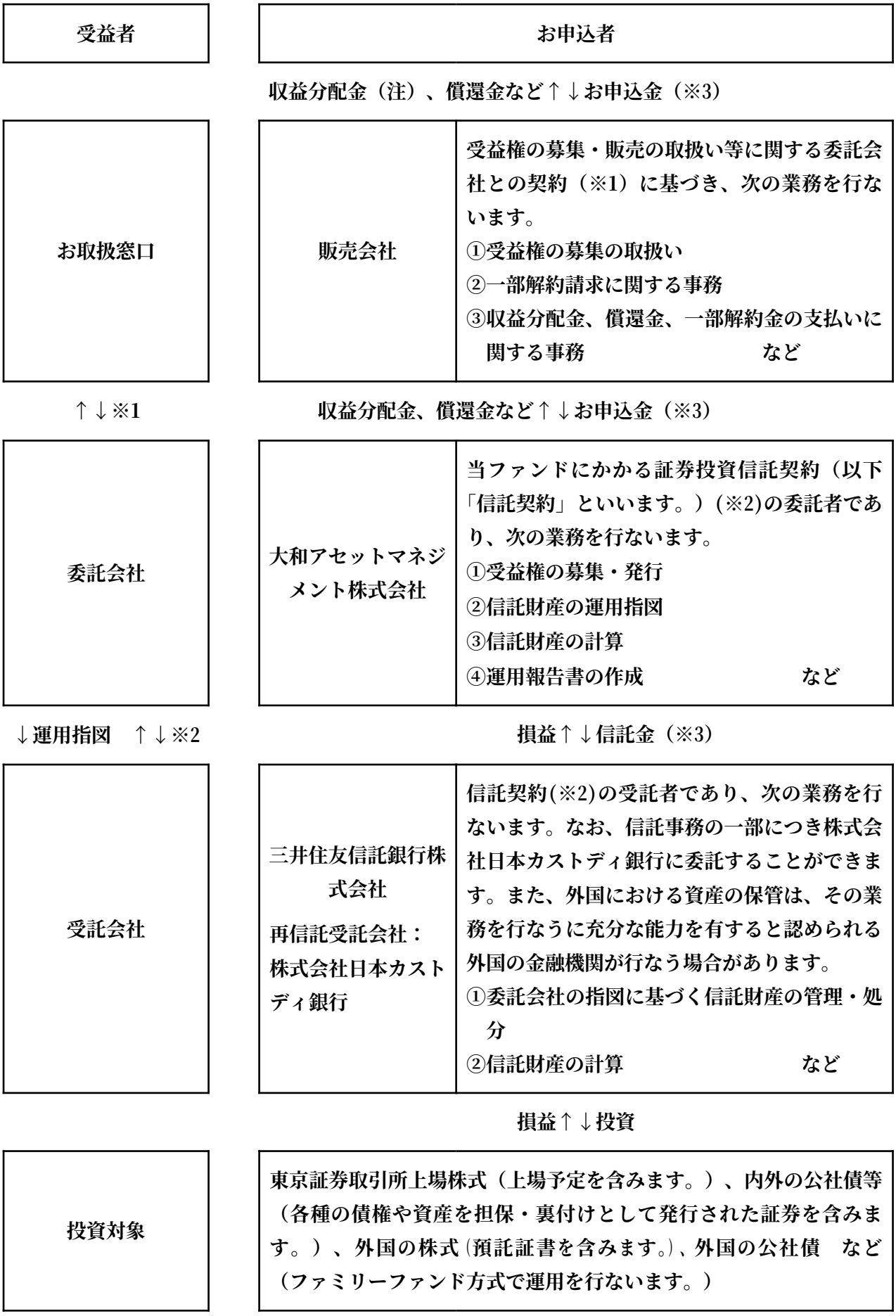
FTSE世界国債インデックスとは

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

(2)【ファンドの沿革】

2005年6月6日　　信託契約締結、当初設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



（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（2023年12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

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

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
（東証株価指数（配当込み））

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

② 投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の45%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券：信託財産の純資産総額の20%
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25%
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．安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
(c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

ヘ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

14．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

24．外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

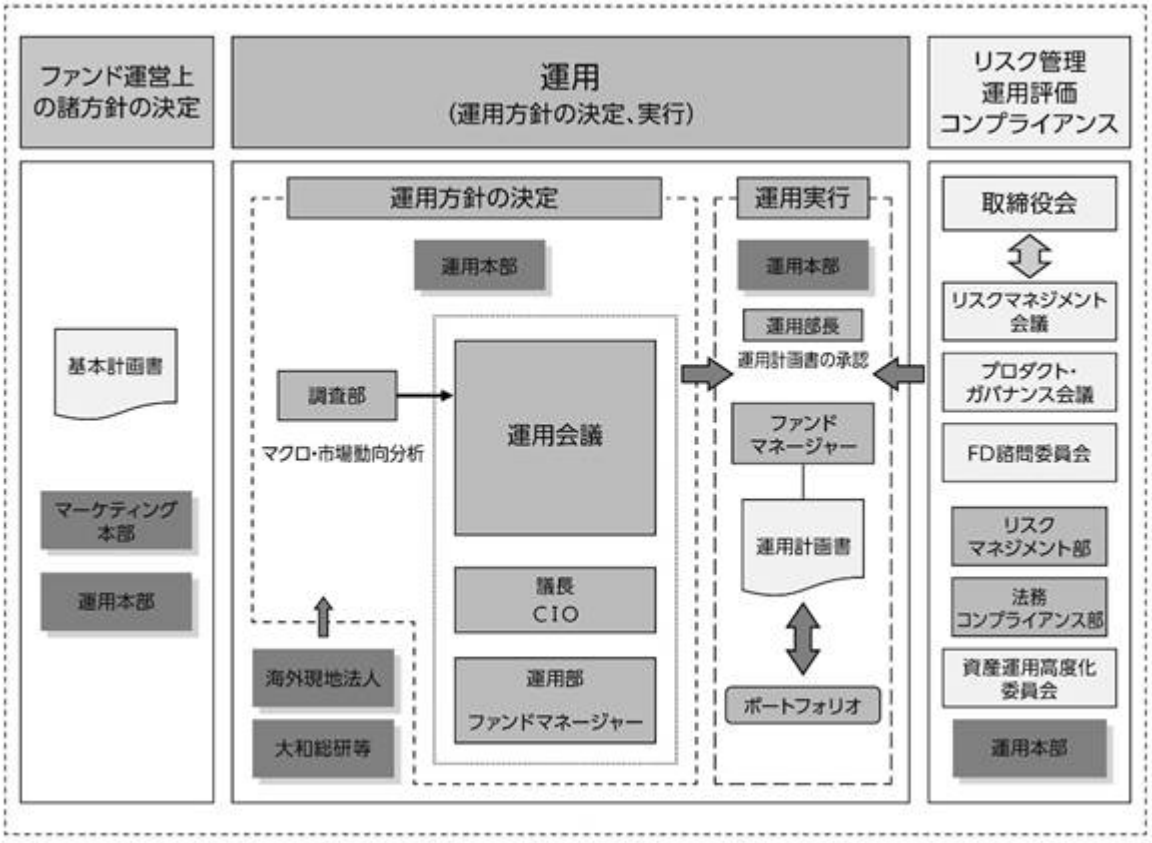
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、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．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

ニ．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2023年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

②　新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③　投資信託証券（信託約款）

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

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

④　投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥　信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

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

⑦　先物取引等（信託約款）

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

1．先物取引の売建ておよびコール・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および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

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

1．先物取引の売建ておよびコール・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金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1．先物取引の売建ておよびコール・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)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

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

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

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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の受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の75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75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総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

3．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

(3)その他の留意点

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

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

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

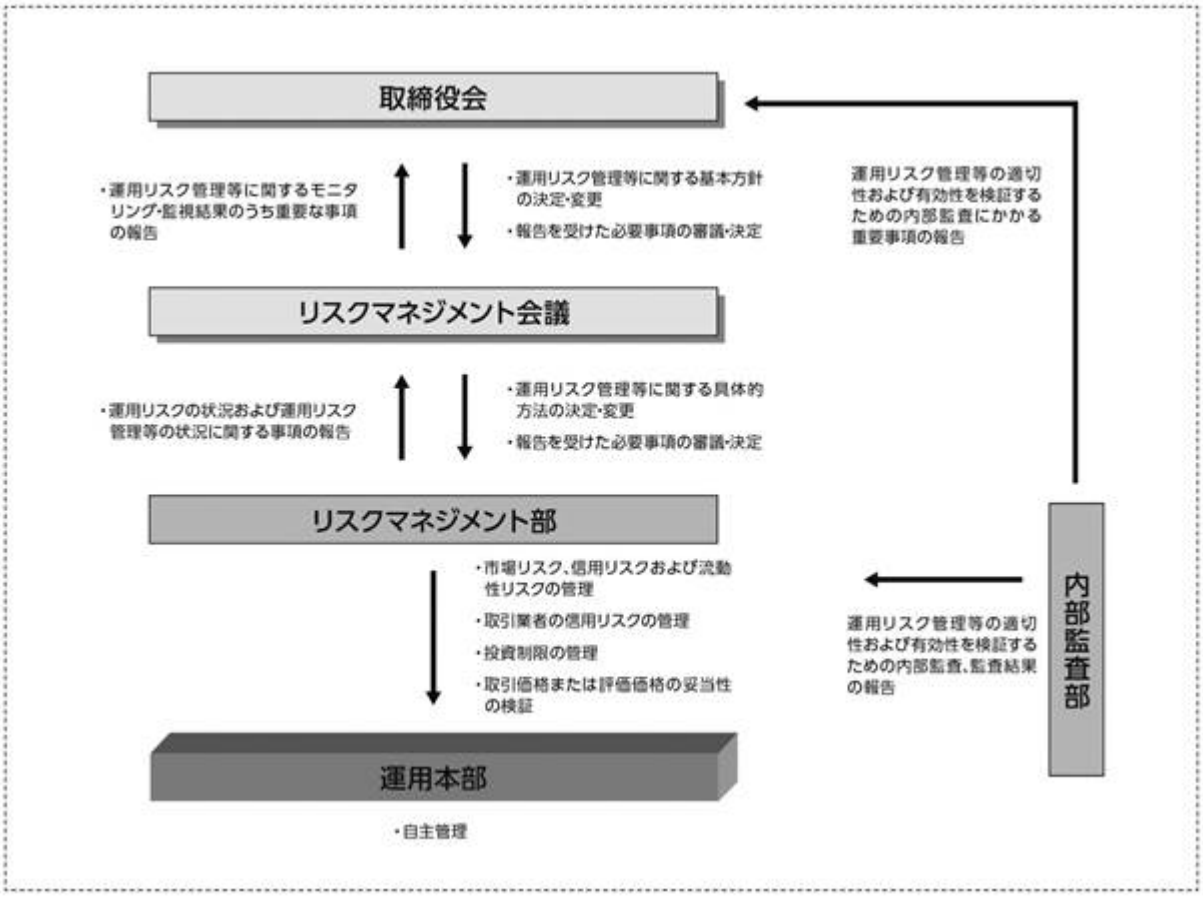
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

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

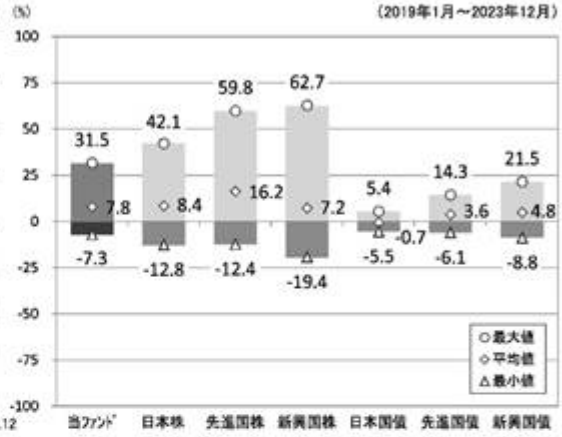
・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.242%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.09% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.03% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2023年12月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2023年12月29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		21,769,474,004	99.61
	内 日本	21,769,474,004	99.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		85,970,599	0.39
純資産総額		21,855,444,603	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】（2023年12月29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	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	5,767,999,704	1.5853 9,144,519,376	1.7002 9,806,753,096	44.87
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,021,863,976	4.7891 4,893,866,266	5.3712 5,488,635,787	25.11
3	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	日本	親投資信託受益証券	3,512,486,439	1.2464 4,378,299,311	1.2280 4,313,333,347	19.74
4	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	629,149,713	3.2514 2,045,637,328	3.4344 2,160,751,774	9.89

（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	99.61%
合計	99.61%

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

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9計算期間末 (2014年6月5日)	2,725,931,441	2,725,931,441	1.4313	1.4313
第10計算期間末 (2015年6月5日)	3,825,801,208	3,825,801,208	1.7864	1.7864
第11計算期間末 (2016年6月6日)	3,825,740,833	3,825,740,833	1.5681	1.5681
第12計算期間末 (2017年6月5日)	4,710,824,279	4,710,824,279	1.8085	1.8085
第13計算期間末 (2018年6月5日)	6,062,194,684	6,062,194,684	1.9623	1.9623
第14計算期間末 (2019年6月5日)	6,388,879,598	6,388,879,598	1.8661	1.8661
第15計算期間末 (2020年6月5日)	7,673,201,997	7,673,201,997	2.0127	2.0127
第16計算期間末 (2021年6月7日)	10,545,756,832	10,545,756,832	2.4168	2.4168
第17計算期間末 (2022年6月6日)	13,280,030,107	13,280,030,107	2.5037	2.5037
2022年12月末日	13,939,267,800	－	2.4389	－
2023年1月末日	14,475,448,911	－	2.5110	－
2月末日	14,768,137,784	－	2.5517	－
3月末日	15,159,280,125	－	2.5780	－
4月末日	15,599,740,742	－	2.6295	－
5月末日	16,218,823,180	－	2.7082	－

第18計算期間末 (2023年6月5日)	17,630,082,975	17,630,082,975	2.7729	2.7729
6月末日	18,662,708,933	－	2.8638	－
7月末日	18,933,708,858	－	2.8782	－
8月末日	19,379,228,917	－	2.8993	－
9月末日	20,437,210,380	－	2.8801	－
10月末日	20,255,022,197	－	2.8074	－
11月末日	21,574,156,574	－	2.9513	－
12月末日	21,855,444,603	－	2.9640	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
2023年6月6日～ 2023年12月5日	－

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第9計算期間	13.7
第10計算期間	24.8
第11計算期間	△12.2
第12計算期間	15.3
第13計算期間	8.5
第14計算期間	△4.9
第15計算期間	7.9
第16計算期間	20.1
第17計算期間	3.6
第18計算期間	10.8
2023年6月6日～ 2023年12月5日	5.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第9計算期間	603,882,364	353,516,691
第10計算期間	656,287,666	419,084,684
第11計算期間	794,789,749	496,658,896
第12計算期間	690,779,192	525,696,208
第13計算期間	977,998,408	493,482,793
第14計算期間	1,104,627,595	770,346,836
第15計算期間	1,113,004,887	724,239,121
第16計算期間	1,292,051,734	740,975,639
第17計算期間	1,598,819,054	658,104,727
第18計算期間	1,673,217,427	619,393,412
2023年6月6日～ 2023年12月5日	1,365,432,873	412,871,626

（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（2023年12月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		277,485,192,200	96.71
	内 日本	277,485,192,200	96.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,449,690,623	3.29
純資産総額		286,934,882,823	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)		9,440,340,000	3.29
	内 日本	9,440,340,000	3.29

(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（2023年12月29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	4,533,800	2,876.73 13,042,539,717	2,590.50 11,744,808,900	4.09
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	584,000	12,808.89 7,480,396,692	13,410.00 7,831,440,000	2.73
3	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	5,094,300	1,323.05 6,740,060,153	1,211.50 6,171,744,450	2.15
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	82,600	57,683.61 4,764,666,474	62,120.00 5,131,112,000	1.79
5	信越化学	日本	株式	化学	750,000	4,632.00 3,474,003,957	5,917.00 4,437,750,000	1.55
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	174,800	20,765.47 3,629,805,085	25,255.00 4,414,574,000	1.54
7	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	24,635,400	180.88 4,456,210,950	172.30 4,244,679,420	1.48
8	日 立	日本	株式	電気機器	405,600	9,929.40 4,027,366,640	10,170.00 4,124,952,000	1.44
9	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	578,500	7,595.45 4,393,970,772	6,880.00 3,980,080,000	1.39
10	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,731,300	2,536.27 4,391,056,274	2,253.50 3,901,484,550	1.36
11	任 天 堂	日本	株式	その他製品	521,300	6,447.28 3,360,970,130	7,359.00 3,836,246,700	1.34
12	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	628,400	5,053.85 3,175,845,316	5,963.00 3,747,149,200	1.31
13	三井物産	日本	株式	卸売業	658,200	5,790.66 3,811,413,072	5,298.00 3,487,143,600	1.22
14	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	587,300	5,724.76 3,362,153,833	5,767.00 3,386,959,100	1.18
15	武田薬品	日本	株式	医薬品	732,900	4,810.06 3,525,298,400	4,054.00 2,971,176,600	1.04
16	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,013,700	1,796.18 3,616,984,342	1,466.00 2,952,084,200	1.03
17	HOYA	日本	株式	精密機器	164,000	16,074.47 2,636,213,812	17,625.00 2,890,500,000	1.01

18	KDDI	日本	株式	情報･通信業	640,000	4,727.72 3,025,745,720	4,486.00 2,871,040,000	1.00
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	801,900	3,581.39 2,871,921,106	3,529.00 2,829,905,100	0.99
20	第一三共	日本	株式	医薬品	721,400	4,055.46 2,925,610,840	3,872.00 2,793,260,800	0.97
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,098,500	2,678.40 2,942,232,972	2,412.50 2,650,131,250	0.92
22	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	408,500	6,493.12 2,652,439,755	6,293.00 2,570,690,500	0.90
23	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	449,200	5,103.35 2,292,426,452	5,251.00 2,358,749,200	0.82
24	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	1,332,400	1,757.90 2,342,237,633	1,759.50 2,344,357,800	0.82
25	ダイキン工業	日本	株式	機械	99,600	24,850.11 2,475,070,969	22,985.00 2,289,306,000	0.80
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	751,300	2,758.30 2,072,311,750	2,993.00 2,248,640,900	0.78
27	SMC	日本	株式	機械	25,000	69,725.69 1,743,142,483	75,760.00 1,894,000,000	0.66
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	928,300	1,912.98 1,775,825,503	1,999.00 1,855,671,700	0.65
29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	494,200	3,391.37 1,676,016,473	3,645.00 1,801,359,000	0.63
30	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	301,100	6,057.63 1,823,955,016	5,595.00 1,684,654,500	0.59

(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	96.71%
合計	96.71%

(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

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.33%
建設業	2.05%

食料品	3.27%
繊維製品	0.39%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.99%
医薬品	4.46%
石油・石炭製品	0.45%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.93%
非鉄金属	0.65%
金属製品	0.51%
機械	5.16%
電気機器	16.98%
輸送用機器	7.92%
精密機器	2.29%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.36%
陸運業	2.75%
海運業	0.81%
空運業	0.44%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.45%
卸売業	6.77%
小売業	4.15%
銀行業	6.71%
証券、商品先物取引業	0.78%
保険業	2.32%
その他金融業	1.11%
不動産業	1.86%
サービス業	4.81%
合計	96.71%

(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 0603月	買建	399	9,349,929,450	9,440,340,000	3.29%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2023年12月29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		45,619,310,100	85.11
	内 日本	45,619,310,100	85.11
地方債証券		3,076,532,257	5.74
	内 日本	3,076,532,257	5.74
特殊債券		1,216,140,103	2.27
	内 日本	1,216,140,103	2.27
社債券		3,377,292,100	6.30
	内 日本	3,377,292,100	6.30
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		312,404,503	0.58
純資産総額		53,601,679,063	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（2023年12月29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	145 5年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	100.17 1,071,829,700	100.15 1,071,637,100	0.100000 2025/09/20	2.00
2	143 5年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.16 901,458,000	100.14 901,296,000	0.100000 2025/03/20	1.68

3	144 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.16 801,358,500	100.14 801,160,000	0.100000 2025/06/20	1.49
4	147 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.91 799,352,000	99.94 799,552,000	0.005000 2026/03/20	1.49
5	347 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	99.91 689,385,900	100.06 690,469,200	0.100000 2027/06/20	1.29
6	149 5年国債	日本	国債証券	650,000,000	99.83 648,930,200	99.89 649,291,500	0.005000 2026/09/20	1.21
7	156 5年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.12 600,720,000	100.27 601,650,000	0.200000 2027/12/20	1.12
8	358 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	98.42 590,570,400	98.90 593,412,000	0.100000 2030/03/20	1.11
9	366 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	97.18 583,098,000	97.67 586,038,000	0.200000 2032/03/20	1.09
10	148 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	99.87 549,321,500	99.92 549,593,000	0.005000 2026/06/20	1.03
11	370 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	98.81 543,477,000	99.30 546,150,000	0.500000 2033/03/20	1.02
12	146 5年国債	日本	国債証券	540,000,000	100.15 540,826,200	100.15 540,842,400	0.100000 2025/12/20	1.01
13	362 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	97.42 535,826,500	97.96 538,818,500	0.100000 2031/03/20	1.01
14	154 5年国債	日本	国債証券	520,000,000	99.82 519,110,800	99.98 519,901,200	0.100000 2027/09/20	0.97
15	353 10年国債	日本	国債証券	520,000,000	99.17 515,720,400	99.38 516,807,200	0.100000 2028/12/20	0.96
16	361 10年国債	日本	国債証券	510,000,000	97.67 498,137,400	98.23 500,993,400	0.100000 2030/12/20	0.93
17	150 5年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.75 498,780,000	99.85 499,260,000	0.005000 2026/12/20	0.93
18	369 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.01 495,065,000	99.48 497,440,000	0.500000 2032/12/20	0.93
19	360 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	97.94 489,740,000	98.49 492,450,000	0.100000 2030/09/20	0.92
20	371 10年国債	日本	国債証券	480,000,000	97.70 468,993,600	98.16 471,196,800	0.400000 2033/06/20	0.88
21	363 10年国債	日本	国債証券	460,000,000	97.16 446,936,000	97.68 449,355,600	0.100000 2031/06/20	0.84
22	151 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	99.67 448,519,500	99.80 449,136,000	0.005000 2027/03/20	0.84

23	364 10年国債	日本	国債証券	450,000,000	96.88 435,996,800	97.39 438,264,000	0.100000 2031/09/20	0.82
24	356 10年国債	日本	国債証券	440,000,000	98.80 434,728,800	99.15 436,282,000	0.100000 2029/09/20	0.81
25	348 10年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.82 429,264,700	100.00 430,000,000	0.100000 2027/09/20	0.80
26	349 10年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.71 428,787,400	99.92 429,660,300	0.100000 2027/12/20	0.80
27	158 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.59 428,258,500	99.74 428,920,700	0.100000 2028/03/20	0.80
28	357 10年国債	日本	国債証券	420,000,000	98.63 414,267,000	99.03 415,934,400	0.100000 2029/12/20	0.78
29	345 10年国債	日本	国債証券	410,000,000	100.04 410,184,500	100.14 410,602,700	0.100000 2026/12/20	0.77
30	161 5年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.35 401,437,000	100.50 402,032,000	0.300000 2028/06/20	0.75

(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	85.11%
地方債証券	5.74%
特殊債券	2.27%
社債券	6.30%
合計	99.42%

(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（2023年12月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		394,204,531,174	92.30
	内 香港	2,478,864,666	0.58
	内 シンガポール	1,465,370,783	0.34
	内 イスラエル	836,418,929	0.20
	内 ノルウェー	830,771,149	0.19
	内 スウェーデン	3,892,504,824	0.91
	内 デンマーク	4,079,520,711	0.96
	内 イギリス	16,810,304,680	3.94
	内 アイルランド	592,238,049	0.14
	内 オランダ	5,230,997,386	1.22
	内 ベルギー	1,023,783,141	0.24
	内 フランス	13,390,343,353	3.14
	内 ドイツ	9,649,448,173	2.26
	内 スイス	10,793,662,024	2.53
	内 ポルトガル	252,009,198	0.06
	内 スペイン	3,006,959,366	0.70
	内 イタリア	2,962,573,922	0.69
	内 フィンランド	1,239,523,665	0.29
	内 オーストリア	206,763,584	0.05
	内 カナダ	12,875,365,191	3.01
	内 アメリカ	294,867,980,404	69.04
	内 オーストラリア	7,474,772,261	1.75
	内 ニュージーランド	244,355,715	0.06
投資証券		8,742,184,936	2.05
	内 香港	137,624,462	0.03
	内 シンガポール	178,472,346	0.04
	内 イギリス	141,184,137	0.03
	内 ベルギー	36,501,502	0.01
	内 フランス	154,805,472	0.04
	内 カナダ	33,596,897	0.01
	内 アメリカ	7,356,706,279	1.72
	内 オーストラリア	703,293,841	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,137,310,650	5.65
純資産総額		427,084,026,760	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）		24,057,701,579	5.63
	内 イギリス	1,007,608,997	0.24
	内 ドイツ	4,392,552,485	1.03
	内 カナダ	1,632,664,656	0.38
	内 アメリカ	15,900,306,006	3.72
	内 オーストラリア	1,124,569,435	0.26
為替予約取引（買建）		12,655,814,230	2.96
	内 日本	12,655,814,230	2.96

(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（2023年12月29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	787,200	26,861.18 21,145,133,453	27,455.45 21,612,931,342	5.06
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	355,500	53,732.57 19,101,969,051	53,225.96 18,921,829,633	4.43
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	467,800	20,751.14 9,707,391,813	21,753.88 10,176,467,590	2.38
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	124,480	68,198.95 8,489,407,966	70,237.05 8,743,108,308	2.05
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	298,800	19,132.15 5,716,718,692	19,888.82 5,942,779,685	1.39

6	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	112,000	47,084.01 5,273,409,596	50,820.52 5,691,898,867	1.33
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	262,840	19,335.68 5,082,208,289	20,037.74 5,266,720,212	1.23
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	143,950	34,602.40 4,981,020,385	35,908.51 5,169,031,368	1.21
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	22,412	133,199.07 2,985,260,102	159,191.41 3,567,797,888	0.84
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	146,370	21,895.85 3,204,910,583	24,153.64 3,535,369,604	0.83
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	46,666	75,969.11 3,545,179,373	74,446.56 3,474,123,496	0.81
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	40,685	83,938.68 3,415,046,152	82,381.95 3,351,709,860	0.78
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	65,950	50,882.07 3,355,673,618	50,714.15 3,344,598,397	0.78
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	80,950	36,069.07 2,919,791,876	36,932.53 2,989,688,465	0.70
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	201,705	14,516.58 2,928,084,846	14,209.94 2,866,217,501	0.67
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	121,300	21,588.08 2,618,640,053	22,207.74 2,693,799,032	0.63
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	42,400	58,144.91 2,465,345,508	60,464.96 2,563,714,541	0.60
18	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	170,516	14,537.06 2,478,803,958	14,718.05 2,509,664,037	0.59
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	50,450	44,124.44 2,226,081,844	49,266.06 2,485,473,171	0.58
20	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	118,767	21,448.38 2,547,376,961	20,668.88 2,454,781,572	0.57
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	19,799	98,816.85 1,956,476,939	107,768.60 2,133,710,670	0.50
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	22,360	83,407.10 1,864,985,018	94,047.47 2,102,901,496	0.49

23	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	127,771	16,678.97 2,131,102,535	16,283.94 2,080,616,524	0.49
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	127,821	14,350.92 1,834,354,579	15,426.84 1,971,875,279	0.46
25	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	88,972	19,666.43 1,749,764,085	21,948.19 1,952,774,583	0.46
26	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	23,020	87,525.13 2,014,829,576	84,462.60 1,944,329,089	0.46
27	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	91,418	20,409.05 1,865,757,252	21,241.87 1,941,890,104	0.45
28	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	49,066	32,801.30 1,609,434,235	37,667.21 1,848,179,395	0.43
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	360,201	4,299.86 1,548,817,400	4,805.20 1,730,837,989	0.41
30	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	206,950	8,259.89 1,709,406,430	8,332.51 1,724,413,462	0.40

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.30%
投資証券	2.05%
合計	94.35%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.41%
素材	3.79%
資本財・サービス	9.77%
一般消費財・サービス	9.80%
生活必需品	6.47%
ヘルスケア	11.65%
金融	14.40%
情報技術	22.34%
コミュニケーション・サービス	6.79%
公益事業	2.53%
不動産	0.34%
合計	92.30%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 24	買建	464	15,461,349,063	15,900,306,006	3.72%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 24	買建	72	993,499,334	1,007,608,997	0.24%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 24	買建	61	1,100,334,386	1,124,569,435	0.26%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 24	買建	60	1,590,070,000	1,632,664,656	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 24	買建	69	1,288,757,474	1,279,031,141	0.30%
		EURO STOXX 50 MAR 24	買建	436	3,144,708,250	3,113,521,344	0.73%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2024年1月	買建	2,300,000	423,202,530	414,724,960	0.10%
		スイス・フラン買/円売 2024年1月	買建	5,300,000	892,415,060	891,027,520	0.21%
		ユーロ買/円売 2024年1月	買建	10,500,000	1,671,754,730	1,647,162,300	0.39%
		豪ドル買/円売 2024年1月	買建	7,300,000	708,673,740	706,468,450	0.17%
		カナダ・ドル買/円売 2024年1月	買建	10,000,000	1,082,909,540	1,070,387,000	0.25%
		米ドル買/円売 2024年1月	買建	56,000,000	8,131,196,240	7,926,044,000	1.86%

(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（2023年12月29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		277,280,751,671	97.37
	内 ユーロ	93,118,066,871	32.70
	内 中国	20,011,925,551	7.03
	内 シンガポール	1,098,663,028	0.39
	内 マレーシア	1,316,498,709	0.46
	内 イスラエル	765,436,630	0.27
	内 ノルウェー	481,659,493	0.17
	内 スウェーデン	558,993,343	0.20
	内 デンマーク	772,676,567	0.27
	内 イギリス	14,451,072,324	5.07
	内 ポーランド	1,344,339,405	0.47
	内 カナダ	5,310,603,365	1.86
	内 アメリカ	131,127,579,614	46.05
	内 メキシコ	2,351,544,698	0.83
	内 オーストラリア	3,940,779,343	1.38
	内 ニュージーランド	630,912,730	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,494,665,935	2.63
純資産総額		284,775,417,606	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,918,672,847	0.67
	内 日本	1,918,672,847	0.67
為替予約取引（売建）		205,774,480	△0.07
	内 日本	205,774,480	△0.07

(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（2023年12月29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	9,700,000	98.77 1,358,870,535	101.97 1,402,880,809	4.125000 2032/11/15	0.49
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	83.48 1,231,445,215	86.22 1,271,861,092	1.875000 2032/02/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,230,272,565	83.62 1,269,077,111	1.125000 2031/02/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,197,380,627	91.86 1,237,802,177	2.750000 2032/08/15	0.43
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,187,657,897	92.94 1,225,988,589	2.875000 2032/05/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,174,405,728	82.97 1,212,154,066	1.250000 2031/08/15	0.43
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,193,027,685	100.24 1,198,440,855	2.390000 2026/11/15	0.42
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,143,476,009	83.27 1,181,032,593	1.375000 2031/11/15	0.41
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,110,988,145	82.31 1,144,165,870	0.875000 2030/11/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,067,265,076	97.29 1,103,936,641	3.500000 2033/02/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,029,177,764	96.29 1,065,297,611	3.375000 2033/05/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,028,485,492	85.96 1,060,777,205	1.625000 2031/05/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,023,580,550	94.30 1,033,808,134	1.625000 2026/05/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.81 961,159,217	100.23 995,133,175	3.875000 2033/08/15	0.35
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	100.18 928,556,285	102.07 946,120,109	2.750000 2027/10/25	0.33
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 894,833,836	81.23 921,736,150	0.625000 2030/08/15	0.32
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 904,598,831	92.22 915,648,806	1.125000 2026/10/31	0.32
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 893,815,496	95.68 909,238,232	2.875000 2028/08/15	0.32

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 869,365,422	95.89 884,041,991	2.875000 2028/05/15	0.31
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 864,299,538	94.20 881,813,558	2.625000 2029/02/15	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 859,475,617	88.12 874,913,812	0.750000 2028/01/31	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.09 858,201,274	93.86 865,318,303	0.250000 2025/06/30	0.30
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 850,598,760	94.97 862,126,703	2.375000 2027/05/15	0.30
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 847,195,691	95.59 860,984,191	2.750000 2028/02/15	0.30
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 849,278,040	100.66 856,656,036	4.375000 2026/08/15	0.30
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 844,465,038	92.74 855,039,174	1.500000 2027/01/31	0.30
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	98.67 788,687,112	101.79 813,648,297	2.500000 2030/05/25	0.29
28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.53 787,471,362	94.51 804,303,747	2.750000 2029/05/31	0.28
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	40,000,000	99.73 794,879,971	100.49 800,897,260	2.670000 2033/05/25	0.28
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,400,000	91.92 779,918,855	94.15 798,873,183	0.750000 2028/05/25	0.28

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.37%
合計	97.37%

(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	米ドル買/円売 2024年1月	買建	2,801,000	398,026,351	396,574,102	0.14%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2024年1月	買建	284,000	25,779,248	25,486,074	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2024年1月	買建	5,564,000	46,764,863	46,256,870	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2024年1月	買建	2,820,000	102,405,360	101,848,975	0.04%
		ユーロ買/円売 2024年1月	買建	1,778,000	276,941,970	278,990,606	0.10%
		英ポンド買/円売 2024年1月	買建	172,000	31,130,871	31,019,029	0.01%
		シンガポール・ドル買/円売 2024年1月	買建	177,000	19,520,002	18,996,560	0.01%
		オフショア人民元買/円売 2024年1月	買建	50,715,000	1,046,331,594	1,009,223,428	0.35%
		カナダ・ドル買/円売 2024年1月	買建	96,000	10,070,572	10,277,203	0.00%
		メキシコ・ペソ売/円買 2024年1月	売建	24,696,000	205,967,356	205,774,480	△0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワ・ライフ・バランス70

2023年12月29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	29,640円
純資産総額	218億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	2.9%
6カ月間	3.5%
1年間	21.5%
3年間	34.1%
5年間	66.3%
設定来	196.4%

※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7期 12年6月	第8期 13年6月	第9期 14年6月	第10期 15年6月	第11期 16年6月	第12期 17年6月	第13期 18年6月	第14期 19年6月	第15期 20年6月	第16期 21年6月	第17期 22年6月	第18期 23年6月
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
国内株式・先物	2,133	44.9%
外国株式・先物	1,203	24.6%
国内債券	334	19.6%
外国債券	972	9.6%
外国リート	55	0.5%
外国投資証券	3	0.0%
コール・ローン、その他		3.7%
合計	4,700	-

通貨別構成	比率
日本円	65.0%
米ドル	23.4%
ユーロ	5.7%
英ポンド	1.6%
カナダ・ドル	1.1%
オフショア人民元	0.7%
スイス・フラン	0.7%
豪ドル	0.7%
デンマーク・クローネ	0.3%
その他	0.9%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.3
最終利回り(%)	1.5
修正デュレーション	8.2
残存年数	9.5

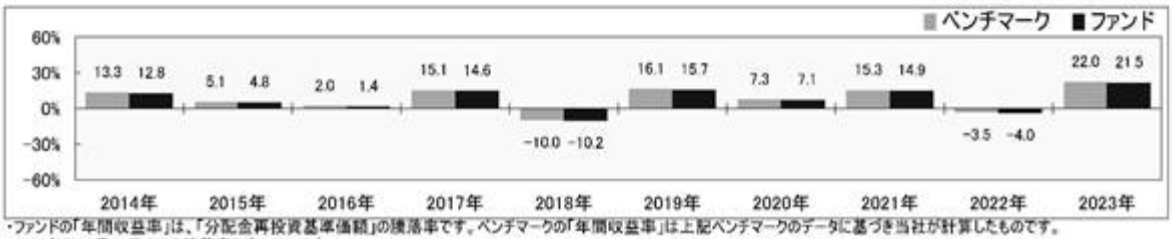
債券格付別構成	比率
AAA	83.8%
AA	9.0%
A	5.4%
BBB	-
BB以下・無格付	1.8%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	1.8%
TOPIX　先物 0603月	日本	1.5%
APPLE INC	アメリカ	1.3%
ソニーグループ	日本	1.2%
MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
S&P500 EMINI MAR 24	アメリカ	0.9%
キーエンス	日本	0.8%
信越化学	日本	0.7%
東京エレクトロン	日本	0.7%
合計		11.0%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.8%保有しております。
※格付別構成については、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。
・2023年は12月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①+②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワ・ライフ・バランス70	0.26%	0.24%	0.01%

※対象期間は2022年6月7日～2023年6月5日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。
解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。
大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- 東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- 外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3.価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

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

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

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

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

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

② 信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2022年6月7日から2023年6月5日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス７０

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 2022年6月6日現在	第18期 2023年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	83,020,779	97,889,579
親投資信託受益証券	13,227,554,424	17,561,683,335
流動資産合計	13,310,575,203	17,659,572,914
資産合計	13,310,575,203	17,659,572,914
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,793,107	11,012,001
未払受託者報酬	2,077,163	2,436,635
未払委託者報酬	13,155,616	15,432,228
その他未払費用	519,210	609,075
流動負債合計	30,545,096	29,489,939
負債合計	30,545,096	29,489,939
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,304,220,047	※1 6,358,044,062
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,975,810,060	11,272,038,913
（分配準備積立金）	2,478,466,312	3,804,150,061
元本等合計	13,280,030,107	17,630,082,975
純資産合計	13,280,030,107	17,630,082,975
負債純資産合計	13,310,575,203	17,659,572,914

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期 自　2021年6月8日 至　2022年6月6日	第18期 自　2022年6月7日 至　2023年6月5日
営業収益		
受取利息	9	32
有価証券売買等損益	433,459,498	1,648,030,911
営業収益合計	433,459,507	1,648,030,943
営業費用		
支払利息	14,921	27,268
受託者報酬	3,947,121	4,709,321
委託者報酬	24,998,935	29,826,166
その他費用	986,619	1,177,162
営業費用合計	29,947,596	35,739,917
営業利益	403,511,911	1,612,291,026
経常利益	403,511,911	1,612,291,026
当期純利益	403,511,911	1,612,291,026
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（△）	31,588,734	29,405,570
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,182,251,112	7,975,810,060
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,359,739,067	2,645,010,975
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,359,739,067	2,645,010,975
剰余金減少額又は欠損金増加額	938,103,296	931,667,578
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	938,103,296	931,667,578
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,975,810,060	11,272,038,913

(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18期 自2022年6月7日 至2023年6月5日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2022年6月5日が休日のため、前計算期間末日を2022年6月6日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第17期 2022年6月6日現在	第18期 2023年6月5日現在
1．　※1 期首元本額	4,363,505,720円	5,304,220,047円
期中追加設定元本額	1,598,819,054円	1,673,217,427円
期中一部解約元本額	658,104,727円	619,393,412円
2．　計算期間末日における受益権の総数	5,304,220,047口	6,358,044,062口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第17期 自2021年6月8日 至2022年6月6日	第18期 自2022年6月7日 至2023年6月5日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（371,926,294円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,861,296,641円）及び分配準備積立金（2,106,540,018円）より分配対象額は10,339,762,953円（1万口当たり19,493.47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（1,582,898,976円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,172,782,955円）及び分配準備積立金（2,221,251,085円）より分配対象額は13,976,933,016円（1万口当たり21,983.07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18期 自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第18期 2023年6月5日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第17期 2022年6月6日現在	第18期 2023年6月5日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	410,409,626	1,630,763,761
合計	410,409,626	1,630,763,761

(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17期 2022年6月6日現在	第18期 2023年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第18期 自2022年6月7日 至2023年6月5日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第17期 2022年6月6日現在	第18期 2023年6月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5037円 (25,037円)	2.7729円 (27,729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	5,099,468,118	8,034,212,019	
	外国株式インデックスマザーファンド	921,363,577	4,375,371,354	
	外国債券インデックスマザーファンド	532,513,009	1,723,691,358	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	2,742,507,483	3,428,408,604	
親投資信託受益証券 合計			17,561,683,335	
合計			17,561,683,335	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2022年6月6日現在 金　額（円）	2023年6月5日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		12,071,596,590	10,496,544,143
株式	※2※3	189,725,861,600	235,920,131,577
派生商品評価勘定		180,860,450	572,330,500
未収入金		27,283,600	-
未収配当金		1,761,580,435	2,050,889,570
未収利息		653,844	480,343
その他未収収益	※4	25,894,232	38,322,027
差入委託証拠金		8,040,000	-
流動資産合計		203,801,770,751	249,078,698,160
資産合計		203,801,770,751	249,078,698,160
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		76,650	-
前受金		160,635,000	431,906,300
未払金		4,015,678,807	-
未払解約金		110,151,390	107,784,740
受入担保金		6,287,724,460	4,800,327,997
流動負債合計		10,574,266,307	5,340,019,037
負債合計		10,574,266,307	5,340,019,037
純資産の部			
元本等			
元本	※1	144,218,034,186	154,707,449,700
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		49,009,470,258	89,031,229,423
元本等合計		193,227,504,444	243,738,679,123
純資産合計		193,227,504,444	243,738,679,123
負債純資産合計		203,801,770,751	249,078,698,160

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1．　※1 期首	2021年6月8日	2022年6月7日
期首元本額	135,290,116,425円	144,218,034,186円
期中追加設定元本額	23,029,834,047円	23,949,619,642円
期中一部解約元本額	14,101,916,286円	13,460,204,128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	2,962,705,495円	2,766,727,363円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	5,195,544,975円	4,582,469,170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	920,931円	914,473円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	23,273,435円	16,539,530円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	330,149,007円	239,546,860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	16,395,434円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	647,820,107円	462,005,847円
日本株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	348,599,985円	582,944,013円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	32,296,608円	13,713,849円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	196,172,434円	230,161,402円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	5,733,854,030円	6,665,168,340円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,906,692,734円	4,452,587,585円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	671,875,066円	861,208,807円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	33,003円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	68,666,878,875円	69,887,459,503円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,242,640,964円	3,205,125,267円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,563,690,746円	4,812,288,474円
ダイワ・ライフ・バランス７０	4,451,168,891円	5,099,468,118円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,479,526,428円	7,096,930,330円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	59,020,682円	53,649,088円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	64,357,313円	71,886,039円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,017,752,901円	3,477,349,497円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,962,436円	12,632,163円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	9,836,532円	10,218,104円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	23,835,616円	30,731,620円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	99,068,349円	5,169,576,821円

	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	85,936,602円	68,265,420円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	97,123,951円	24,867,151円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,642,424,025円	4,404,601,154円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	521,432,579円	414,580,439円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	73,437,877円	59,675,537円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	132,473,472円	93,574,927円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	212,641,219円	206,174,498円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	11,252,126,060円	11,968,348,998円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,885,192,194円	3,416,099,506円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,214,023,891円	3,551,296,505円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,206,087,227円	1,181,419,940円
	ダイワライフスタイル２５	144,026,251円	121,938,701円
	ダイワライフスタイル５０	574,809,555円	524,432,231円
	ダイワライフスタイル７５	443,384,955円	418,523,791円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,971,474,612円	8,435,920,202円
	計	144,218,034,186円	154,707,449,700円
2.	期末日における受益権の総数	144,218,034,186口	154,707,449,700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　6,030,320,920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　4,697,417,000円
4.	※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　864,040,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　1,130,580,000円

5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

〔有価証券に関する注記〕

売買目的有価証券

種類	2022年6月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△10,908,287,189	28,833,380,551
合計	△10,908,287,189	28,833,380,551

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

〔デリバティブ取引に関する注記〕

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	3,380,330,000	-	3,561,215,000	180,885,000	7,341,353,700	-	7,913,880,000	572,526,300
合計	3,380,330,000	-	3,561,215,000	180,885,000	7,341,353,700	-	7,913,880,000	572,526,300

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

（1口当たり情報）

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3398円 (13,398円)	1.5755円 (15,755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	3,900	3,630.00	14,157,000	
ニッスイ	104,200	630.40	65,687,680	
マルハニチロ	15,500	2,492.00	38,626,000	
雪国まいたけ	8,900	966.00	8,597,400	
カネコ種苗	3,200	1,479.00	4,732,800	
サカタのタネ	11,900	3,995.00	47,540,500	貸付株式数　4,700株
ホクト	9,300	1,852.00	17,223,600	
ホクリヨウ	1,200	914.00	1,096,800	貸付株式数　400株
ショーボンドＨＤ	14,200	5,813.00	82,544,600	
ミライト・ワン	34,500	1,771.00	61,099,500	
タマホーム	6,500	3,405.00	22,132,500	貸付株式数　2,600株 (100株)
サンヨーホームズ	1,000	707.00	707,000	貸付株式数　300株
日本アクア	3,400	910.00	3,094,000	
ファーストコーポレーション	2,100	806.00	1,692,600	貸付株式数　200株
ベステラ	1,700	953.00	1,620,100	貸付株式数　600株
キャンディル	1,500	569.00	853,500	貸付株式数　700株
住石ホールディングス	12,600	352.00	4,435,200	
日鉄鉱業	4,200	3,765.00	15,813,000	
三井松島ＨＬＤＧＳ	4,700	2,685.00	12,619,500	貸付株式数　1,800株
ＩＮＰＥＸ	385,400	1,557.50	600,260,500	
石油資源開発	12,100	4,335.00	52,453,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,700	2,224.00	10,452,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	994.00	1,590,400	
第一カッター興業	2,700	1,245.00	3,361,500	貸付株式数　100株

明豊ファシリティワークス	3,000	740.00	2,220,000	
安藤・間	60,400	1,038.00	62,695,200	
東急建設	29,700	712.00	21,146,400	
コムシスホールディングス	35,300	2,788.50	98,434,050	
ビーアールホールディングス	16,500	382.00	6,303,000	
高松コンストラクショングループ	6,800	2,387.00	16,231,600	
東建コーポレーション	3,000	7,620.00	22,860,000	
ソネック	900	978.00	880,200	貸付株式数 200株
ヤマウラ	5,300	1,177.00	6,238,100	貸付株式数 1,600株
オリエンタル白石	37,500	299.00	11,212,500	
大成建設	68,200	4,568.00	311,537,600	
大　林　組	260,700	1,180.00	307,626,000	
清水建設	219,200	868.50	190,375,200	
飛島建設	8,100	1,236.00	10,011,600	
長谷工コーポレーション	75,200	1,665.50	125,245,600	
松井建設	6,800	682.00	4,637,600	
錢　高　組	700	3,060.00	2,142,000	
鹿島建設	161,600	2,055.00	332,088,000	
不動テトラ	5,000	1,772.00	8,860,000	
大末建設	2,100	1,282.00	2,692,200	
鉄建建設	5,200	1,994.00	10,368,800	
西松建設	12,400	3,449.00	42,767,600	貸付株式数 1,000株
三井住友建設	58,800	365.00	21,462,000	貸付株式数 22,800株
大豊建設	3,000	3,840.00	11,520,000	貸付株式数 700株
佐田建設	3,600	446.00	1,605,600	
ナカノフドー建設	4,000	380.00	1,520,000	
奥　村　組	11,800	3,880.00	45,784,000	
東鉄工業	10,000	2,611.00	26,110,000	
イチケン	1,300	1,887.00	2,453,100	
富士ピー・エス	2,500	434.00	1,085,000	貸付株式数 500株
淺沼組	5,800	3,160.00	18,328,000	
戸田建設	89,700	795.60	71,365,320	
熊　谷　組	12,200	3,085.00	37,637,000	
北野建設	1,100	2,957.00	3,252,700	
植　木　組	1,600	1,294.00	2,070,400	
矢作建設	9,900	1,099.00	10,880,100	
ピーエス三菱	9,200	708.00	6,513,600	
日本ハウスＨＬＤＧＳ	14,500	383.00	5,553,500	

大東建託	26,800	13,590.00	364,212,000	
新日本建設	10,200	1,160.00	11,832,000	
東亜道路	2,900	4,125.00	11,962,500	
日本道路	1,500	8,830.00	13,245,000	
東亜建設	6,300	3,125.00	19,687,500	貸付株式数 2,400株
日本国土開発	21,800	583.00	12,709,400	
若築建設	3,200	3,225.00	10,320,000	
東洋建設	23,600	997.00	23,529,200	貸付株式数 9,400株
五洋建設	103,300	723.20	74,706,560	
世紀東急	9,400	1,309.00	12,304,600	
福　田　組	2,700	4,680.00	12,636,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,400	1,655.00	2,317,000	貸付株式数 200株
住友林業	55,900	3,198.00	178,768,200	
日本基礎技術	3,400	505.00	1,717,000	
巴コーポレーション	6,300	446.00	2,809,800	
大和ハウス	203,700	3,691.00	751,856,700	
ライト工業	13,500	1,950.00	26,325,000	
積水ハウス	221,000	2,794.50	617,584,500	
日特建設	7,000	989.00	6,923,000	
北陸電気工事	5,000	873.00	4,365,000	
ユアテック	16,100	818.00	13,169,800	
日本リーテック	6,400	1,367.00	8,748,800	
四電工	3,100	2,086.00	6,466,600	
中電工	11,300	2,206.00	24,927,800	
関　電　工	39,900	1,072.00	42,772,800	
きんでん	51,300	1,877.00	96,290,100	貸付株式数 300株
東京エネシス	7,300	953.00	6,956,900	
トーエネック	2,400	3,645.00	8,748,000	
住友電設	6,900	2,820.00	19,458,000	
日本電設工業	12,000	1,906.00	22,872,000	
エクシオグループ	33,600	2,759.00	92,702,400	
新日本空調	4,000	2,232.00	8,928,000	貸付株式数 1,100株
日本工営	4,600	3,705.00	17,043,000	
九電工	17,700	3,812.00	67,472,400	
三機工業	16,200	1,486.00	24,073,200	
日揮ホールディングス	72,100	1,795.00	129,419,500	
中外炉工業	2,400	2,017.00	4,840,800	
ヤマト	4,700	905.00	4,253,500	
太平電業	4,500	4,175.00	18,787,500	
高砂熱学	17,600	2,420.00	42,592,000	

三晃金属	700	4,240.00	2,968,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	24,900	1,964.00	48,903,600		
朝日工業社	3,000	2,365.00	7,095,000		
明星工業	12,500	927.00	11,587,500		
大　氣　社	8,400	3,790.00	31,836,000		
ダイダン	4,800	2,569.00	12,331,200		
日比谷総合設備	6,300	2,156.00	13,582,800		
ニップン	19,700	1,811.00	35,676,700		
日清製粉Ｇ本社	67,700	1,789.00	121,115,300		
日東富士製粉	1,300	4,690.00	6,097,000		
昭和産業	6,400	2,641.00	16,902,400		
鳥越製粉	4,600	614.00	2,824,400	貸付株式数	300株
中部飼料	10,100	1,080.00	10,908,000		
フィード・ワン	10,700	723.00	7,736,100		
東洋精糖	1,100	1,425.00	1,567,500		
日本甜菜糖	4,300	1,820.00	7,826,000		
ＤＭ三井製糖ホールディ	7,300	2,539.00	18,534,700		
塩水港精糖	6,800	202.00	1,373,600	貸付株式数	1,500株
ウェルネオシュガー	3,800	1,985.00	7,543,000	貸付株式数	1,400株
ＬＩＦＵＬＬ	26,200	253.00	6,628,600		
ＭＩＸＩ	17,400	2,743.00	47,728,200		
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	2,353.00	16,235,700		
日本Ｍ＆Ａセンターホールデ	131,100	1,034.50	135,622,950		
メンバーズ	2,200	1,549.00	3,407,800	貸付株式数	800株
中広	800	402.00	321,600	貸付株式数	400株
ＵＴグループ	11,200	2,937.00	32,894,400		
アイティメディア	2,900	1,274.00	3,694,600	貸付株式数	1,100株
Ｅ・Ｊホールディングス	4,500	1,522.00	6,849,000	貸付株式数	1,400株
オープンアップグループ	22,900	1,999.00	45,777,100		
コシダカホールディングス	22,900	1,163.00	26,632,700	貸付株式数	9,100株
アルトナー	1,400	1,533.00	2,146,200		
パソナグループ	9,300	1,766.00	16,423,800		
ＣＤＳ	1,500	1,780.00	2,670,000	貸付株式数	100株
リンクアンドモチベーション	22,000	428.00	9,416,000	貸付株式数	8,800株
エス・エム・エス	29,100	2,989.00	86,979,900		
サニーサイドアップＧ	1,800	694.00	1,249,200	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	84,300	2,750.00	231,825,000		

リニカル	3,400	775.00	2,635,000		
クックパッド	20,900	178.00	3,720,200	貸付株式数	1,700株
エスクリ	2,400	369.00	885,600	貸付株式数	1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	2,900	651.00	1,887,900	貸付株式数	1,300株
森永製菓	13,400	4,462.00	59,790,800		
中　村　屋	1,800	3,085.00	5,553,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	20,900	3,754.00	78,458,600		
名糖産業	2,900	1,627.00	4,718,300	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	4,000	2,232.00	8,928,000	貸付株式数	100株
不　二　家	5,000	2,503.00	12,515,000	貸付株式数	2,000株
山崎製パン	49,000	2,044.00	100,156,000		
第一屋製パン	1,100	393.00	432,300	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,400	3,720.00	8,928,000	貸付株式数	900株
亀田製菓	4,700	4,210.00	19,787,000		
寿スピリッツ	7,800	10,850.00	84,630,000		
カルビー	33,500	2,780.00	93,130,000		
森永乳業	13,300	5,074.00	67,484,200		
六甲バター	5,400	1,344.00	7,257,600	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	52,300	9,340.00	488,482,000		
明治ホールディングス	89,700	3,174.00	284,707,800		
雪印メグミルク	17,700	1,897.00	33,576,900		
プリマハム	9,800	2,172.00	21,285,600		
日本ハム	28,600	3,852.00	110,167,200		
林兼産業	1,700	486.00	826,200	貸付株式数	600株
丸大食品	7,400	1,490.00	11,026,000		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,100	3,160.00	25,596,000		
柿安本店	2,900	2,325.00	6,742,500	貸付株式数	1,000株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	55,900	707.00	39,521,300	貸付株式数	4,500株
学情	3,500	1,779.00	6,226,500	貸付株式数	300株
スタジオアリス	3,800	2,160.00	8,208,000	貸付株式数	1,500株
クロスキャット	4,300	1,137.00	4,889,100	貸付株式数	1,600株
シミックホールディングス	3,700	2,013.00	7,448,100	貸付株式数	1,500株
エプコ	1,300	741.00	963,300	貸付株式数	600株
システナ	125,300	308.00	38,592,400		
ＮＪＳ	1,700	2,561.00	4,353,700	貸付株式数	600株
デジタルアーツ	4,700	5,860.00	27,542,000		
日鉄ソリューションズ	12,700	4,190.00	53,213,000		
綜合警備保障	28,400	3,926.00	111,498,400		

キューブシステム	4,400	1,179.00	5,187,600	貸付株式数	1,600株 (200株)
いちご	84,300	273.00	23,013,900		
日本駐車場開発	77,500	238.00	18,445,000		
コア	3,300	1,719.00	5,672,700	貸付株式数	600株
カカクコム	56,100	2,076.00	116,463,600		
アイロムグループ	2,700	1,920.00	5,184,000	貸付株式数	1,000株
セントケア・ホールディング	4,900	760.00	3,724,000		
サイネックス	1,000	593.00	593,000		
ルネサンス	5,300	916.00	4,854,800	貸付株式数	2,100株
ディップ	13,400	3,530.00	47,302,000	貸付株式数	4,000株
ＳＢＳホールディングス	6,600	3,140.00	20,724,000		
デジタルホールディングス	6,000	1,034.00	6,204,000		
新日本科学	8,100	2,329.00	18,864,900	貸付株式数	3,200株
キャリアデザインセンター	1,200	1,547.00	1,856,400	貸付株式数	400株
ベネフィット・ワン	35,400	1,649.50	58,392,300		
エムスリー	151,000	3,262.00	492,562,000		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	3,800	472.00	1,793,600	貸付株式数	1,500株
ブラス	700	1,227.00	858,900		
アウトソーシング	45,500	1,296.00	58,968,000		
ウェルネット	4,500	619.00	2,785,500	貸付株式数	1,800株
ワールドホールディングス	3,400	2,806.00	9,540,400	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	30,600	1,870.00	57,222,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	97,400	1,508.50	146,927,900	貸付株式数	30,000株
ぐるなび	14,100	363.00	5,118,300	貸付株式数	5,500株
タカミヤ	10,400	498.00	5,179,200		
ジャパンベストレスキューＳ	3,800	695.00	2,641,000		
ファンコミュニケーションズ	15,000	399.00	5,985,000		
ライク	2,800	1,667.00	4,667,600	貸付株式数	1,000株
ビジネス・ブレークスルー	2,200	434.00	954,800		
エスプール	22,000	586.00	12,892,000		
ＷＤＢホールディングス	3,900	2,140.00	8,346,000		
手間いらず	1,300	3,985.00	5,180,500	貸付株式数	400株
ティア	3,500	438.00	1,533,000	貸付株式数	1,100株
ＣＤＧ	600	1,361.00	816,600	貸付株式数	200株
アドウェイズ	10,500	712.00	7,476,000	貸付株式数	4,300株

バリューコマース	5,700	1,427.00	8,133,900	
インフォマート	79,300	258.00	20,459,400	
サッポロホールディングス	24,100	3,752.00	90,423,200	
アサヒグループホールディン	169,100	5,509.00	931,571,900	
キリンＨＤ	330,200	2,118.00	699,363,600	
宝ホールディングス	50,000	1,059.00	52,950,000	
オエノンホールディングス	21,900	386.00	8,453,400	
養　命　酒	2,400	1,838.00	4,411,200	貸付株式数　700株
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	57,300	1,590.00	91,107,000	
サントリー食品インター	51,500	5,310.00	273,465,000	
ダイドーグループＨＤ	4,100	5,020.00	20,582,000	貸付株式数　1,600株
伊　藤　園	24,800	4,334.00	107,483,200	
キーコーヒー	8,200	2,060.00	16,892,000	
ユニカフェ	1,900	909.00	1,727,100	貸付株式数　700株
ジャパンフーズ	900	1,085.00	976,500	
日清オイリオグループ	10,300	3,365.00	34,659,500	
不二製油グループ	17,000	2,024.00	34,408,000	
かどや製油	700	3,440.00	2,408,000	貸付株式数　100株
Ｊ－オイルミルズ	7,500	1,578.00	11,835,000	
ローソン	19,500	6,187.00	120,646,500	
サンエー	6,000	4,555.00	27,330,000	貸付株式数　2,300株
カワチ薬品	6,100	2,188.00	13,346,800	
エービーシー・マート	11,500	7,905.00	90,907,500	
ハードオフコーポレーション	2,400	1,370.00	3,288,000	
高千穂交易	2,200	2,588.00	5,693,600	貸付株式数　1,000株
アスクル	16,300	1,838.00	29,959,400	貸付株式数　6,300株
ゲオホールディングス	7,700	1,613.00	12,420,100	
アダストリア	9,500	2,841.00	26,989,500	貸付株式数　3,600株
ジーフット	4,100	273.00	1,119,300	貸付株式数　1,700株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	800	516.00	412,800	
オルバヘルスケアＨＬＤＧＳ	900	1,878.00	1,690,200	貸付株式数　400株 (100株)
伊藤忠食品	1,800	5,200.00	9,360,000	
くら寿司	9,200	3,140.00	28,888,000	貸付株式数　3,600株
キャンドゥ	2,800	2,409.00	6,745,200	貸付株式数　1,200株
エレマテック	7,100	1,753.00	12,446,300	

ＩＫホールディングス	1,900	387.00	735,300	貸付株式数	900株
パルグループＨＬＤＧＳ	7,700	3,540.00	27,258,000		
エディオン	31,100	1,397.00	43,446,700	貸付株式数	12,400株
あらた	6,000	4,630.00	27,780,000		
サーラコーポレーション	16,500	747.00	12,325,500	貸付株式数	6,200株
ワッツ	3,000	699.00	2,097,000	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,100	5,720.00	6,292,000	貸付株式数	400株
ハローズ	3,600	3,350.00	12,060,000	貸付株式数	700株
ＪＰホールディングス	22,000	354.00	7,788,000	貸付株式数	1,200株
フジオフードＧ本社	8,700	1,530.00	13,311,000	貸付株式数	3,400株 (100株)
あみやき亭	1,900	3,545.00	6,735,500	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,900	10,220.00	29,638,000		
ひらまつ	13,100	272.00	3,563,200	貸付株式数	5,200株
円谷フィールズホールディ	13,500	2,447.00	33,034,500	貸付株式数	5,400株
双日	78,400	2,859.00	224,145,600		
アルフレッサホールディングス	78,900	2,188.50	172,672,650		
大黒天物産	2,400	4,940.00	11,856,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	6,200	1,550.00	9,610,000	貸付株式数	2,100株
ファーマライズＨＤ	1,300	612.00	795,600	貸付株式数	500株
キッコーマン	48,500	8,474.00	410,989,000		
味　の　素	176,700	5,663.00	1,000,652,100		
ブルドックソース	3,900	1,976.00	7,706,400	貸付株式数	1,500株
キユーピー	39,300	2,261.00	88,857,300		
ハウス食品Ｇ本社	22,400	3,275.00	73,360,000		
カ　ゴ　メ	34,100	3,330.00	113,553,000	貸付株式数	500株
焼津水産化工	2,200	803.00	1,766,600		
アリアケジャパン	6,400	4,992.00	31,948,800		
ピエトロ	800	1,804.00	1,443,200	貸付株式数	100株
エバラ食品工業	2,000	2,965.00	5,930,000	貸付株式数	200株
やまみ	500	1,372.00	686,000	貸付株式数	200株
ニチレイ	33,500	3,068.00	102,778,000		
横浜冷凍	21,400	1,137.00	24,331,800	貸付株式数	3,500株
東洋水産	37,000	6,330.00	234,210,000		
イートアンドＨＬＤＧＳ	3,100	2,169.00	6,723,900	貸付株式数	1,200株
大冷	700	1,919.00	1,343,300		
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	4,600	816.00	3,753,600	貸付株式数	1,800株
日清食品ＨＤ	25,700	12,125.00	311,612,500		

永谷園ホールディングス	3,600	2,125.00	7,650,000		
一正蒲鉾	2,400	784.00	1,881,600	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,500	1,902.00	14,265,000		
ロックフィールド	8,200	1,469.00	12,045,800	貸付株式数	1,300株
日本たばこ産業	481,800	3,117.00	1,501,770,600		
ケンコーマヨネーズ	5,000	1,250.00	6,250,000		
わらべや日洋ＨＤ	5,400	2,259.00	12,198,600		
なとり	4,600	1,940.00	8,924,000	貸付株式数	200株
イフジ産業	1,000	1,019.00	1,019,000	貸付株式数	400株
ファーマフーズ	10,500	1,801.00	18,910,500	貸付株式数	4,200株
北の達人コーポ	31,400	289.00	9,074,600	貸付株式数	12,500株 (1,100株)
ユーグレナ	47,300	898.00	42,475,400	貸付株式数	18,900株
紀文食品	5,700	1,012.00	5,768,400	貸付株式数	2,300株
ピックルスホールディングス	4,300	1,281.00	5,508,300	貸付株式数	1,600株
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	6,600	634.00	4,184,400		
ＳＲＥホールディングス	3,600	3,535.00	12,726,000	貸付株式数	1,400株
ＡＤワークスグループ	14,300	210.00	3,003,000	貸付株式数	2,800株
片倉工業	6,900	1,683.00	11,612,700	貸付株式数	2,600株
グ　ン　ゼ	5,300	4,425.00	23,452,500		
ヒューリック	170,700	1,210.50	206,632,350	貸付株式数	53,400株
神　栄	800	1,083.00	866,400	貸付株式数	300株
ラサ商事	2,800	1,335.00	3,738,000	貸付株式数	900株
アルペン	6,500	1,983.00	12,889,500	貸付株式数	2,600株
ハブ	2,000	740.00	1,480,000	貸付株式数	900株
ラクーンホールディングス	6,200	742.00	4,600,400	貸付株式数	2,400株
クオールホールディングス	10,800	1,679.00	18,133,200	貸付株式数	100株
アルコニックス	10,300	1,337.00	13,771,100		
神戸物産	60,800	3,951.00	240,220,800	貸付株式数	400株
ソリトンシステムズ	3,800	1,185.00	4,503,000	貸付株式数	1,400株
ジンズホールディングス	4,700	3,060.00	14,382,000	貸付株式数	1,700株
ビックカメラ	41,800	1,070.00	44,726,000	貸付株式数	20,600株
ＤＣＭホールディングス	45,700	1,279.00	58,450,300	貸付株式数	18,200株
ペッパーフードサービス	18,600	133.00	2,473,800	貸付株式数	7,200株
ハイパー	1,100	442.00	486,200	貸付株式数	400株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	111,500	2,033.00	226,679,500	貸付株式数	17,700株
東京一番フーズ	1,400	495.00	693,000	貸付株式数	600株

ＤＤグループ	3,900	1,300.00	5,070,000	貸付株式数	1,300株
あい　ホールディングス	12,600	2,330.00	29,358,000		
ディーブイエックス	1,700	926.00	1,574,200	貸付株式数	200株
きちりホールディングス	1,400	895.00	1,253,000	貸付株式数	700株
アークランドサービスＨＤ	6,400	2,947.00	18,860,800	貸付株式数	2,300株
Ｊ．　フロント　リテイリング	97,800	1,413.50	138,240,300		
ドトール・日レスＨＤ	13,900	2,046.00	28,439,400		
マツキヨココカラ＆カンパニー	47,700	7,860.00	374,922,000		
ブロンコビリー	4,200	2,886.00	12,121,200	貸付株式数	1,600株
ＺＯＺＯ	52,000	2,928.50	152,282,000		
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,653.00	6,281,400	貸付株式数	1,600株
物語コーポレーション	13,100	3,145.00	41,199,500	貸付株式数	5,200株
三越伊勢丹ＨＤ	132,400	1,430.00	189,332,000		
東洋紡	32,200	1,007.00	32,425,400		
ユニチカ	22,500	222.00	4,995,000	貸付株式数	4,600株
富士紡ホールディングス	2,900	3,050.00	8,845,000		
日清紡ホールディングス	61,100	1,095.50	66,935,050		
倉敷紡績	5,600	2,266.00	12,689,600		
ダイワボウＨＤ	32,100	2,657.00	85,289,700		
シキボウ	3,200	974.00	3,116,800		
日東紡績	8,400	2,573.00	21,613,200		
トヨタ紡織	31,300	2,394.00	74,932,200		
マクニカホールディングス	18,600	5,170.00	96,162,000		
Ｈａｍｅｅ	2,700	977.00	2,637,900	貸付株式数	1,100株
マーケットエンタープライズ	600	1,253.00	751,800	貸付株式数	200株
ラクト・ジャパン	3,000	1,968.00	5,904,000	貸付株式数	500株
ウエルシアＨＤ	40,800	3,008.00	122,726,400	貸付株式数	15,500株
クリエイトＳＤＨ	13,000	3,450.00	44,850,000	貸付株式数	5,200株
グリムス	3,300	2,756.00	9,094,800		
バイタルＫＳＫＨＤ	11,500	935.00	10,752,500		
八洲電機	6,400	1,319.00	8,441,600	貸付株式数	1,900株
メディアスホールディングス	5,000	799.00	3,995,000	貸付株式数	2,000株
レスターホールディングス	7,500	2,363.00	17,722,500		
ジューテックＨＤ	1,400	1,128.00	1,579,200		
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	7,200	345.00	2,484,000	貸付株式数	2,800株 (300株)

大光	2,600	580.00	1,508,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
ＯＣＨＩホールディングス	1,400	1,229.00	1,720,600	貸付株式数	500株 (500株)
ＴＯＫＡＩホールディングス	38,800	871.00	33,794,800		
黒谷	1,700	593.00	1,008,100	貸付株式数	700株
ミサワ	1,100	615.00	676,500		
ティーライフ	800	1,372.00	1,097,600	貸付株式数	100株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,200	780.00	936,000	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,300	752.00	977,600	貸付株式数	500株
三洋貿易	8,900	1,320.00	11,748,000		
チムニー	1,900	1,253.00	2,380,700	貸付株式数	700株
シュッピン	5,900	1,003.00	5,917,700	貸付株式数	2,300株
ビューティガレージ	1,200	3,660.00	4,392,000	貸付株式数	500株
オイシックス・ラ・大地	10,600	2,254.00	23,892,400	貸付株式数	4,200株
ウイン・パートナーズ	5,700	1,007.00	5,739,900	貸付株式数	1,500株
ネクステージ	17,900	2,550.00	45,645,000	貸付株式数	7,200株
ジョイフル本田	23,400	1,738.00	40,669,200	貸付株式数	9,300株
鳥貴族ホールディングス	2,900	2,227.00	6,458,300	貸付株式数	1,100株
ホットランド	6,000	1,746.00	10,476,000	貸付株式数	2,400株 (2,300株)
すかいらーくＨＤ	107,500	1,860.00	199,950,000	貸付株式数	43,000株
ＳＦＰホールディングス	4,300	1,942.00	8,350,600	貸付株式数	1,700株
綿半ホールディングス	6,100	1,360.00	8,296,000		
日本毛織	19,600	1,010.00	19,796,000	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	9,400	90.00	846,000	貸付株式数	5,500株
トーア紡コーポレーション	2,200	395.00	869,000	貸付株式数	500株
ダイドーリミテツド	8,300	244.00	2,025,200	貸付株式数	3,800株 (100株)
ヨシックスホールディングス	1,200	2,281.00	2,737,200	貸付株式数	100株
ユナイテッド・スーパーマーケ	25,600	1,106.00	28,313,600	貸付株式数	9,600株
三栄建築設計	3,500	1,513.00	5,295,500		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	45,800	3,499.00	160,254,200		
三重交通グループＨＤ	15,700	566.00	8,886,200	貸付株式数	4,000株
サムティ	11,600	2,165.00	25,114,000	貸付株式数	4,600株
地主	5,600	1,942.00	10,875,200	貸付株式数	2,200株

プレサンスコーポレーション	11,600	1,897.00	22,005,200	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,300	912.00	1,185,600	貸付株式数	500株
ハウスコム	900	902.00	811,800		
ＪＰＭＣ	3,700	1,110.00	4,107,000		
サンセイランディック	1,700	872.00	1,482,400	貸付株式数	600株
エストラスト	700	634.00	443,800	貸付株式数	200株
フージャースＨＤ	11,300	947.00	10,701,100		
オープンハウスグループ	26,800	5,573.00	149,356,400		
東急不動産ＨＤ	220,100	786.60	173,130,660		
飯田ＧＨＤ	64,100	2,394.50	153,487,450	貸付株式数	23,500株
イーグランド	900	1,467.00	1,320,300	貸付株式数	400株
帝国繊維	8,400	1,627.00	13,666,800	貸付株式数	3,200株
日本コークス工業	67,200	100.00	6,720,000		
ゴルフダイジェスト・オン	3,600	869.00	3,128,400	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,500	1,330.00	1,995,000	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,300	1,990.00	6,567,000	貸付株式数	1,700株
あさひ	6,600	1,267.00	8,362,200		
日本調剤	5,300	1,121.00	5,941,300	貸付株式数	2,100株
コスモス薬品	7,800	13,770.00	107,406,000	貸付株式数	100株
シップヘルスケアＨＤ	28,300	2,424.50	68,613,350	貸付株式数	10,900株
トーエル	2,700	753.00	2,033,100	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイトＨＤ	6,100	1,641.00	10,010,100	貸付株式数	100株
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	271,000	6,013.00	1,629,523,000		
クリエイト・レストランツ・ホール	59,100	1,011.00	59,750,100	貸付株式数	23,600株
明治電機工業	2,900	1,330.00	3,857,000		
ツルハホールディングス	16,500	9,903.00	163,399,500	貸付株式数	6,600株
デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,400	588.00	1,411,200	貸付株式数	1,000株
スターティアホールディングス	1,200	1,186.00	1,423,200	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	6,300	1,895.00	11,938,500		
フェリシモ	1,400	1,005.00	1,407,000	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	19,600	3,035.00	59,486,000	貸付株式数	7,800株
帝　人	71,500	1,340.50	95,845,750		
東　レ	498,800	771.70	384,923,960		
ク　ラ　レ	118,400	1,333.00	157,827,200		
旭　化　成	464,900	966.40	449,279,360		

ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	8,100	460.00	3,726,000	貸付株式数	3,200株
稲葉製作所	4,000	1,482.00	5,928,000	貸付株式数	1,700株
宮地エンジニアリングＧ	2,100	3,960.00	8,316,000	貸付株式数	800株
トーカロ	21,100	1,396.00	29,455,600		
アルファＣＯ	2,200	1,081.00	2,378,200	貸付株式数	800株
ＳＵＭＣＯ	146,000	2,040.00	297,840,000	貸付株式数	22,500株
川田テクノロジーズ	1,800	5,180.00	9,324,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	5,100	3,235.00	16,498,500		
ジェイテックコーポレーション	800	2,667.00	2,133,600		
信和	3,300	729.00	2,405,700	貸付株式数	1,300株
ビーロット	3,900	641.00	2,499,900	貸付株式数	2,000株
ファーストブラザーズ	1,100	929.00	1,021,900	貸付株式数	500株
ＡＮＤ　ＤＯホールディングス	4,400	1,159.00	5,099,600	貸付株式数	1,700株
シーアールイー	4,100	1,322.00	5,420,200	貸付株式数	1,100株
プロパティエージェント	700	1,166.00	816,200	貸付株式数	200株
ケイアイスター不動産	3,500	4,840.00	16,940,000	貸付株式数	1,400株 (400株)
アグレ都市デザイン	1,000	1,507.00	1,507,000	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,800	4,735.00	8,523,000		
ロードスターキャピタル	4,200	1,590.00	6,678,000	貸付株式数	1,600株
テンポイノベーション	1,700	1,072.00	1,822,400	貸付株式数	400株
グロバルリンクマネジメント	1,100	1,287.00	1,415,700	貸付株式数	500株
フェイスネットワーク	1,600	1,341.00	2,145,600	貸付株式数	600株
住江織物	1,200	2,174.00	2,608,800	貸付株式数	400株
日本フエルト	3,200	413.00	1,321,600	貸付株式数	800株
イチカワ	700	1,336.00	935,200	貸付株式数	100株
エコナックホールディングス	10,200	97.00	989,400	貸付株式数	4,500株
日東製網	600	1,392.00	835,200	貸付株式数	100株
芦森工業	1,100	1,789.00	1,967,900		
アツギ	3,400	412.00	1,400,800		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,000	1,104.00	1,104,000	貸付株式数	500株
ＪＭホールディングス	5,900	1,986.00	11,717,400		
コメダホールディングス	19,300	2,678.00	51,685,400	貸付株式数	7,300株
サツドラホールディングス	2,800	764.00	2,139,200	貸付株式数	1,300株
アレンザホールディングス	5,900	994.00	5,864,600	貸付株式数	2,200株

串カツ田中ＨＬＤＧＳ	2,100	1,676.00	3,519,600		
バロックジャパン	5,100	838.00	4,273,800	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	7,000	7,189.00	50,323,000		
ダイニック	1,500	716.00	1,074,000		
共和レザー	3,300	529.00	1,745,700		
ピーバンドットコム	900	472.00	424,800	貸付株式数	300株
力の源ＨＤ	3,500	1,500.00	5,250,000		
ＦＯＯＤ＆ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮ	41,900	3,360.00	140,784,000	貸付株式数	17,200株
アセンテック	2,600	701.00	1,822,600	貸付株式数	900株
セーレン	14,400	2,300.00	33,120,000	貸付株式数	5,700株
ソトー	1,800	801.00	1,441,800	貸付株式数	1,100株
東海染工	600	1,115.00	669,000	貸付株式数	100株
小松マテーレ	10,800	661.00	7,138,800	貸付株式数	500株
ワコールホールディングス	14,300	2,950.00	42,185,000		
ホギメディカル	10,000	3,240.00	32,400,000		
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,300	669.00	869,700	貸付株式数	500株
ＴＳＩホールディングス	25,100	669.00	16,791,900		
マツオカコーポレーション	1,600	1,105.00	1,768,000	貸付株式数	600株
ワールド	9,600	1,518.00	14,572,800		
ＴＩＳ	81,500	3,855.00	314,182,500		
ＪＮＳホールディングス	2,600	426.00	1,107,600	貸付株式数	1,000株
グリー	20,000	689.00	13,780,000		
GMOペパボ	1,100	1,740.00	1,914,000	貸付株式数	400株
コーエーテクモＨＤ	46,700	2,398.00	111,986,600	貸付株式数	16,700株
三菱総合研究所	3,700	5,220.00	19,314,000		
ボルテージ	1,600	302.00	483,200	貸付株式数	800株
電算	700	1,616.00	1,131,200	貸付株式数	100株
ＡＧＳ	2,400	704.00	1,689,600	貸付株式数	1,000株
ファインデックス	5,900	595.00	3,510,500		
ブレインパッド	5,600	1,015.00	5,684,000	貸付株式数	2,100株
ＫＬａｂ	14,900	351.00	5,229,900	貸付株式数	5,900株
ポールトゥウィンホールディン	12,700	961.00	12,204,700		
ネクソン	193,100	2,960.50	571,672,550		
アイスタイル	21,700	518.00	11,240,600	貸付株式数	8,600株
エムアップホールディングス	9,100	1,099.00	10,000,900	貸付株式数	3,600株 (3,400株)
エイチーム	4,400	743.00	3,269,200		

エニグモ	9,500	393.00	3,733,500		
テクノスジャパン	4,800	598.00	2,870,400	貸付株式数	100株
ｅｎｉｓｈ	4,400	918.00	4,039,200	貸付株式数	1,700株
コロプラ	28,900	685.00	19,796,500		
オルトプラス	4,400	227.00	998,800	貸付株式数	2,100株
ブロードリーフ	43,500	424.00	18,444,000	貸付株式数	2,000株
クロス・マーケティングＧ	3,500	740.00	2,590,000	貸付株式数	1,500株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	4,600	1,323.00	6,085,800		
システム情報	5,900	740.00	4,366,000	貸付株式数	800株
メディアドゥ	3,000	1,435.00	4,305,000		
じげん	21,700	729.00	15,819,300	貸付株式数	700株
ブイキューブ	8,900	507.00	4,512,300	貸付株式数	3,500株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	503.00	653,900	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	1,900	690.00	1,311,000	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	309.00	1,328,700		
フィックスターズ	8,400	1,413.00	11,869,200		
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,500	1,336.00	4,676,000	貸付株式数	1,400株
オプティム	6,100	1,054.00	6,429,400	貸付株式数	600株
セレス	3,000	1,046.00	3,138,000	貸付株式数	1,200株
ＳＨＩＦＴ	5,000	25,810.00	129,050,000		
特種東海製紙	3,300	3,175.00	10,477,500		
ティーガイア	7,800	1,700.00	13,260,000	貸付株式数	1,300株
セック	800	3,220.00	2,576,000		
テクマトリックス	13,600	1,869.00	25,418,400		
プロシップ	3,300	1,427.00	4,709,100	貸付株式数	1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	21,800	2,814.50	61,356,100	貸付株式数	1,500株
GMOペイメントゲートウェイ	14,900	11,090.00	165,241,000		
ザッパラス	1,600	343.00	548,800	貸付株式数	1,000株
システムリサーチ	2,300	2,460.00	5,658,000	貸付株式数	200株
インターネットイニシアティブ	41,600	2,823.00	117,436,800		
さくらインターネット	8,400	675.00	5,670,000	貸付株式数	3,300株
ヴィンクス	1,700	1,453.00	2,470,100		
GMOグローバルサインＨＤ	2,300	3,360.00	7,728,000	貸付株式数	900株
ＳＲＡホールディングス	3,800	3,135.00	11,913,000		

システムインテグレータ	1,700	426.00	724,200	貸付株式数	900株
朝日ネット	8,000	608.00	4,864,000		
ｅＢＡＳＥ	10,500	795.00	8,347,500		
アバントグループ	9,400	1,488.00	13,987,200		
アドソル日進	3,100	1,787.00	5,539,700		
ＯＤＫソリューションズ	1,300	579.00	752,700	貸付株式数	600株
フリービット	3,900	1,623.00	6,329,700		
コムチュア	9,900	2,183.00	21,611,700	貸付株式数	800株
サイバーコム	900	1,539.00	1,385,100	貸付株式数	400株
アステリア	5,800	724.00	4,199,200	貸付株式数	2,300株
アイル	3,500	2,759.00	9,656,500	貸付株式数	1,500株
王子ホールディングス	310,100	547.90	169,903,790		
日本製紙	38,800	1,191.00	46,210,800		
三菱製紙	7,000	496.00	3,472,000		
北越コーポレーション	47,000	924.00	43,428,000	貸付株式数	18,800株
中越パルプ	2,300	1,255.00	2,886,500	貸付株式数	900株
巴川製紙	1,800	656.00	1,180,800	貸付株式数	700株
大王製紙	32,900	1,132.00	37,242,800		
阿波製紙	1,400	556.00	778,400	貸付株式数	600株
マークラインズ	4,000	2,469.00	9,876,000		
メディカル・データ・ビジ	11,100	715.00	7,936,500	貸付株式数	4,400株
ｇｕｍｉ	11,000	717.00	7,887,000	貸付株式数	4,300株
ショーケース	1,300	355.00	461,500	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,200	906.00	1,087,200	貸付株式数	500株
テラスカイ	3,200	2,478.00	7,929,600	貸付株式数	1,200株
デジタル・インフォメーション	4,300	1,604.00	6,897,200		
ＰＣＩホールディングス	2,200	1,034.00	2,274,800	貸付株式数	200株
アイビーシー	900	635.00	571,500	貸付株式数	400株
ネオジャパン	2,500	958.00	2,395,000	貸付株式数	900株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,900	1,432.00	2,720,800	貸付株式数	400株
ラクス	35,300	2,321.50	81,948,950		
ランドコンピュータ	1,400	1,302.00	1,822,800		
ダブルスタンダード	3,000	2,497.00	7,491,000		
オープンドア	5,200	1,214.00	6,312,800	貸付株式数	2,000株
マイネット	1,900	335.00	636,500	貸付株式数	700株
アカツキ	3,500	2,120.00	7,420,000		
ベネフィットジャパン	300	1,224.00	367,200	貸付株式数	200株

ＵＢＩＣＯＭホールディングス	2,300	1,918.00	4,411,400	貸付株式数	600株
カナミックネットワーク	8,000	450.00	3,600,000		
ノムラシステムコーポレーション	5,400	117.00	631,800	貸付株式数	2,900株
レンゴー	67,800	851.00	57,697,800		
トーモク	4,300	1,909.00	8,208,700		
ザ・パック	5,500	3,010.00	16,555,000	貸付株式数	2,100株
チェンジホールディングス	18,300	2,098.00	38,393,400		
シンクロ・フード	3,700	682.00	2,523,400	貸付株式数	200株
オークネット	3,700	1,665.00	6,160,500	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,100	683.00	751,300	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,600	1,111.00	1,777,600	貸付株式数	700株
エイトレッド	900	1,405.00	1,264,500	貸付株式数	400株
マクロミル	14,600	869.00	12,687,400		
ビーグリー	1,000	1,146.00	1,146,000		
オロ	2,200	2,411.00	5,304,200	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,700	2,501.00	6,752,700	貸付株式数	1,000株
テモナ	1,300	255.00	331,500	貸付株式数	500株
ニーズウェル	3,200	708.00	2,265,600	貸付株式数	1,400株
マネーフォワード	18,000	6,279.00	113,022,000	貸付株式数	6,600株
サインポスト	2,200	499.00	1,097,800	貸付株式数	900株
レゾナック・ホールディング	71,900	2,245.00	161,415,500		
住友化学	552,300	428.10	236,439,630		
住友精化	3,100	4,190.00	12,989,000		
日産化学	35,300	6,283.00	221,789,900		
ラサ工業	2,900	2,060.00	5,974,000		
クレハ	6,400	8,440.00	54,016,000		
多木化学	2,900	4,345.00	12,600,500	貸付株式数	1,100株
テイカ	5,000	1,266.00	6,330,000		
石原産業	13,500	1,269.00	17,131,500		
片倉コープアグリ	1,200	1,246.00	1,495,200	貸付株式数	400株
日本曹達	8,000	4,710.00	37,680,000		
東ソー	99,400	1,653.50	164,357,900		
トクヤマ	24,000	2,233.50	53,604,000		
セントラル硝子	11,900	3,160.00	37,604,000		
東亞合成	37,300	1,263.50	47,128,550		
大阪ソーダ	4,500	4,280.00	19,260,000		

関東電化	14,400	881.00	12,686,400	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	5,300	1,254.00	6,646,200	貸付株式数　600株
デンカ	27,100	2,617.00	70,920,700	
イビデン	43,100	7,548.00	325,318,800	
信越化学	618,800	4,527.00	2,801,307,600	
日本カ－バイド	2,200	1,306.00	2,873,200	
電算システムＨＤ	3,600	3,595.00	12,942,000	
堺　化　学	5,700	1,848.00	10,533,600	貸付株式数　1,700株
第一稀元素化学工	6,800	918.00	6,242,400	貸付株式数　800株
エア・ウォーター	70,200	1,843.00	129,378,600	
日本酸素ＨＬＤＧＳ	72,200	3,033.00	218,982,600	
日本化学工業	2,500	1,836.00	4,590,000	
東邦アセチレン	1,200	1,302.00	1,562,400	
日本パ－カライジング	36,900	1,062.00	39,187,800	
高圧ガス	10,800	718.00	7,754,400	
チタン工業	700	1,386.00	970,200	貸付株式数　200株
四国化成ホールディンク	8,800	1,480.00	13,024,000	
戸田工業	1,700	2,365.00	4,020,500	貸付株式数　600株
ステラ　ケミファ	4,400	2,990.00	13,156,000	
保土谷化学	2,100	3,230.00	6,783,000	貸付株式数　100株
日本触媒	11,300	5,345.00	60,398,500	
大日精化	5,200	1,902.00	9,890,400	
カネカ	17,000	3,893.00	66,181,000	貸付株式数　600株
協和キリン	90,100	2,756.00	248,315,600	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	28,200	1,497.00	42,215,400	
三菱瓦斯化学	55,600	2,067.50	114,953,000	
三井化学	61,400	3,712.00	227,916,800	
ＪＳＲ	69,500	3,378.00	234,771,000	
東京応化工業	13,000	8,563.00	111,319,000	
大阪有機化学	5,600	2,588.00	14,492,800	
三菱ケミカルグループ	502,400	810.30	407,094,720	
ＫＨネオケム	12,400	2,320.00	28,768,000	
ダイセル	109,500	1,213.50	132,878,250	
住友ベ－クライト	11,000	5,624.00	61,864,000	
積水化学	152,300	2,004.00	305,209,200	
日本ゼオン	44,700	1,506.00	67,318,200	貸付株式数　16,200株
アイカ工業	18,800	3,069.00	57,697,200	貸付株式数　1,000株
ＵＢＥ	38,400	2,302.50	88,416,000	
積水樹脂	10,800	2,142.00	23,133,600	
タキロンシーアイ	16,300	525.00	8,557,500	

旭有機材	5,000	4,075.00	20,375,000	
ニチバン	4,600	1,854.00	8,528,400	
リケンテクノス	16,000	601.00	9,616,000	
大倉工業	3,500	2,045.00	7,157,500	貸付株式数　1,300株
積水化成品	10,400	406.00	4,222,400	
群栄化学	1,800	2,535.00	4,563,000	
タイガース　ポリマー	2,600	552.00	1,435,200	
ミライアル	1,800	1,678.00	3,020,400	
ダイキアクシス	2,100	712.00	1,495,200	貸付株式数　800株
ダイキョーニシカワ	16,400	760.00	12,464,000	
竹本容器	2,000	803.00	1,606,000	貸付株式数　900株
森六ホールディングス	3,800	1,949.00	7,406,200	
恵和	4,800	1,106.00	5,308,800	貸付株式数　1,900株
日本化薬	56,900	1,226.00	69,759,400	
カーリットホールディングス	6,700	741.00	4,964,700	貸付株式数　100株
ソルクシーズ	4,700	450.00	2,115,000	貸付株式数　2,300株
ＣＬホールディングス	2,100	879.00	1,845,900	貸付株式数　800株
プレステージ・インター	32,200	634.00	20,414,800	
フェイス	1,600	504.00	806,400	貸付株式数　300株
プロトコーポレーション	9,300	1,125.00	10,462,500	
ハイマックス	2,300	1,417.00	3,259,100	
アミューズ	4,100	1,783.00	7,310,300	
野村総合研究所	148,500	3,657.00	543,064,500	
ドリームインキュベータ	2,300	2,764.00	6,357,200	貸付株式数　900株
サイバネットシステム	6,200	879.00	5,449,800	
クイック	5,800	2,012.00	11,669,600	
ＴＡＣ	2,900	200.00	580,000	貸付株式数　900株
ＣＥホールディングス	3,000	574.00	1,722,000	
日本システム技術	2,400	2,323.00	5,575,200	
電通グループ	75,100	4,632.00	347,863,200	
インテージホールディングス	8,400	1,623.00	13,633,200	
テイクアンドギヴニーズ	2,300	1,101.00	2,532,300	貸付株式数　800株
東邦システムサイエンス	1,600	1,161.00	1,857,600	貸付株式数　700株
ぴあ	2,600	3,320.00	8,632,000	貸付株式数　1,000株
イオンファンタジー	3,300	3,645.00	12,028,500	貸付株式数　1,100株
ソースネクスト	37,900	206.00	7,807,400	貸付株式数　15,100株
シーティーエス	8,400	716.00	6,014,400	
ネクシィーズグループ	1,800	659.00	1,186,200	

インフォコム	9,600	2,282.00	21,907,200		
メディカルシステムネットワーク	6,800	375.00	2,550,000		
日本精化	4,200	2,600.00	10,920,000	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	6,900	4,035.00	27,841,500		
トリケミカル	9,900	2,626.00	25,997,400		
シンプレクスHD	12,700	2,398.00	30,454,600		
ＨＥＲＯＺ	2,500	1,807.00	4,517,500	貸付株式数	1,000株
ラクスル	17,900	1,361.00	24,361,900	貸付株式数	8,300株
メルカリ	44,900	2,925.00	131,332,500		
ＩＰＳ	2,400	2,326.00	5,582,400	貸付株式数	900株
ＦＩＧ	6,700	280.00	1,876,000	貸付株式数	2,800株
システムサポート	2,900	1,905.00	5,524,500	貸付株式数	1,100株
ＡＤＥＫＡ	26,000	2,538.50	66,001,000		
日油	23,000	6,122.00	140,806,000	貸付株式数	3,400株
ミヨシ油脂	2,000	985.00	1,970,000		
新日本理化	8,000	218.00	1,744,000	貸付株式数	3,200株 (100株)
ハリマ化成グループ	4,100	849.00	3,480,900		
イーソル	4,800	980.00	4,704,000	貸付株式数	1,800株
アルテリア・ネットワークス	6,900	1,967.00	13,572,300		
東海ソフト	900	1,013.00	911,700	貸付株式数	400株
ウイングアーク１ＳＴ	7,700	2,619.00	20,166,300	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズHD	2,000	1,517.00	3,034,000	貸付株式数	800株
サーバーワークス	1,500	2,342.00	3,513,000	貸付株式数	600株
東名	400	2,144.00	857,600	貸付株式数	200株
ヴィッツ	600	1,365.00	819,000		
トビラシステムズ	1,400	1,028.00	1,439,200	貸付株式数	600株
Ｓａｎｓａｎ	24,400	1,790.00	43,676,000		
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,400	1,049.00	1,468,600		
ギフティ	8,100	1,989.00	16,110,900	貸付株式数	3,200株
花　王	181,300	5,024.00	910,851,200		
第一工業製薬	2,700	1,793.00	4,841,100		
石原ケミカル	3,400	1,624.00	5,521,600		
日華化学	2,300	846.00	1,945,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,000	2,097.00	2,097,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,600	4,145.00	19,067,000	貸付株式数	300株
メドレー	10,000	5,150.00	51,500,000		

ベース	2,500	5,750.00	14,375,000	
ＪＭＤＣ	12,200	5,696.00	69,491,200	
武田薬品	659,700	4,497.00	2,966,670,900	
アステラス製薬	704,200	2,287.50	1,610,857,500	
住友ファーマ	55,300	648.00	35,834,400	
塩野義製薬	94,000	6,383.00	600,002,000	
わかもと製薬	5,400	230.00	1,242,000	貸付株式数　2,800株
日本新薬	17,600	6,556.00	115,385,600	
中外製薬	233,300	3,923.00	915,235,900	
科研製薬	12,800	3,628.00	46,438,400	貸付株式数　500株
エーザイ	90,700	9,800.00	888,860,000	
理研ビタミン	6,300	2,041.00	12,858,300	
ロート製薬	72,200	3,082.00	222,520,400	
小野薬品	143,800	2,757.00	396,456,600	貸付株式数　57,500株
久光製薬	16,600	3,630.00	60,258,000	貸付株式数　6,500株
有機合成薬品	4,200	295.00	1,239,000	貸付株式数　1,100株
持田製薬	8,600	3,355.00	28,853,000	貸付株式数　100株
参天製薬	135,800	1,295.00	175,861,000	
扶桑薬品	2,400	1,985.00	4,764,000	
日本ケミファ	600	1,828.00	1,096,800	貸付株式数　200株
ツムラ	23,500	2,816.00	66,176,000	
テ　ル　モ	228,600	4,444.00	1,015,898,400	
ＨＵグループＨＤ	22,400	2,736.00	61,286,400	
キッセイ薬品工業	11,500	2,913.00	33,499,500	貸付株式数　400株
生化学工業	14,200	759.00	10,777,800	
栄研化学	12,100	1,525.00	18,452,500	
鳥居薬品	4,000	3,550.00	14,200,000	
ＪＣＲファーマ	25,200	1,418.50	35,746,200	貸付株式数　9,900株
東和薬品	11,500	1,771.00	20,366,500	
富士製薬工業	5,500	1,145.00	6,297,500	
ゼリア新薬工業	10,300	2,400.00	24,720,000	
そーせいグループ	25,600	3,060.00	78,336,000	
第一三共	649,400	4,809.00	3,122,964,600	
杏林製薬	16,200	1,737.00	28,139,400	
大幸薬品	14,300	384.00	5,491,200	貸付株式数　5,300株
ダイト	5,200	2,358.00	12,261,600	
大塚ホールディングス	170,500	5,332.00	909,106,000	
大正製薬ＨＤ	16,600	5,274.00	87,548,400	
ペプチドリーム	36,100	2,437.50	87,993,750	
大日本塗料	9,100	889.00	8,089,900	貸付株式数　3,100株

日本ペイントＨＯＬＤ	329,400	1,157.00	381,115,800	
関西ペイント	68,200	2,157.00	147,107,400	
神東塗料	4,800	130.00	624,000	貸付株式数　1,800株
中国塗料	12,200	1,098.00	13,395,600	
日本特殊塗料	3,700	1,008.00	3,729,600	
藤倉化成	10,000	423.00	4,230,000	
太陽ホールディングス	11,300	2,583.00	29,187,900	貸付株式数　2,800株
ＤＩＣ	29,100	2,555.00	74,350,500	
サカタインクス	16,600	1,243.00	20,633,800	貸付株式数　4,700株
東洋インキＳＣホールディン	14,600	2,172.00	31,711,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	6,600	1,200.00	7,920,000	
アルプス技研	6,600	2,861.00	18,882,600	貸付株式数　1,000株
サニックス	12,300	318.00	3,911,400	貸付株式数　5,000株 (5,000株)
日本空調サービス	8,200	737.00	6,043,400	貸付株式数　300株
オリエンタルランド	404,300	5,388.00	2,178,368,400	
フォーカスシステムズ	5,400	1,059.00	5,718,600	
ダスキン	17,000	3,142.00	53,414,000	
パーク２４	57,000	2,163.00	123,291,000	
明光ネットワークジャパン	9,300	634.00	5,896,200	貸付株式数　200株
ファルコホールディングス	3,400	1,831.00	6,225,400	貸付株式数　400株
クレスコ	5,800	1,947.00	11,292,600	貸付株式数　100株
フジ・メディア・ＨＤ	71,600	1,369.50	98,056,200	
秀英予備校	1,300	407.00	529,100	貸付株式数　500株
田谷	1,000	460.00	460,000	貸付株式数　400株
ラウンドワン	63,900	655.00	41,854,500	貸付株式数　24,700株
リゾートトラスト	30,200	2,135.50	64,492,100	貸付株式数　6,300株
オービック	24,900	23,925.00	595,732,500	
ジャストシステム	10,700	4,300.00	46,010,000	
ＴＤＣソフト	6,300	1,567.00	9,872,100	貸付株式数　1,600株
Ｚホールディングス	1,060,800	359.10	380,933,280	
ビー・エム・エル	9,500	3,120.00	29,640,000	
トレンドマイクロ	43,100	7,035.00	303,208,500	
りらいあコミュニケーショ	12,500	1,464.00	18,300,000	
ＩＤホールディングス	5,000	1,143.00	5,715,000	
リソー教育	34,800	309.00	10,753,200	
日本オラクル	14,300	11,060.00	158,158,000	
早稲田アカデミー	4,200	1,380.00	5,796,000	貸付株式数　1,600株
アルファシステムズ	2,300	3,550.00	8,165,000	貸付株式数　900株

フューチャー	18,500	1,780.00	32,930,000	貸付株式数	1,300株
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,600	1,718.00	7,902,800		
ＳＢテクノロジー	3,200	2,454.00	7,852,800		
トーセ	1,700	782.00	1,329,400	貸付株式数	100株
ユー・エス・エス	78,600	2,318.00	182,194,800		
オービックビジネスＣ	14,700	5,340.00	78,498,000		
伊藤忠テクノソリュー	40,000	3,742.00	149,680,000		
アイティフォー	9,800	1,020.00	9,996,000		
東京個別指導学院	9,100	524.00	4,768,400	貸付株式数	3,600株
東計電算	1,000	6,470.00	6,470,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	168,800	1,044.00	176,227,200		
楽天グループ	458,300	575.00	263,522,500	貸付株式数	137,600株
エックスネット	800	1,002.00	801,600	貸付株式数	300株
クリーク・アンド・リバー社	4,500	2,051.00	9,229,500		
ＳＢＩグローバルアセット	12,500	494.00	6,175,000		
テー・オー・ダブリュー	15,000	325.00	4,875,000	貸付株式数	4,200株
大塚商会	42,200	5,489.00	231,635,800		
サイボウズ	10,300	2,482.00	25,564,600	貸付株式数	100株
山田コンサルティンググループ	3,900	1,757.00	6,852,300	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,900	2,451.00	7,107,900	貸付株式数	1,100株
パラカ	2,600	1,924.00	5,002,400		
電通国際情報Ｓ	9,100	5,260.00	47,866,000		
ＡＣＣＥＳＳ	8,800	1,098.00	9,662,400		
デジタルガレージ	13,200	3,995.00	52,734,000		
イーエムシステムズ	12,400	883.00	10,949,200		
ウェザーニューズ	2,300	6,820.00	15,686,000	貸付株式数	100株
ＣＩＪ	12,400	526.00	6,522,400	貸付株式数	100株
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,260.00	3,912,000	貸付株式数	600株
日本エンタープライズ	5,900	135.00	796,500	貸付株式数	2,800株
ＷＯＷＯＷ	5,600	1,093.00	6,120,800	貸付株式数	700株
スカラ	6,900	792.00	5,464,800		
インテリジェント　ウェイブ	3,100	754.00	2,337,400	貸付株式数	1,500株
フルキャストホールディングス	7,300	2,385.00	17,410,500		
エン・ジャパン	13,800	2,495.00	34,431,000	貸付株式数	5,500株
あすか製薬ＨＤ	7,600	1,248.00	9,484,800		
サワイグループＨＤ	17,000	3,339.00	56,763,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	143,000	8,807.00	1,259,401,000		

コニカミノルタ	167,700	472.00	79,154,400	
資　生　堂	155,600	6,506.00	1,012,333,600	
ライオン	89,400	1,378.50	123,237,900	
高砂香料	5,000	2,619.00	13,095,000	
マンダム	16,100	1,477.00	23,779,700	
ミルボン	11,000	4,860.00	53,460,000	貸付株式数　2,200株
ファンケル	32,600	2,404.50	78,386,700	
コーセー	15,200	14,425.00	219,260,000	貸付株式数　5,700株
コタ	6,900	1,602.00	11,053,800	
シーボン	800	1,575.00	1,260,000	
ポーラ・オルビスＨＤ	38,200	1,957.00	74,757,400	
ノエビアホールディングス	6,600	5,350.00	35,310,000	
アジュバンホールディング	1,400	923.00	1,292,200	貸付株式数　600株
新日本製薬	4,300	1,395.00	5,998,500	
アクシージア	3,800	1,212.00	4,605,600	貸付株式数　1,400株
エステー	5,800	1,523.00	8,833,400	
アグロカネショウ	3,000	1,629.00	4,887,000	貸付株式数　1,200株 (300株)
コ　ニ　シ	12,400	2,153.00	26,697,200	
長谷川香料	14,200	3,200.00	45,440,000	
星光ＰＭＣ	3,000	556.00	1,668,000	貸付株式数　100株
小林製薬	21,700	8,044.00	174,554,800	
荒川化学工業	6,300	988.00	6,224,400	
メック	6,100	3,280.00	20,008,000	貸付株式数　2,400株
日本高純度化学	1,900	2,688.00	5,107,200	
タカラバイオ	20,100	1,665.00	33,466,500	
ＪＣＵ	8,300	3,610.00	29,963,000	
新田ゼラチン	3,600	748.00	2,692,800	貸付株式数　1,500株
ＯＡＴアグリオ	2,400	1,849.00	4,437,600	貸付株式数　1,000株
デクセリアルズ	21,500	3,092.00	66,478,000	
アース製薬	6,700	5,090.00	34,103,000	貸付株式数　2,200株
北興化学	7,500	924.00	6,930,000	
大成ラミック	2,400	2,879.00	6,909,600	
クミアイ化学	29,600	969.00	28,682,400	
日本農薬	13,700	618.00	8,466,600	貸付株式数　1,100株
富士興産	1,400	1,396.00	1,954,400	
ニチレキ	8,800	1,712.00	15,065,600	
ユシロ化学	3,900	1,038.00	4,048,200	
ビーピー・カストロール	2,200	884.00	1,944,800	
富士石油	15,200	263.00	3,997,600	貸付株式数　6,000株

ＭＯＲＥＳＣＯ	1,900	1,139.00	2,164,100	貸付株式数　200株
出光興産	82,800	2,829.50	234,282,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,264,400	478.60	605,141,840	
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	29,500	4,084.00	120,478,000	
テスホールディングス	7,900	1,038.00	8,200,200	貸付株式数　2,600株
インフロニアＨＤ	76,400	1,295.50	98,976,200	
横浜ゴム	42,400	3,055.00	129,532,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	42,800	1,763.50	75,477,800	
ブリヂストン	238,000	5,792.00	1,378,496,000	
住友ゴム	73,100	1,262.50	92,288,750	
藤倉コンポジット	4,100	910.00	3,731,000	
オカモト	4,100	3,950.00	16,195,000	
アキレス	4,700	1,418.00	6,664,600	貸付株式数　500株
フ　コ　ク	3,900	1,205.00	4,699,500	
ニッタ	7,600	3,065.00	23,294,000	
クリエートメディック	1,900	891.00	1,692,900	
住友理工	14,500	797.00	11,556,500	
三ツ星ベルト	10,900	4,050.00	44,145,000	
バンドー化学	11,800	1,283.00	15,139,400	
ＡＧＣ	75,900	5,165.00	392,023,500	
日本板硝子	38,000	594.00	22,572,000	
石塚硝子	900	1,548.00	1,393,200	貸付株式数　500株
有沢製作所	12,100	1,086.00	13,140,600	貸付株式数　4,700株
日本山村硝子	2,200	845.00	1,859,000	
日本電気硝子	30,400	2,571.00	78,158,400	貸付株式数　5,500株
オハラ	3,500	1,287.00	4,504,500	貸付株式数　1,300株
住友大阪セメント	10,500	3,640.00	38,220,000	
太平洋セメント	47,500	2,520.00	119,700,000	
リソルホールディングス	500	4,725.00	2,362,500	貸付株式数　200株
日本ヒユーム	6,500	759.00	4,933,500	
日本コンクリート	14,500	281.00	4,074,500	
三谷セキサン	3,100	5,140.00	15,934,000	
アジアパイルＨＤ	11,600	604.00	7,006,400	
東海カーボン	62,500	1,227.00	76,687,500	貸付株式数　25,000株
日本カーボン	4,300	4,470.00	19,221,000	
東洋炭素	4,700	5,190.00	24,393,000	
ノリタケ	3,700	5,020.00	18,574,000	
ＴＯＴＯ	49,200	4,559.00	224,302,800	

日本碍子	86,700	1,741.00	150,944,700	
日本特殊陶業	56,700	2,647.00	150,084,900	
ダントーホールディングス	4,100	690.00	2,829,000	貸付株式数 2,000株
ＭＡＲＵＷＡ	2,800	19,620.00	54,936,000	
品川リフラクトリーズ	2,100	4,910.00	10,311,000	
黒崎播磨	1,500	6,830.00	10,245,000	
ヨータイ	4,000	1,416.00	5,664,000	
東京窯業	5,300	319.00	1,690,700	貸付株式数 1,800株
ニッカトー	2,600	595.00	1,547,000	貸付株式数 700株
フジミインコーポレーテッド	5,900	9,360.00	55,224,000	貸付株式数 2,300株
クニミネ工業	1,700	928.00	1,577,600	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,049.00	1,153,900	
ニチアス	18,800	2,800.00	52,640,000	
日本製鉄	343,400	2,857.00	981,093,800	
神戸製鋼所	154,200	1,196.00	184,423,200	貸付株式数 1,500株
中山製鋼所	15,800	796.00	12,576,800	
合同製鐵	3,800	3,295.00	12,521,000	
ＪＦＥホールディングス	204,900	1,824.50	373,840,050	
東京製鐵	21,500	1,379.00	29,648,500	
共英製鋼	8,700	1,922.00	16,721,400	
大和工業	12,600	5,786.00	72,903,600	
東京鐵鋼	3,600	2,716.00	9,777,600	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,500	1,377.00	4,819,500	貸付株式数 1,200株
淀川製鋼所	8,700	3,060.00	26,622,000	
中部鋼鈑	6,300	1,821.00	11,472,300	
丸一鋼管	23,300	3,213.00	74,862,900	
モリ工業	1,400	3,290.00	4,606,000	
大同特殊鋼	9,700	5,356.00	51,953,200	
日本高周波	2,000	326.00	652,000	貸付株式数 900株
日本冶金工	5,600	4,040.00	22,624,000	
山陽特殊製鋼	7,600	2,642.00	20,079,200	
愛知製鋼	4,400	2,732.00	12,020,800	
日本金属	1,300	878.00	1,141,400	貸付株式数 400株
大平洋金属	5,400	1,569.00	8,472,600	
新日本電工	45,700	276.00	12,613,200	
栗本鉄工所	3,600	1,973.00	7,102,800	
虹　技	700	1,202.00	841,400	貸付株式数 100株
日本鋳鉄管	600	1,057.00	634,200	貸付株式数 300株
日本製鋼所	20,700	3,018.00	62,472,600	

三菱製鋼	4,800	1,223.00	5,870,400		
日亜鋼業	6,000	313.00	1,878,000		
日本精線	1,000	4,475.00	4,475,000	貸付株式数	100株
エンビプロＨＤ	4,100	607.00	2,488,700	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	10,900	1,318.00	14,366,200		
日本軽金属ＨＤ	20,700	1,369.00	28,338,300		
三井金属	22,300	3,184.00	71,003,200		
東邦亜鉛	4,500	1,681.00	7,564,500		
三菱マテリアル	51,200	2,440.50	124,953,600		
住友鉱山	88,900	4,520.00	401,828,000		
ＤＯＷＡホールディングス	17,200	4,318.00	74,269,600	貸付株式数	4,400株
古河機金	11,200	1,482.00	16,598,400		
エス・サイエンス	35,500	24.00	852,000	貸付株式数	15,200株
大阪チタニウム	11,300	3,035.00	34,295,500	貸付株式数	4,400株
東邦チタニウム	13,900	1,962.00	27,271,800	貸付株式数	5,500株
ＵＡＣＪ	10,700	2,630.00	28,141,000		
ＣＫサンエツ	1,800	4,185.00	7,533,000	貸付株式数	100株
古河電工	25,500	2,439.50	62,207,250		
住友電工	264,800	1,697.50	449,498,000		
フジクラ	82,200	1,167.50	95,968,500		
ＳＷＣＣ	8,600	1,915.00	16,469,000		
タツタ電線	15,600	716.00	11,169,600	貸付株式数	900株
カナレ電気	900	1,346.00	1,211,400	貸付株式数	300株
平河ヒューテック	4,400	1,403.00	6,173,200	貸付株式数	1,600株
いよぎんホールディンク	87,100	760.90	66,274,390	貸付株式数	5,800株
しずおかフィナンシャルク	165,400	1,045.50	172,925,700		
ちゅうぎんフィナンシャ	61,600	874.00	53,838,400		
楽天銀行	24,800	1,891.00	46,896,800		
リョービ	8,200	1,644.00	13,480,800		
アーレステイ	6,600	606.00	3,999,600		
アサヒＨＤ	31,000	1,958.00	60,698,000		
東洋製罐グループＨＤ	45,700	2,136.00	97,615,200		
ホッカンホールディングス	4,100	1,346.00	5,518,600	貸付株式数	1,400株
コロナ	4,300	885.00	3,805,500		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	9,600	2,331.00	22,377,600		
駒井ハルテック	1,000	1,730.00	1,730,000		
高田機工	500	2,726.00	1,363,000		
三和ホールディングス	70,600	1,729.00	122,067,400		
文化シヤッター	22,100	1,122.00	24,796,200	貸付株式数	8,900株
三協立山	8,800	656.00	5,772,800		

アルインコ	5,800	985.00	5,713,000	貸付株式数	1,600株
東洋シヤツター	1,400	574.00	803,600	貸付株式数	300株
ＬＩＸＩＬ	111,700	1,854.00	207,091,800		
日本フイルコン	3,900	456.00	1,778,400		
ノーリツ	11,300	1,775.00	20,057,500		
長府製作所	7,700	2,400.00	18,480,000		
リンナイ	41,700	3,048.00	127,101,600		
ユニプレス	13,300	1,018.00	13,539,400	貸付株式数	1,500株
ダイニチ工業	3,000	699.00	2,097,000		
日東精工	11,100	597.00	6,626,700		
三洋工業	700	1,858.00	1,300,600	貸付株式数	200株
岡　部	12,300	782.00	9,618,600	貸付株式数	3,100株
ジーテクト	8,500	1,369.00	11,636,500		
東　プ　レ	13,500	1,441.00	19,453,500		
高周波熱錬	11,800	918.00	10,832,400	貸付株式数	2,600株
東京製綱	4,500	1,066.00	4,797,000		
サンコール	5,300	505.00	2,676,500		
モリテックスチル	4,400	265.00	1,166,000	貸付株式数	2,300株
パイオラックス	10,600	1,952.00	20,691,200		
エイチワン	7,900	648.00	5,119,200		
日本発条	67,800	978.40	66,335,520		
中央発條	5,700	696.00	3,967,200		
アドバネクス	700	990.00	693,000	貸付株式数	400株
三浦工業	31,300	3,904.00	122,195,200	貸付株式数	100株
タ　ク　マ	23,100	1,467.00	33,887,700		
テクノプロ・ホールディング	45,200	3,272.00	147,894,400		
アトラグループ	1,400	181.00	253,400	貸付株式数	600株
インターワークス	1,500	346.00	519,000	貸付株式数	800株
アイ・アールジャパンＨＤ	4,000	1,640.00	6,560,000	貸付株式数	1,300株
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,700	5,040.00	23,688,000	貸付株式数	1,800株
ファーストロジック	700	905.00	633,500	貸付株式数	200株
三機サービス	900	1,035.00	931,500	貸付株式数	500株
Ｇｕｎｏｓｙ	6,100	626.00	3,818,600	貸付株式数	2,400株
デザインワン・ジャパン	1,500	173.00	259,500	貸付株式数	200株
イー・ガーディアン	2,900	1,997.00	5,791,300	貸付株式数	1,100株
リブセンス	2,800	253.00	708,400	貸付株式数	1,300株
ジャパンマテリアル	23,400	2,258.00	52,837,200		
ベクトル	12,000	1,345.00	16,140,000		

ウチヤマホールディングス	2,500	308.00	770,000	貸付株式数	200株
チャームケアコーポレーション	6,400	1,212.00	7,756,800	貸付株式数	2,500株
キャリアリンク	2,800	2,827.00	7,915,600	貸付株式数	1,100株
ＩＢＪ	4,700	673.00	3,163,100	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,800	1,631.00	6,197,800	貸付株式数	400株
バリューＨＲ	6,700	1,451.00	9,721,700	貸付株式数	2,600株
M&Aキャピタルパートナー	6,200	3,115.00	19,313,000		
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,700	1,018.00	2,748,600	貸付株式数	900株
ＥＲＩホールディングス	1,500	1,334.00	2,001,000		
アビスト	900	3,100.00	2,790,000	貸付株式数	400株
シグマクシス・ホールディンク	11,600	1,215.00	14,094,000		
ウィルグループ	6,400	1,053.00	6,739,200		
エスクローＡＪ	6,200	143.00	886,600	貸付株式数	2,900株
メドピア	6,700	1,088.00	7,289,600	貸付株式数	2,600株
レアジョブ	1,100	1,026.00	1,128,600	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	565,600	4,486.00	2,537,281,600		
エラン	10,100	854.00	8,625,400		
ツ　ガ　ミ	16,700	1,394.00	23,279,800		
オークマ	7,500	7,081.00	53,107,500		
芝浦機械	7,500	4,750.00	35,625,000		
アマダ	119,800	1,383.00	165,683,400		
アイダエンジニア	15,400	906.00	13,952,400		
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	1,500	1,241.00	1,861,500	貸付株式数	600株
ＦＵＪＩ	32,600	2,374.00	77,392,400	貸付株式数	1,600株
牧野フライス	8,300	5,380.00	44,654,000	貸付株式数	3,300株
オーエスジー	35,800	1,996.00	71,456,800		
ダイジェット	600	865.00	519,000	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	21,000	812.00	17,052,000		
DMG森精機	45,500	2,463.50	112,089,250	貸付株式数	17,700株
ソディツク	20,700	715.00	14,800,500		
ディスコ	36,100	21,005.00	758,280,500		
日東工器	3,600	1,979.00	7,124,400		
日進工具	6,300	1,153.00	7,263,900		
パンチ工業	5,300	497.00	2,634,100	貸付株式数	2,000株
冨士ダイス	2,700	689.00	1,860,300	貸付株式数	1,200株

土木管理総合試験	2,500	334.00	835,000	貸付株式数 100株
日本郵政	919,300	1,009.00	927,573,700	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	10,200	1,403.00	14,310,600	
鎌倉新書	8,700	844.00	7,342,800	貸付株式数 3,400株 (1,300株)
ＳＭＮ	1,400	455.00	637,000	
一蔵	800	571.00	456,800	貸付株式数 400株
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,100	689.00	757,900	
エアトリ	5,600	2,664.00	14,918,400	貸付株式数 2,200株
アトラエ	4,500	823.00	3,703,500	
ストライク	3,200	3,515.00	11,248,000	
ソラスト	21,000	627.00	13,167,000	
セラク	2,300	1,534.00	3,528,200	貸付株式数 1,000株
インソース	16,600	1,333.00	22,127,800	
豊田自動織機	54,300	9,156.00	497,170,800	
豊和工業	3,200	790.00	2,528,000	貸付株式数 1,200株
石川製作所	1,500	1,318.00	1,977,000	貸付株式数 700株
東洋機械金属	4,000	631.00	2,524,000	
津田駒工業	1,100	454.00	499,400	貸付株式数 500株
エンシュウ	1,200	686.00	823,200	貸付株式数 600株
島精機製作所	11,900	1,783.00	21,217,700	
オプトラン	11,100	2,363.00	26,229,300	
ＮＣホールディングス	1,200	2,224.00	2,668,800	
イワキポンプ	5,000	1,311.00	6,555,000	
フリュー	7,900	1,089.00	8,603,100	貸付株式数 3,000株
ヤマシンフィルタ	17,900	321.00	5,745,900	貸付株式数 1,300株
日阪製作所	7,300	881.00	6,431,300	
やまびこ	12,300	1,477.00	18,167,100	
野村マイクロ・サイエンス	2,500	6,340.00	15,850,000	
平田機工	3,600	7,450.00	26,820,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	8,300	546.00	4,531,800	貸付株式数 100株
マルマエ	3,300	1,720.00	5,676,000	貸付株式数 1,400株 (900株)
タツモ	4,100	1,950.00	7,995,000	
ナブテスコ	47,100	3,281.00	154,535,100	
三井海洋開発	9,400	1,427.00	13,413,800	
レオン自動機	7,900	1,461.00	11,541,900	
ＳＭＣ	24,300	81,080.00	1,970,244,000	
ホソカワミクロン	5,300	2,850.00	15,105,000	

ユニオンツール	3,300	3,280.00	10,824,000	
オイレス工業	10,500	1,913.00	20,086,500	貸付株式数 4,000株
日精エーエスビー	3,000	4,030.00	12,090,000	
サト－ホールディングス	10,700	1,952.00	20,886,400	
技研製作所	7,100	2,000.00	14,200,000	貸付株式数 1,300株
日本エアーテック	3,800	1,199.00	4,556,200	貸付株式数 1,200株
カ　ワ　タ	1,700	945.00	1,606,500	
日精樹脂工業	5,600	955.00	5,348,000	
オカダアイヨン	1,800	1,912.00	3,441,600	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,500	3,290.00	8,225,000	貸付株式数 1,100株
小松製作所	351,700	3,519.00	1,237,632,300	
住友重機械	44,400	3,232.00	143,500,800	
日立建機	29,900	3,749.00	112,095,100	
日　工	11,100	635.00	7,048,500	
巴工業	3,200	2,449.00	7,836,800	貸付株式数 1,200株
井関農機	7,000	1,202.00	8,414,000	
ＴＯＷＡ	7,700	2,441.00	18,795,700	
丸山製作所	1,000	1,804.00	1,804,000	貸付株式数 100株
北川鉄工所	3,000	1,221.00	3,663,000	
シンニッタン	6,400	238.00	1,523,200	貸付株式数 1,900株
ローツェ	3,900	11,440.00	44,616,000	貸付株式数 1,500株
タカキタ	1,600	435.00	696,000	貸付株式数 800株
クボタ	397,200	2,034.00	807,904,800	
荏原実業	3,600	3,120.00	11,232,000	
東洋エンジニア	9,600	551.00	5,289,600	
三菱化工機	2,400	2,514.00	6,033,600	
月島ホールディングス	10,100	1,181.00	11,928,100	
帝国電機製作所	5,300	2,372.00	12,571,600	
東京機械	1,400	473.00	662,200	
新東工業	15,200	1,109.00	16,856,800	
渋谷工業	7,000	2,601.00	18,207,000	
アイチ　コーポレーション	10,500	837.00	8,788,500	
小森コーポレーション	17,400	917.00	15,955,800	
鶴見製作所	5,700	2,510.00	14,307,000	
日本ギア工業	1,900	392.00	744,800	貸付株式数 800株
酒井重工業	900	4,470.00	4,023,000	
荏原製作所	30,700	6,541.00	200,808,700	
石井鉄工所	700	2,526.00	1,768,200	貸付株式数 200株
酉島製作所	6,500	1,608.00	10,452,000	

北越工業	7,500	1,252.00	9,390,000	
ダイキン工業	89,600	28,915.00	2,590,784,000	
オルガノ	10,300	3,855.00	39,706,500	
トーヨーカネツ	2,900	3,490.00	10,121,000	
栗田工業	42,000	5,871.00	246,582,000	
椿本チエイン	10,600	3,470.00	36,782,000	
大同工業	2,300	718.00	1,651,400	貸付株式数 900株
日　機　装	17,300	888.00	15,362,400	
木村化工機	5,700	731.00	4,166,700	貸付株式数 2,200株
レイズネクスト	10,500	1,381.00	14,500,500	
アネスト岩田	12,800	1,081.00	13,836,800	貸付株式数 100株
ダイフク	116,100	2,975.00	345,397,500	
サムコ	2,000	5,550.00	11,100,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	2,700	1,127.00	3,042,900	貸付株式数 1,000株
油研工業	900	1,982.00	1,783,800	
タダノ	39,600	1,079.50	42,748,200	
フジテック	26,300	3,699.00	97,283,700	貸付株式数 10,200株
ＣＫＤ	20,800	2,296.00	47,756,800	
平和	25,000	2,405.00	60,125,000	
理想科学工業	6,700	2,331.00	15,617,700	
ＳＡＮＫＹＯ	14,800	6,056.00	89,628,800	
日本金銭機械	8,200	1,134.00	9,298,800	貸付株式数 3,300株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,400	3,250.00	14,300,000	
フクシマガリレイ	5,500	5,460.00	30,030,000	
オーイズミ	2,200	488.00	1,073,600	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,100	3,050.00	12,505,000	貸付株式数 1,600株
竹内製作所	13,600	3,985.00	54,196,000	
ア　マ　ノ	21,300	3,014.00	64,198,200	
ＪＵＫＩ	11,600	579.00	6,716,400	
サンデン	8,700	191.00	1,661,700	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	7,600	595.00	4,522,000	
ブラザー工業	100,300	2,164.50	217,099,350	
マックス	9,200	2,335.00	21,482,000	
モリタホールディングス	13,000	1,541.00	20,033,000	
グローリー	18,000	2,784.00	50,112,000	
新晃工業	7,600	2,005.00	15,238,000	
大和冷機工業	11,500	1,401.00	16,111,500	貸付株式数 3,200株
セガサミーホールディングス	60,300	2,816.50	169,834,950	
日本ピストンリング	2,000	1,395.00	2,790,000	

リ　ケ　ン	3,000	2,766.00	8,298,000	
ＴＰＲ	8,600	1,474.00	12,676,400	
ツバキ・ナカシマ	18,500	860.00	15,910,000	貸付株式数　7,000株
ホシザキ	48,300	5,199.00	251,111,700	
大豊工業	6,500	833.00	5,414,500	
日本精工	137,900	854.50	117,835,550	
Ｎ　Ｔ　Ｎ	148,000	291.20	43,097,600	貸付株式数　42,500株
ジェイテクト	66,800	1,199.00	80,093,200	
不　二　越	5,500	3,940.00	21,670,000	
ミネベアミツミ	130,600	2,753.50	359,607,100	
日本トムソン	18,400	575.00	10,580,000	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	43,300	3,082.00	133,450,600	
ユーシン精機	5,900	709.00	4,183,100	
前澤給装工業	5,300	1,119.00	5,930,700	貸付株式数　1,000株
イーグル工業	8,300	1,532.00	12,715,600	
前澤工業	3,300	757.00	2,498,100	
日本ピラー工業	7,000	4,340.00	30,380,000	
キッツ	27,600	1,064.00	29,366,400	
日　立	365,000	8,553.00	3,121,845,000	
東　芝	144,500	4,527.00	654,151,500	
三菱電機	775,800	1,953.50	1,515,525,300	
富士電機	45,600	6,119.00	279,026,400	
東洋電機製造	1,900	966.00	1,835,400	
安川電機	88,900	6,399.00	568,871,100	
シンフォニア　テクノロジー	8,300	1,663.00	13,802,900	
明　電　舎	11,400	1,899.00	21,648,600	
オリジン	1,300	1,245.00	1,618,500	
山洋電気	3,200	7,490.00	23,968,000	
デンヨー	5,700	1,894.00	10,795,800	
ＰＨＣホールディングス	10,500	1,492.00	15,666,000	
ソシオネクスト	10,300	18,730.00	192,919,000	
ベイカレントコンサルティング	60,500	5,571.00	337,045,500	
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,600	1,270.00	2,032,000	
アイモバイル	3,400	1,322.00	4,494,800	貸付株式数　1,500株
キャリアインデックス	2,000	291.00	582,000	貸付株式数　200株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	1,900	1,010.00	1,919,000	貸付株式数　900株
船場	1,000	722.00	722,000	貸付株式数　200株

ジャパンエレベーターＳＨＤ	27,200	1,943.00	52,849,600	
フルテック	800	1,078.00	862,400	
グリーンズ	2,000	1,377.00	2,754,000	
ツナググループＨＬＤＧＳ	1,700	600.00	1,020,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	1,800	398.00	716,400	貸付株式数　800株
ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	700	606.00	424,200	貸付株式数　300株
ウェルビー	5,600	516.00	2,889,600	貸付株式数　2,200株
エル・ティー・エス	1,000	3,410.00	3,410,000	貸付株式数　300株
ミダックホールディングス	4,600	1,796.00	8,261,600	貸付株式数　1,800株
日総工産	5,700	882.00	5,027,400	貸付株式数　900株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,600	1,536.00	5,529,600	
ＲＰＡホールディングス	10,300	389.00	4,006,700	
三桜工業	11,300	734.00	8,294,200	
マキタ	93,400	3,922.00	366,314,800	
東芝テック	11,200	4,325.00	48,440,000	
芝浦メカトロニクス	1,400	17,850.00	24,990,000	貸付株式数　200株
マブチモーター	18,600	3,907.00	72,670,200	
ニデック	182,600	7,400.00	1,351,240,000	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,500	553.00	3,041,500	
トレックス・セミコンダクター	3,500	2,225.00	7,787,500	貸付株式数　1,400株
東光高岳	4,500	2,051.00	9,229,500	
ダブル・スコープ	24,600	1,113.00	27,379,800	貸付株式数　9,800株
宮越ホールディングス	3,300	771.00	2,544,300	貸付株式数　1,100株
ダイヘン	6,800	5,350.00	36,380,000	
ヤーマン	13,000	1,163.00	15,119,000	貸付株式数　5,000株
ＪＶＣケンウッド	68,400	502.00	34,336,800	
ミマキエンジニアリング	7,100	758.00	5,381,800	
Ｉ－ＰＥＸ	4,200	1,381.00	5,800,200	貸付株式数　1,300株
大崎電気	17,800	548.00	9,754,400	
オムロン	68,800	8,975.00	617,480,000	
日東工業	10,100	3,480.00	35,148,000	
ＩＤＥＣ	11,100	3,265.00	36,241,500	
正興電機製作所	2,200	977.00	2,149,400	貸付株式数　300株
不二電機工業	1,200	1,130.00	1,356,000	貸付株式数　600株 (100株)

ジーエス・ユアサ　コーポ	24,600	2,578.50	63,431,100	
サクサホールディングス	1,200	1,850.00	2,220,000	
メルコホールディングス	1,900	3,175.00	6,032,500	
テクノメディカ	1,800	1,902.00	3,423,600	貸付株式数　500株
ダイヤモンドエレクトリクHD	2,500	829.00	2,072,500	貸付株式数　1,000株
日本電気	106,200	6,849.00	727,363,800	
富　士　通	74,800	19,285.00	1,442,518,000	
沖　電　気	33,900	818.00	27,730,200	
岩崎通信機	2,500	826.00	2,065,000	
電気興業	3,000	2,260.00	6,780,000	
サンケン電気	7,000	11,240.00	78,680,000	
ナカヨ	900	1,093.00	983,700	貸付株式数　400株
アイホン	4,600	2,252.00	10,359,200	
ルネサスエレクトロニクス	489,800	2,485.00	1,217,153,000	
セイコーエプソン	96,300	2,216.50	213,448,950	貸付株式数　38,500株
ワコム	57,100	724.00	41,340,400	貸付株式数　22,600株
アルバック	17,800	5,789.00	103,044,200	
アクセル	2,200	1,614.00	3,550,800	
ＥＩＺＯ	5,500	4,790.00	26,345,000	
ジャパンディスプレイ	61,700	39.00	2,406,300	
日本信号	17,100	1,060.00	18,126,000	
京三製作所	15,700	434.00	6,813,800	
能美防災	10,100	1,810.00	18,281,000	
ホーチキ	5,600	1,739.00	9,738,400	
星和電機	2,300	483.00	1,110,900	貸付株式数　1,000株
エレコム	17,900	1,554.00	27,816,600	
パナソニック　ホールディンク	886,700	1,604.00	1,422,266,800	
シャープ	90,400	802.00	72,500,800	貸付株式数　36,100株
アンリツ	52,900	1,215.00	64,273,500	
富士通ゼネラル	21,300	3,280.00	69,864,000	
ソニーグループ	525,800	13,860.00	7,287,588,000	※
Ｔ　Ｄ　Ｋ	118,900	5,529.00	657,398,100	
帝国通信工業	3,400	1,550.00	5,270,000	
タムラ製作所	32,200	707.00	22,765,400	貸付株式数　1,500株
アルプスアルパイン	67,000	1,242.00	83,214,000	
池上通信機	1,800	613.00	1,103,400	貸付株式数　700株
日本電波工業	9,000	1,356.00	12,204,000	貸付株式数　3,600株
鈴木	4,000	927.00	3,708,000	

メイコー	8,200	2,545.00	20,869,000	
日本トリム	1,700	2,856.00	4,855,200	
ローランド　ディー.ジー.	4,100	3,305.00	13,550,500	
フオスター電機	6,900	993.00	6,851,700	
ＳＭＫ	1,800	2,333.00	4,199,400	
ヨコオ	6,000	1,776.00	10,656,000	
ティアック	8,900	117.00	1,041,300	貸付株式数　1,800株
ホシデン	17,500	1,755.00	30,712,500	
ヒロセ電機	12,400	19,560.00	242,544,000	
日本航空電子	15,400	2,674.00	41,179,600	貸付株式数　6,100株
ＴＯＡ	8,500	857.00	7,284,500	
マクセル	15,200	1,492.00	22,678,400	
古野電気	9,800	1,024.00	10,035,200	
スミダコーポレーション	6,900	1,348.00	9,301,200	貸付株式数　2,700株
アイコム	2,900	2,940.00	8,526,000	貸付株式数　1,000株
リオン	3,100	1,864.00	5,778,400	
横河電機	82,100	2,772.00	227,581,200	
新電元工業	2,900	3,310.00	9,599,000	
アズビル	51,900	4,653.00	241,490,700	
東亜ディーケーケー	2,700	821.00	2,216,700	貸付株式数　1,500株
日本光電工業	34,300	3,775.00	129,482,500	
チノー	3,100	2,324.00	7,204,400	貸付株式数　1,100株
共和電業	5,400	347.00	1,873,800	
日本電子材料	4,900	1,627.00	7,972,300	
堀場製作所	16,600	7,850.00	130,310,000	
アドバンテスト	58,600	18,330.00	1,074,138,000	
小野測器	2,100	438.00	919,800	
エスペック	5,900	2,219.00	13,092,100	
キーエンス	74,400	71,890.00	5,348,616,000	※
日置電機	3,900	9,110.00	35,529,000	
シスメックス	64,100	9,930.00	636,513,000	
日本マイクロニクス	12,200	1,777.00	21,679,400	
メガチップス	6,100	3,550.00	21,655,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,100	4,050.00	16,605,000	貸付株式数　1,600株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	6,200	570.00	3,534,000	貸付株式数　2,400株
澤藤電機	700	1,203.00	842,100	貸付株式数　300株
デンソー	153,300	9,114.00	1,397,176,200	
原田工業	2,500	801.00	2,002,500	貸付株式数　700株

コーセル	8,900	1,140.00	10,146,000		
イリソ電子工業	6,800	4,305.00	29,274,000	貸付株式数	2,700株
オプテックスグループ	13,600	2,014.00	27,390,400		
千代田インテグレ	2,600	2,376.00	6,177,600		
レーザーテック	34,100	21,480.00	732,468,000		
スタンレー電気	52,900	2,963.00	156,742,700		
ウシオ電機	37,800	1,941.00	73,369,800		
岡谷電機	4,500	274.00	1,233,000	貸付株式数	1,900株
ヘリオステクノＨ	5,300	652.00	3,455,600	貸付株式数	2,300株
エノモト	1,500	1,678.00	2,517,000	貸付株式数	600株
日本セラミック	7,600	2,558.00	19,440,800		
遠藤照明	2,600	1,185.00	3,081,000		
古河電池	5,500	1,070.00	5,885,000	貸付株式数	2,000株
双信電機	2,300	362.00	832,600	貸付株式数	900株
山一電機	6,500	2,168.00	14,092,000		
図　研	6,500	3,710.00	24,115,000		
日本電子	18,600	4,942.00	91,921,200	貸付株式数	7,400株
カ　シ　オ	55,400	1,201.50	66,563,100	貸付株式数	22,100株
ファナック	364,800	5,027.00	1,833,849,600		
日本シイエムケイ	15,800	497.00	7,852,600		
エンプラス	2,200	5,600.00	12,320,000		
大真空	9,100	651.00	5,924,100	貸付株式数	3,600株
ロ　ー　ム	34,400	12,180.00	418,992,000		
浜松ホトニクス	59,600	7,223.00	430,490,800		
三井ハイテック	7,700	9,410.00	72,457,000	貸付株式数	3,000株
新光電気工業	26,300	5,622.00	147,858,600		
京　セ　ラ	115,500	8,000.00	924,000,000		
協栄産業	600	2,018.00	1,210,800	貸付株式数	200株
太陽誘電	36,200	4,518.00	163,551,600		
村田製作所	225,400	8,532.00	1,923,112,800		
双葉電子工業	14,200	503.00	7,142,600		
日東電工	54,100	10,365.00	560,746,500		
北陸電気工業	2,200	1,193.00	2,624,600		
東海理化電機	21,000	1,972.00	41,412,000		
ニチコン	15,200	1,339.00	20,352,800		
日本ケミコン	7,300	1,389.00	10,139,700		
Ｋ　Ｏ　Ａ	11,300	1,726.00	19,503,800	貸付株式数	3,800株
三井Ｅ＆Ｓ	21,700	488.00	10,589,600		
日立造船	61,500	842.00	51,783,000	貸付株式数	3,500株
三菱重工業	131,300	6,249.00	820,493,700		

川崎重工業	56,000	3,235.00	181,160,000		
ＩＨＩ	47,300	3,445.00	162,948,500		
名村造船所	14,800	518.00	7,666,400	貸付株式数	7,200株
サノヤスホールディングス	7,700	131.00	1,008,700	貸付株式数	3,600株
スプリックス	1,700	807.00	1,371,900	貸付株式数	100株 (100株)
マネジメントソリューションズ	4,200	2,996.00	12,583,200	貸付株式数	1,400株
プロレド・パートナーズ	1,900	518.00	984,200	貸付株式数	700株
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	1,700	391.00	664,700	貸付株式数	600株
テノ．ホールディングス	700	699.00	489,300	貸付株式数	300株
フロンティア・マネジメント	2,600	1,153.00	2,997,800		
ピアラ	1,000	513.00	513,000	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	1,000	1,948.00	1,948,000	貸付株式数	100株
ギークス	800	774.00	619,200	貸付株式数	500株
アンビスホールディングス	8,200	3,110.00	25,502,000		
カーブスホールディングス	20,900	716.00	14,964,400	貸付株式数	9,200株
フォーラムエンジニアリング	4,500	1,163.00	5,233,500		
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰ	2,600	1,226.00	3,187,600		
日本車輌	2,900	2,019.00	5,855,100	貸付株式数	300株
三菱ロジスネクスト	11,900	1,198.00	14,256,200		
近畿車輌	800	1,440.00	1,152,000	貸付株式数	300株
一家ホールディングス	1,400	609.00	852,600	貸付株式数	600株
フルサト・マルカＨＤ	7,800	2,390.00	18,642,000	貸付株式数	1,500株
ヤマエグループＨＤ	4,400	2,601.00	11,444,400		
ジャパンクラフトホールディ	1,800	557.00	1,002,600	貸付株式数	900株
ＦＰＧ	24,800	1,133.00	28,098,400	貸付株式数	2,700株
島根銀行	2,000	471.00	942,000	貸付株式数	800株
じもとホールディングス	5,000	378.00	1,890,000	貸付株式数	1,600株
全国保証	19,100	5,106.00	97,524,600	貸付株式数	3,800株
めぶきフィナンシャルＧ	363,200	343.50	124,759,200		
ジャパンインベストメントＡ	6,000	1,085.00	6,510,000	貸付株式数	2,400株
東京きらぼしＦＧ	9,400	3,185.00	29,939,000		
九州フィナンシャルＧ	128,800	529.10	68,148,080		
かんぽ生命保険	88,900	2,127.50	189,134,750		

ゆうちょ銀行	205,100	1,063.50	218,123,850	貸付株式数	1,700株
あんしん保証	2,800	314.00	879,200	貸付株式数	1,100株
富山第一銀行	24,300	696.00	16,912,800	貸付株式数	8,800株
コンコルディア・フィナンシャル	392,800	555.90	218,357,520		
ジェイリース	1,900	2,006.00	3,811,400		
西日本フィナンシャルＨＤ	45,400	1,154.00	52,391,600		
イントラスト	2,200	897.00	1,973,400		
日本モーゲージサービス	3,100	541.00	1,677,100	貸付株式数	1,200株
Ｃａｓａ	2,200	880.00	1,936,000	貸付株式数	700株
アルヒ	9,000	973.00	8,757,000	貸付株式数	3,600株
プレミアグループ	12,300	1,606.00	19,753,800		
日産自動車	1,055,800	546.20	576,677,960		
いすゞ自動車	216,100	1,702.50	367,910,250		
トヨタ自動車	4,081,100	2,028.50	8,278,511,350		
日野自動車	95,800	627.80	60,143,240		
三菱自動車工業	289,900	481.90	139,702,810	貸付株式数	110,600株
エフテック	4,000	811.00	3,244,000		
レシップホールディングス	2,300	490.00	1,127,000	貸付株式数	1,100株
ＧＭＢ	1,100	2,559.00	2,814,900	貸付株式数	400株
ファルテック	900	609.00	548,100	貸付株式数	200株
武蔵精密工業	18,200	1,772.00	32,250,400	貸付株式数	2,400株
日産車体	13,100	857.00	11,226,700	貸付株式数	5,100株
新明和工業	23,300	1,264.00	29,451,200		
極東開発工業	12,300	1,643.00	20,208,900		
トピー工業	6,000	2,024.00	12,144,000		
ティラド	1,900	1,789.00	3,399,100		
タチエス	11,800	1,475.00	17,405,000		
Ｎ　Ｏ　Ｋ	28,900	1,929.00	55,748,100	貸付株式数	11,500株
フタバ産業	19,900	469.00	9,333,100		
ＫＹＢ	7,200	4,525.00	32,580,000		
市光工業	10,700	518.00	5,542,600		
大同メタル工業	14,500	488.00	7,076,000		
プレス工業	33,200	578.00	19,189,600		
ミクニ	6,600	397.00	2,620,200		
太平洋工業	17,000	1,219.00	20,723,000		
河西工業	7,700	157.00	1,208,900	貸付株式数	3,400株
アイシン	57,300	4,165.00	238,654,500		
マ　ツ　ダ	245,800	1,278.00	314,132,400		

今仙電機製作所	3,700	640.00	2,368,000	
本田技研	604,200	4,185.00	2,528,577,000	※
スズキ	136,500	4,827.00	658,885,500	
ＳＵＢＡＲＵ	235,200	2,530.50	595,173,600	
安永	2,500	921.00	2,302,500	貸付株式数　1,200株
ヤマハ発動機	116,800	3,701.00	432,276,800	
小糸製作所	89,400	2,742.00	245,134,800	貸付株式数　11,100株
ＴＢＫ	5,700	339.00	1,932,300	
エクセディ	12,200	2,181.00	26,608,200	
ミツバ	13,900	714.00	9,924,600	
豊田合成	21,700	2,347.00	50,929,900	
愛三工業	12,300	1,007.00	12,386,100	
盟和産業	800	959.00	767,200	貸付株式数　300株
日本プラスト	4,500	431.00	1,939,500	貸付株式数　500株
ヨ　ロ　ズ	7,000	819.00	5,733,000	貸付株式数　2,700株
エフ・シー・シー	13,200	1,747.00	23,060,400	
新家工業	1,300	2,208.00	2,870,400	
シマノ	30,400	23,210.00	705,584,000	
テイ・エス　テック	34,000	1,830.00	62,220,000	
３３ＦＧ	6,500	1,542.00	10,023,000	
第四北越フィナンシャルＧ	11,500	3,045.00	35,017,500	
ひろぎんＨＬＤＧＳ	95,500	770.20	73,554,100	
マーキュリアホールディングス	3,300	716.00	2,362,800	貸付株式数　1,300株
おきなわＦＧ	7,000	2,164.00	15,148,000	
ダイレクトマケティングミクス	9,200	974.00	8,960,800	
ポピンズ	1,100	1,595.00	1,754,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,900	2,516.00	14,844,400	
十六ＦＧ	9,500	3,185.00	30,257,500	
北國ＦＨＤ	8,200	4,630.00	37,966,000	貸付株式数　2,600株
ネットプロＨＤ	24,200	358.00	8,663,600	貸付株式数　9,600株
プロクレアホールディングス	9,000	2,160.00	19,440,000	
あいちフィナンシャルグル	10,200	2,212.00	22,562,400	
ジャムコ	3,100	1,460.00	4,526,000	貸付株式数　1,800株
小　野　建	7,700	1,521.00	11,711,700	
はるやまＨＬＤＧＳ	2,600	478.00	1,242,800	貸付株式数　1,100株
南　陽	1,200	2,131.00	2,557,200	貸付株式数　500株
ノ　ジ　マ	25,700	1,386.00	35,620,200	

佐鳥電機	3,800	1,648.00	6,262,400	貸付株式数	1,100株
カッパ・クリエイト	12,400	1,508.00	18,699,200	貸付株式数	4,900株
エコートレーディング	1,200	784.00	940,800		
伯東	4,500	4,960.00	22,320,000	貸付株式数	1,300株
コンドーテック	6,000	1,094.00	6,564,000	貸付株式数	2,200株
中山福	3,200	335.00	1,072,000		
ライトオン	4,600	566.00	2,603,600	貸付株式数	1,900株
ナガイレーベン	9,900	2,128.00	21,067,200	貸付株式数	200株
三菱食品	7,300	3,610.00	26,353,000		
良品計画	85,800	1,394.00	119,605,200		
パリミキホールディングス	7,600	322.00	2,447,200	貸付株式数	300株
松田産業	6,000	2,128.00	12,768,000		
第一興商	30,400	2,506.50	76,197,600		
メディパルＨＤ	75,200	2,263.50	170,215,200		
アドヴァングループ	7,500	963.00	7,222,500		
ＳＰＫ	3,500	1,717.00	6,009,500		
萩原電気ＨＬＤＧＳ	3,000	3,045.00	9,135,000		
アルビス	2,600	2,374.00	6,172,400		
アズワン	11,200	5,570.00	62,384,000		
スズデン	2,700	2,220.00	5,994,000		
尾家産業	1,400	1,193.00	1,670,200	貸付株式数	500株
シモジマ	5,400	1,099.00	5,934,600	貸付株式数	1,700株
ドウシシャ	8,300	2,166.00	17,977,800		
小津産業	1,400	1,625.00	2,275,000	貸付株式数	600株
コナカ	6,700	358.00	2,398,600		
高速	4,100	2,005.00	8,220,500		
ハウス　ローゼ	800	1,602.00	1,281,600		
Ｇ－７ホールディングス	9,800	1,299.00	12,730,200		
たけびし	3,000	1,646.00	4,938,000		
イオン北海道	11,600	844.00	9,790,400	貸付株式数	4,600株
コ　ジ　マ	13,000	552.00	7,176,000	貸付株式数	5,900株
ヒマラヤ	1,900	938.00	1,782,200	貸付株式数	900株
コーナン商事	10,600	3,535.00	37,471,000		
ネットワンシステムズ	27,800	3,361.00	93,435,800		
エコス	2,900	1,871.00	5,425,900	貸付株式数	1,000株
ワタミ	9,500	917.00	8,711,500	貸付株式数	2,500株
マルシェ	2,000	258.00	516,000	貸付株式数	800株
リックス	1,300	2,774.00	3,606,200		
システムソフト	25,700	76.00	1,953,200	貸付株式数	4,700株

パンパシフィックＨＤ	158,800	2,535.00	402,558,000		
丸文	7,000	1,231.00	8,617,000		
西松屋チェーン	17,400	1,657.00	28,831,800	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	43,000	6,000.00	258,000,000		
ハピネット	6,700	2,007.00	13,446,900		
幸楽苑ホールディングス	5,100	1,034.00	5,273,400	貸付株式数	900株
ハークスレイ	2,100	653.00	1,371,300		
橋本総業ＨＬＤＧＳ	3,100	1,113.00	3,450,300	貸付株式数	1,100株
日本ライフライン	23,000	1,048.00	24,104,000		
サイゼリヤ	11,600	3,560.00	41,296,000	貸付株式数	3,700株
タカショー	6,800	684.00	4,651,200	貸付株式数	2,600株
ＶＴホールディングス	29,900	508.00	15,189,200		
アルゴグラフィックス	6,800	4,180.00	28,424,000	貸付株式数	100株
魚力	2,400	2,167.00	5,200,800	貸付株式数	800株
ＩＤＯＭ	23,800	840.00	19,992,000		
日本エム・ディ・エム	4,400	949.00	4,175,600		
ポプラ	1,700	206.00	350,200	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	4,400	1,394.00	6,133,600		
ユナイテッドアローズ	8,400	2,351.00	19,748,400	貸付株式数	1,000株
進和	4,800	2,117.00	10,161,600	貸付株式数	1,500株
エスケイジャパン	1,500	540.00	810,000		
ダイトロン	3,100	2,920.00	9,052,000		
ハイデイ日高	11,700	2,332.00	27,284,400	貸付株式数	3,000株
シークス	11,200	1,511.00	16,923,200	貸付株式数	4,100株
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　Ｈ	3,600	196.00	705,600	貸付株式数	500株
コロワイド	36,200	2,028.00	73,413,600	貸付株式数	14,500株
ピーシーデポコーポ	8,700	479.00	4,167,300		
田中商事	1,700	606.00	1,030,200	貸付株式数	300株
オーハシテクニカ	3,800	1,549.00	5,886,200		
壱番屋	6,200	5,390.00	33,418,000	貸付株式数	2,400株
白銅	2,800	2,343.00	6,560,400	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	2,000	187.00	374,000	貸付株式数	800株
ＰＬＡＮＴ	1,400	699.00	978,600	貸付株式数	400株
スギホールディングス	15,800	5,951.00	94,025,800		
ダイコー通産	600	1,117.00	670,200	貸付株式数	200株
薬王堂ホールディングス	4,400	2,566.00	11,290,400		
島津製作所	90,500	4,505.00	407,702,500		

ＪＭＳ	6,900	537.00	3,705,300		
クボテック	1,300	212.00	275,600	貸付株式数	700株
長野計器	5,400	1,895.00	10,233,000		
ブイ・テクノロジー	3,600	2,604.00	9,374,400		
スター精密	14,200	1,862.00	26,440,400		
東京計器	5,700	1,253.00	7,142,100	貸付株式数	2,200株
愛知時計	2,900	1,591.00	4,613,900		
インターアクション	3,500	1,430.00	5,005,000	貸付株式数	1,200株
オーバル	5,100	387.00	1,973,700	貸付株式数	2,200株
東京精密	16,300	6,290.00	102,527,000		
マニー	29,700	1,717.50	51,009,750	貸付株式数	10,300株
ニコン	107,500	1,595.50	171,516,250		
トプコン	39,100	1,971.00	77,066,100		
オリンパス	457,500	2,212.50	1,012,218,750		
理研計器	4,600	5,010.00	23,046,000	貸付株式数	2,100株
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,700	15,050.00	191,135,000		
キヤノン電子	8,200	1,911.00	15,670,200		
タムロン	5,600	3,600.00	20,160,000		
ＨＯＹＡ	158,700	18,320.00	2,907,384,000		
シ　ー　ド	2,900	560.00	1,624,000	貸付株式数	1,500株
ノーリツ鋼機	7,000	2,194.00	15,358,000		
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	10,800	1,694.00	18,295,200		
朝日インテック	83,000	2,872.00	238,376,000	貸付株式数	31,600株
キヤノン	407,800	3,567.00	1,454,622,600		
リ　コ　ー	186,400	1,203.00	224,239,200		
シチズン時計	81,700	893.00	72,958,100	貸付株式数	32,600株
リズム	1,800	1,639.00	2,950,200	貸付株式数	800株
大研医器	4,300	518.00	2,227,400	貸付株式数	600株
メニコン	25,500	2,682.00	68,391,000		
シンシア	500	570.00	285,000	貸付株式数	200株
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	8,500	145.00	1,232,500		
中本パックス	1,700	1,597.00	2,714,900	貸付株式数	100株
スノーピーク	12,700	1,882.00	23,901,400	貸付株式数	5,000株 (100株)
パラマウントベッドＨＤ	17,200	2,380.00	40,936,000		
トランザクション	4,900	1,696.00	8,310,400	貸付株式数	1,000株
粧美堂	1,600	378.00	604,800	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	7,000	977.00	6,839,000		

前田工繊	6,300	3,030.00	19,089,000	貸付株式数	2,400株
永大産業	6,100	209.00	1,274,900	貸付株式数	1,200株
アートネイチャー	7,600	751.00	5,707,600		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	203,600	3,420.00	696,312,000		
アイフィスジャパン	1,600	613.00	980,800	貸付株式数	400株
ＳＨＯＥＩ	16,800	2,649.00	44,503,200		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,200	1,043.00	9,595,600	貸付株式数	3,400株
マーベラス	12,100	668.00	8,082,800		
パイロットコーポレーション	11,600	4,566.00	52,965,600		
萩原工業	5,000	1,263.00	6,315,000	貸付株式数	1,900株
エイベックス	12,700	1,511.00	19,189,700	貸付株式数	4,500株
フジシールインターナショナル	15,000	1,525.00	22,875,000		
タカラトミー	34,200	1,705.00	58,311,000		
広済堂ホールディングス	3,900	2,392.00	9,328,800	貸付株式数	1,700株
エステールホールディングス	1,300	613.00	796,900	貸付株式数	700株
レック	10,600	837.00	8,872,200	貸付株式数	1,200株
タカノ	2,100	741.00	1,556,100	貸付株式数	1,000株
三光合成	9,400	535.00	5,029,000		
プロネクサス	6,200	968.00	6,001,600		
ホクシン	4,400	133.00	585,200	貸付株式数	2,000株
ウッドワン	1,900	1,188.00	2,257,200	貸付株式数	700株
大建工業	4,500	2,244.00	10,098,000		
き　も　と	8,400	189.00	1,587,600		
凸版印刷	97,200	3,068.00	298,209,600		
大日本印刷	81,200	4,041.00	328,129,200		
共同印刷	2,100	2,862.00	6,010,200		
ＮＩＳＳＨＡ	14,100	1,610.00	22,701,000		
光村印刷	500	1,175.00	587,500	貸付株式数	200株
藤森工業	5,900	3,365.00	19,853,500		
ヴィア・ホールディングス	9,500	88.00	836,000	貸付株式数	3,500株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,800	2,236.00	10,732,800		
前澤化成工業	4,800	1,611.00	7,732,800	貸付株式数	1,900株
未来工業	2,700	2,440.00	6,588,000		
アシックス	68,600	3,903.00	267,745,800		
ツ　ツ　ミ	1,300	2,094.00	2,722,200	貸付株式数	600株
ウェーブロックＨＬＤＧＳ	1,700	567.00	963,900	貸付株式数	1,200株

ジェイ　エス　ピー	5,200	1,665.00	8,658,000	貸付株式数　1,400株
ニ　チ　ハ	9,300	2,952.00	27,453,600	
ローランド	5,500	4,155.00	22,852,500	
エフピコ	14,100	2,956.00	41,679,600	
小松ウオール工業	2,700	2,482.00	6,701,400	
ヤマハ	46,900	5,690.00	266,861,000	
河合楽器	2,000	3,140.00	6,280,000	
クリナップ	8,300	673.00	5,585,900	
ピジョン	47,300	2,071.00	97,958,300	貸付株式数　300株
天馬	6,300	2,601.00	16,386,300	
キングジム	6,600	911.00	6,012,600	貸付株式数　2,600株
象印マホービン	22,200	1,714.00	38,050,800	貸付株式数　6,700株
リンテック	14,900	2,253.00	33,569,700	
信越ポリマー	13,800	1,408.00	19,430,400	
東　リ	13,000	304.00	3,952,000	貸付株式数　5,000株
イトーキ	15,200	880.00	13,376,000	
任　天　堂	469,200	6,083.00	2,854,143,600	
三菱鉛筆	10,600	1,688.00	17,892,800	
松　風	3,400	2,216.00	7,534,400	貸付株式数　1,200株
タカラスタンダード	13,700	1,779.00	24,372,300	
コ　ク　ヨ	35,800	1,926.50	68,968,700	
ナカバヤシ	8,000	479.00	3,832,000	貸付株式数　600株
ニ　フ　コ	26,900	3,861.00	103,860,900	
立川ブラインド	3,500	1,258.00	4,403,000	
グローブライド	6,000	2,207.00	13,242,000	
オカムラ	22,400	1,791.00	40,118,400	
バルカー	6,200	3,665.00	22,723,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	800	1,717.00	1,373,600	
伊　藤　忠	484,600	5,056.00	2,450,137,600	
丸　紅	613,700	2,095.00	1,285,701,500	
スクロール	11,700	913.00	10,682,100	貸付株式数　1,600株
高　島	1,000	3,420.00	3,420,000	
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,777.00	12,083,600	貸付株式数　2,500株
三陽商会	2,200	1,607.00	3,535,400	貸付株式数　500株
長瀬産業	36,000	2,357.00	84,852,000	
ナイガイ	1,900	262.00	497,800	貸付株式数　900株
蝶　理	4,200	2,621.00	11,008,200	
豊田通商	68,900	6,557.00	451,777,300	

オンワードホールディングス	48,300	382.00	18,450,600	
三共生興	11,300	553.00	6,248,900	
兼　松	30,500	1,853.00	56,516,500	
美　津　濃	7,400	3,630.00	26,862,000	
ツカモトコーポレーション	900	1,292.00	1,162,800	貸付株式数　400株
ルックホールディングス	1,700	2,336.00	3,971,200	貸付株式数　800株
三井物産	558,100	4,711.00	2,629,209,100	
日本紙パルプ	4,200	4,935.00	20,727,000	
東京エレクトロン	157,300	19,420.00	3,054,766,000	
カメイ	8,400	1,424.00	11,961,600	
東都水産	300	6,610.00	1,983,000	
ＯＵＧホールディングス	900	2,416.00	2,174,400	貸付株式数　100株
スターゼン	6,000	2,337.00	14,022,000	
セイコーグループ	11,500	2,679.00	30,808,500	貸付株式数　700株
山　善	21,200	1,050.00	22,260,000	
椿本興業	1,300	3,925.00	5,102,500	貸付株式数　500株
住友商事	487,000	2,753.50	1,340,954,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	27,400	3,454.00	94,639,600	
内田洋行	3,200	5,320.00	17,024,000	
三菱商事	486,400	5,987.00	2,912,076,800	
第一実業	2,800	5,950.00	16,660,000	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	18,200	3,557.00	64,737,400	
西華産業	3,100	1,974.00	6,119,400	
佐藤商事	5,500	1,391.00	7,650,500	
菱洋エレクトロ	6,700	3,225.00	21,607,500	貸付株式数　1,500株
東京産業	7,200	835.00	6,012,000	
ユアサ商事	7,100	4,375.00	31,062,500	
神鋼商事	2,000	5,450.00	10,900,000	
トルク	3,200	217.00	694,400	
阪和興業	14,100	4,305.00	60,700,500	
正栄食品	5,200	3,990.00	20,748,000	貸付株式数　1,900株
カナデン	5,200	1,214.00	6,312,800	貸付株式数　2,200株
ＲＹＯＤＥＮ	6,300	1,957.00	12,329,100	貸付株式数　2,400株
ニプロ	62,000	1,022.50	63,395,000	貸付株式数　24,800株
岩谷産業	17,900	7,051.00	126,212,900	
ナイス	2,500	1,403.00	3,507,500	
ニチモウ	800	3,550.00	2,840,000	
極東貿易	4,700	1,583.00	7,440,100	貸付株式数　400株

アステナホールディングス	13,600	447.00	6,079,200	貸付株式数	5,100株
三愛オブリ	20,800	1,464.00	30,451,200		
稲畑産業	15,900	3,010.00	47,859,000		
ＧＳＩクレオス	4,600	1,852.00	8,519,200	貸付株式数	1,800株
明和産業	10,500	674.00	7,077,000	貸付株式数	2,400株
クワザワホールディングス	1,900	437.00	830,300	貸付株式数	1,000株
ゴールドウイン	13,200	12,665.00	167,178,000		
ユニ・チャーム	155,300	5,532.00	859,119,600		
デサント	12,800	3,995.00	51,136,000		
キ　ン　グ	2,500	553.00	1,382,500	貸付株式数	200株
ワ　キ　タ	14,500	1,307.00	18,951,500		
ヤマトインターナシヨナル	4,600	271.00	1,246,600	貸付株式数	2,300株
東邦ホールディングス	19,600	2,715.50	53,223,800	貸付株式数	7,800株
サンゲツ	19,700	2,466.00	48,580,200		
ミツウロコグループ	10,000	1,338.00	13,380,000		
シナネンホールディングス	2,500	3,760.00	9,400,000		
伊藤忠エネクス	19,500	1,188.00	23,166,000		
サンリオ	22,300	5,972.00	133,175,600		
サンワ　テクノス	4,000	2,229.00	8,916,000		
リョーサン	8,300	4,005.00	33,241,500		
新光商事	10,600	1,134.00	12,020,400		
トーホー	3,400	2,364.00	8,037,600	貸付株式数	1,300株
三信電気	3,200	2,057.00	6,582,400		
東陽テクニカ	8,000	1,347.00	10,776,000		
モスフード　サービス	11,600	3,130.00	36,308,000	貸付株式数	1,300株
加賀電子	6,400	5,330.00	34,112,000		
三益半導体	5,900	3,015.00	17,788,500		
都築電気	3,900	1,777.00	6,930,300		
ソーダニツカ	4,500	778.00	3,501,000	貸付株式数	100株
立花エレテック	5,700	2,233.00	12,728,100	貸付株式数	2,000株
木曽路	11,900	2,376.00	28,274,400	貸付株式数	4,700株
ＳＲＳホールディングス	13,000	954.00	12,402,000	貸付株式数	5,200株
千　趣　会	14,500	414.00	6,003,000	貸付株式数	5,800株
タカキユー	4,200	76.00	319,200	貸付株式数	2,100株
リテールパートナーズ	11,700	1,599.00	18,708,300	貸付株式数	4,600株
ケーヨー	12,700	813.00	10,325,100		
上新電機	7,000	1,939.00	13,573,000		
日本瓦斯	42,100	1,949.50	82,073,950	貸付株式数	900株
ロイヤルホールディングス	15,200	2,742.00	41,678,400	貸付株式数	6,000株

東　天　紅	500	777.00	388,500	貸付株式数	100株
いなげや	7,600	1,533.00	11,650,800	貸付株式数	2,900株
チヨダ	7,500	853.00	6,397,500	貸付株式数	1,300株
ライフコーポレーション	6,900	2,916.00	20,120,400		
リンガーハット	10,100	2,434.00	24,583,400	貸付株式数	4,000株 (200株)
ＭｒＭａｘＨＤ	11,000	613.00	6,743,000		
テンアライド	6,900	253.00	1,745,700	貸付株式数	3,100株
ＡＯＫＩホールディングス	14,600	856.00	12,497,600		
オークワ	12,600	854.00	10,760,400	貸付株式数	500株
コメリ	12,100	2,925.00	35,392,500		
青山商事	16,800	1,301.00	21,856,800	貸付株式数	100株
しまむら	9,200	12,630.00	116,196,000		
はせがわ	2,900	339.00	983,100		
高　島　屋	59,300	1,888.50	111,988,050	貸付株式数	23,700株
松　屋	13,300	1,183.00	15,733,900	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	38,300	1,488.00	56,990,400	貸付株式数	3,200株
近鉄百貨店	3,400	2,512.00	8,540,800	貸付株式数	900株
丸井グループ	58,000	2,474.50	143,521,000		
クレディセゾン	46,400	2,015.50	93,519,200		
アクシアル　リテイリング	5,400	3,410.00	18,414,000	貸付株式数	1,700株
井　筒　屋	2,900	308.00	893,200	貸付株式数	1,300株
イオン	266,600	2,818.50	751,412,100		
イ　ズ　ミ	12,000	3,257.00	39,084,000	貸付株式数	1,300株
フオーバル	3,100	1,075.00	3,332,500	貸付株式数	800株
平　和　堂	13,100	2,125.00	27,837,500	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	12,100	1,790.00	21,659,000	貸付株式数	3,300株
ヤオコー	8,900	7,103.00	63,216,700	貸付株式数	1,200株
ゼビオホールディングス	10,700	1,146.00	12,262,200		
ケーズホールディングス	55,600	1,238.50	68,860,600		
ＰＡＬＴＡＣ	12,400	5,100.00	63,240,000		
三谷産業	13,700	313.00	4,288,100		
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	2,300	542.00	1,246,600	貸付株式数	900株
日産東京販売ＨＤ	7,800	327.00	2,550,600		
ＳＢＩ新生銀行	17,100	2,815.50	48,145,050		
あおぞら銀行	46,000	2,596.00	119,416,000	貸付株式数	18,400株
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	4,584,300	975.20	4,470,609,360	※	

りそなホールディングス	925,200	660.70	611,279,640	
三井住友トラストＨＤ	133,000	5,084.00	676,172,000	
三井住友フィナンシャルＧ	534,900	5,778.00	3,090,652,200	※
千葉銀行	204,000	893.30	182,233,200	
群馬銀行	142,000	522.00	74,124,000	
武蔵野銀行	9,400	2,204.00	20,717,600	
千葉興業銀行	13,300	557.00	7,408,100	
筑波銀行	32,100	202.00	6,484,200	
七十七銀行	23,400	2,452.00	57,376,800	
秋田銀行	4,900	1,689.00	8,276,100	
山形銀行	8,100	1,103.00	8,934,300	
岩手銀行	5,000	2,087.00	10,435,000	
東邦銀行	57,900	230.00	13,317,000	
東北銀行	2,800	995.00	2,786,000	
ふくおかフィナンシャルＧ	58,400	2,662.50	155,490,000	
スルガ銀行	63,000	523.00	32,949,000	
八十二銀行	159,172	605.10	96,314,977	貸付株式数　24,300株
山梨中央銀行	7,500	1,158.00	8,685,000	
大垣共立銀行	14,000	1,843.00	25,802,000	
福井銀行	6,500	1,447.00	9,405,500	
清水銀行	2,900	1,436.00	4,164,400	
富山銀行	900	1,679.00	1,511,100	貸付株式数　400株
滋賀銀行	12,200	2,777.00	33,879,400	
南都銀行	11,000	2,436.00	26,796,000	
百五銀行	68,900	414.00	28,524,600	
京都銀行	23,200	6,715.00	155,788,000	
紀陽銀行	26,200	1,553.00	40,688,600	貸付株式数　6,000株
ほくほくフィナンシャルＧ	46,500	1,118.00	51,987,000	
山陰合同銀行	45,800	784.00	35,907,200	
鳥取銀行	1,800	1,153.00	2,075,400	
百十四銀行	6,700	1,774.00	11,885,800	
四国銀行	11,600	854.00	9,906,400	
阿波銀行	10,300	2,041.00	21,022,300	
大分銀行	4,400	2,102.00	9,248,800	
宮崎銀行	4,800	2,286.00	10,972,800	
佐賀銀行	4,300	1,636.00	7,034,800	
琉球銀行	16,800	933.00	15,674,400	
セブン銀行	262,200	282.00	73,940,400	
みずほフィナンシャルＧ	1,058,600	2,129.50	2,254,288,700	
高知銀行	1,900	666.00	1,265,400	貸付株式数　200株

山口フィナンシャルG	80,800	930.00	75,144,000	
芙蓉総合リース	6,700	10,370.00	69,479,000	
みずほリース	10,900	4,300.00	46,870,000	
東京センチュリー	13,700	5,214.00	71,431,800	
ＳＢＩホールディングス	106,000	2,673.50	283,391,000	
日本証券金融	26,900	1,179.00	31,715,100	
アイフル	121,200	336.00	40,723,200	
日本アジア投資	4,500	235.00	1,057,500	
名古屋銀行	4,800	3,380.00	16,224,000	
北洋銀行	110,900	277.00	30,719,300	
大光銀行	1,700	1,054.00	1,791,800	貸付株式数　600株
愛媛銀行	9,900	806.00	7,979,400	
トマト銀行	1,900	1,015.00	1,928,500	貸付株式数　500株
京葉銀行	33,500	528.00	17,688,000	
栃木銀行	33,600	255.00	8,568,000	
北日本銀行	2,600	1,995.00	5,187,000	貸付株式数　300株
東和銀行	13,400	526.00	7,048,400	
福島銀行	5,900	211.00	1,244,900	
大東銀行	2,200	628.00	1,381,600	貸付株式数　500株
リコーリース	6,900	3,955.00	27,289,500	
イオンフィナンシャルサービス	42,000	1,241.00	52,122,000	
ア　コ　ム	130,600	330.80	43,202,480	
ジャックス	7,800	4,615.00	35,997,000	
オ　リ　コ	19,100	1,073.00	20,494,300	
オリックス	480,500	2,474.00	1,188,757,000	
三菱ＨＣキャピタル	285,400	771.90	220,300,260	
ジャフコ　グループ	24,400	1,748.00	42,651,200	
九州　リースサービス	2,700	806.00	2,176,200	貸付株式数　1,200株
トモニホールディングス	59,200	375.00	22,200,000	
大和証券G本社	523,400	662.00	346,490,800	
野村ホールディングス	1,348,100	511.60	689,687,960	
岡三証券グループ	64,300	457.00	29,385,100	貸付株式数　24,900株
丸三証券	24,400	413.00	10,077,200	貸付株式数　1,600株
東洋証券	24,300	281.00	6,828,300	
東海東京ＨＤ	79,700	358.00	28,532,600	
光世証券	1,300	423.00	549,900	貸付株式数　200株
水戸証券	19,600	294.00	5,762,400	
いちよし証券	13,500	581.00	7,843,500	

松井証券	43,200	792.00	34,214,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	125,600	6,023.00	756,488,800	
日本取引所グループ	205,700	2,362.50	485,966,250	
マネックスＧ	78,900	510.00	40,239,000	
極東証券	9,100	604.00	5,496,400	貸付株式数　300株
岩井コスモホールディング	8,300	1,359.00	11,279,700	
アイザワ証券グループ	10,600	754.00	7,992,400	貸付株式数　200株
フィデアホール	7,600	1,321.00	10,039,600	
池田泉州ＨＤ	93,700	232.00	21,738,400	
アニコム　ホールディングス	24,900	616.00	15,338,400	
ＭＳ＆ＡＤ	149,000	4,921.00	733,229,000	
マネーパートナーズＧＰ	5,900	256.00	1,510,400	
スパークス・グループ	8,200	1,416.00	11,611,200	
小林洋行	2,400	235.00	564,000	貸付株式数　100株
第一生命ＨＬＤＧＳ	357,600	2,537.00	907,231,200	
東京海上ＨＤ	723,500	3,213.00	2,324,605,500	
アドバンテッジリスクマネ	2,700	584.00	1,576,800	貸付株式数　200株
イー・ギャランティ	11,900	1,999.00	23,788,100	
アサックス	2,600	623.00	1,619,800	貸付株式数　1,300株
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,600	2,949.00	10,616,400	貸付株式数　1,300株
Ｔ＆Ｄホールディングス	196,400	1,991.50	391,130,600	
アドバンスクリエイト	4,200	1,125.00	4,725,000	貸付株式数　1,300株
三井不動産	316,300	2,817.50	891,175,250	
三菱地所	441,700	1,681.00	742,497,700	
平和不動産	11,900	3,755.00	44,684,500	
東京建物	69,800	1,828.00	127,594,400	
京阪神ビルディング	12,300	1,238.00	15,227,400	
住友不動産	132,300	3,639.00	481,439,700	
太平洋興発	2,100	728.00	1,528,800	貸付株式数　800株
テーオーシー	13,200	634.00	8,368,800	
東京楽天地	1,200	4,225.00	5,070,000	貸付株式数　400株
スターツコーポレーション	10,500	2,778.00	29,169,000	
フジ住宅	10,200	687.00	7,007,400	
空港施設	8,800	546.00	4,804,800	
明和地所	2,700	903.00	2,438,100	
ゴールドクレスト	7,000	1,760.00	12,320,000	
リログループ	42,500	2,071.00	88,017,500	

エスリード	3,400	2,563.00	8,714,200	貸付株式数	1,200株
日神グループＨＬＤＧＳ	11,700	461.00	5,393,700	貸付株式数	4,400株
日本エスコン	16,400	807.00	13,234,800	貸付株式数	4,900株
ＭＩＲＡＲＴＨホールディング	37,000	430.00	15,910,000		
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,200	831.00	2,659,200	貸付株式数	1,100株
イオンモール	37,900	1,801.50	68,276,850		
毎日コムネット	2,100	753.00	1,581,300	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,300	1,097.00	2,523,100	貸付株式数	1,100株
ランド	442,400	8.00	3,539,200	貸付株式数	176,900株
カチタス	19,700	2,505.00	49,348,500	貸付株式数	7,800株
東祥	5,300	1,169.00	6,195,700	貸付株式数	2,000株
トーセイ	12,200	1,714.00	20,910,800	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,100	2,240.00	2,464,000	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	12,200	1,366.00	16,665,200		
インテリックス	1,400	554.00	775,600	貸付株式数	500株
ランドビジネス	2,100	248.00	520,800		
サンネクスタグループ	1,700	1,012.00	1,720,400	貸付株式数	900株
グランディハウス	4,800	552.00	2,649,600		
東武鉄道	81,600	3,746.00	305,673,600		
相鉄ホールディングス	24,600	2,612.50	64,267,500		
東急	208,400	1,823.50	380,017,400		
京浜急行	84,300	1,320.00	111,276,000		
小田急電鉄	112,700	2,020.00	227,654,000		
京王電鉄	39,300	4,927.00	193,631,100		
京成電鉄	47,900	5,556.00	266,132,400		
富士急行	9,200	5,250.00	48,300,000	貸付株式数	1,000株
東日本旅客鉄道	126,100	7,805.00	984,210,500		
西日本旅客鉄道	94,900	5,899.00	559,815,100		
東海旅客鉄道	57,300	17,200.00	985,560,000		
西武ホールディングス	89,900	1,479.50	133,007,050		
鴻池運輸	12,700	1,510.00	19,177,000		
西日本鉄道	19,900	2,414.00	48,038,600		
ハマキョウレックス	5,800	3,610.00	20,938,000		
サカイ引越センター	3,500	4,680.00	16,380,000		
近鉄グループＨＬＤＧＳ	74,200	4,816.00	357,347,200		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	98,900	4,505.00	445,544,500		
南海電鉄	35,500	3,214.00	114,097,000		
京阪ホールディングス	40,900	3,604.00	147,403,600		
神戸電鉄	2,000	3,050.00	6,100,000	貸付株式数	800株

名古屋鉄道	82,000	2,353.00	192,946,000		
山陽電鉄	5,600	2,221.00	12,437,600	貸付株式数	1,800株
アルプス物流	5,900	1,343.00	7,923,700	貸付株式数	2,200株
トランコム	2,200	6,760.00	14,872,000		
ヤマトホールディングス	95,000	2,597.50	246,762,500		
山　九	18,900	4,902.00	92,647,800		
日　新	5,600	2,459.00	13,770,400		
丸　運	2,800	237.00	663,600	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	4,600	3,825.00	17,595,000		
センコーグループＨＬＤＧＳ	39,300	936.00	36,784,800	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,600	4,310.00	6,896,000		
ニッコンホールディングス	23,800	2,677.50	63,724,500		
日石輸送	600	2,676.00	1,605,600		
福山通運	5,600	3,280.00	18,368,000		
セイノーホールディングス	46,200	1,606.00	74,197,200	貸付株式数	6,500株
エスライン	1,600	784.00	1,254,400	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,100	3,165.00	6,646,500		
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディ	17,900	2,094.00	37,482,600	貸付株式数	7,100株
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7,100	1,244.00	8,832,400	貸付株式数	800株
日本郵船	198,500	3,089.00	613,166,500		
商船三井	130,800	3,255.00	425,754,000	貸付株式数	51,600株
川崎汽船	55,700	3,258.00	181,470,600	貸付株式数	21,800株
ＮＳユナイテッド海運	4,000	3,335.00	13,340,000	貸付株式数	1,600株
明治海運	5,600	550.00	3,080,000	貸付株式数	2,500株
飯野海運	27,200	818.00	22,249,600	貸付株式数	3,700株
共栄タンカー	1,000	837.00	837,000	貸付株式数	300株
九州旅客鉄道	52,500	3,013.00	158,182,500		
ＳＧホールディングス	142,400	2,131.00	303,454,400		
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳ	27,700	8,143.00	225,561,100		
日本航空	182,200	2,748.50	500,776,700		
ＡＮＡホールディングス	201,900	3,130.00	631,947,000		
ビーウィズ	1,900	1,859.00	3,532,100	貸付株式数	500株
パスコ	1,100	1,653.00	1,818,300		
ＴＲＥホールディングス	16,100	1,084.00	17,452,400		
人・夢・技術グループ	2,900	1,480.00	4,292,000		

西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	2,000	4,470.00	8,940,000	貸付株式数	700株
シルバーライフ	1,500	1,303.00	1,954,500	貸付株式数	700株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	500	2,060.00	1,030,000		
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	3,400	4,360.00	14,824,000	貸付株式数	1,300株
コーア商事ＨＬＤＧＳ	4,400	702.00	3,088,800	貸付株式数	200株
ＫＰＰグループホールディン	18,300	579.00	10,595,700	貸付株式数	7,200株
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	944.00	944,000	貸付株式数	600株
ブックオフＧＨＤ	4,000	1,250.00	5,000,000	貸付株式数	1,700株
ギフトホールディングス	1,700	5,160.00	8,772,000	貸付株式数	600株
三菱倉庫	15,900	3,472.00	55,204,800		
三井倉庫ＨＯＬＤ	6,900	3,435.00	23,701,500	貸付株式数	800株
住友倉庫	20,000	2,281.00	45,620,000	貸付株式数	7,900株
渋沢倉庫	3,000	2,357.00	7,071,000		
ヤマタネ	3,500	1,624.00	5,684,000		
東陽倉庫	7,600	263.00	1,998,800		
乾汽船	9,400	1,330.00	12,502,000	貸付株式数	3,700株
日本トランスシティ	14,900	611.00	9,103,900		
ケイヒン	1,000	1,692.00	1,692,000		
中央倉庫	3,600	1,046.00	3,765,600	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,000	1,009.00	1,009,000	貸付株式数	200株
安田倉庫	5,100	966.00	4,926,600		
ファイズホールディングス	1,100	1,249.00	1,373,900	貸付株式数	400株
大栄環境	19,400	2,130.00	41,322,000		
日本管財ホールディンク	8,000	2,654.00	21,232,000		
東洋埠頭	1,700	1,302.00	2,213,400		
上　組	35,600	3,180.00	113,208,000		
サンリツ	1,300	701.00	911,300	貸付株式数	300株
キムラユニティー	2,700	1,139.00	3,075,300	貸付株式数	400株
キユーソー流通システム	3,500	957.00	3,349,500	貸付株式数	1,400株
東海運	3,300	282.00	930,600	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,700	1,684.00	7,914,800	貸付株式数	100株
内外トランスライン	2,700	2,448.00	6,609,600	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	1,700	554.00	941,800	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,300	1,652.00	3,799,600		
ＴＢＳホールディングス	38,200	2,322.00	88,700,400		

日本テレビＨＬＤＳ	66,000	1,299.00	85,734,000	
朝日放送グループＨＤ	7,000	647.00	4,529,000	貸付株式数 2,800株
テレビ朝日ＨＤ	18,100	1,536.00	27,801,600	
スカパーＪＳＡＴＨＤ	66,100	546.00	36,090,600	
テレビ東京ＨＤ	5,400	2,791.00	15,071,400	
日本ＢＳ放送	2,100	897.00	1,883,700	貸付株式数 800株
ビジョン	9,800	1,794.00	17,581,200	
スマートバリュー	1,400	389.00	544,600	貸付株式数 600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	8,400	3,370.00	28,308,000	貸付株式数 2,500株
ワイヤレスゲート	2,500	223.00	557,500	貸付株式数 1,100株
日本通信	68,800	256.00	17,612,800	
クロップス	900	1,042.00	937,800	
日本電信電話	955,100	4,064.00	3,881,526,400	
ＫＤＤＩ	576,000	4,392.00	2,529,792,000	
ソフトバンク	1,197,700	1,508.50	1,806,730,450	
光通信	8,800	21,205.00	186,604,000	
エムティーアイ	5,100	628.00	3,202,800	貸付株式数 2,000株
ＧＭＯインターネットグループ	27,500	2,643.50	72,696,250	
ファイバーゲート	4,000	1,324.00	5,296,000	貸付株式数 1,500株
アイドママーケティングコミュ	1,300	277.00	360,100	貸付株式数 600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	39,400	3,357.00	132,265,800	
学研ホールディングス	12,400	876.00	10,862,400	貸付株式数 2,600株
ゼンリン	12,700	894.00	11,353,800	
昭文社ホールディングス	2,500	300.00	750,000	貸付株式数 100株
インプレスホールディングス	5,000	209.00	1,045,000	貸付株式数 2,100株
東京電力ＨＤ	670,000	503.00	337,010,000	貸付株式数 255,600株
中部電力	273,900	1,678.50	459,741,150	
関西電力	287,000	1,615.00	463,505,000	
中国電力	118,400	856.50	101,409,600	
北陸電力	70,200	730.30	51,267,060	
東北電力	181,700	825.70	150,029,690	
四国電力	63,400	941.10	59,665,740	
九州電力	171,300	871.90	149,356,470	
北海道電力	71,800	575.20	41,299,360	
沖縄電力	17,400	1,145.00	19,923,000	
電源開発	56,000	2,075.00	116,200,000	

エフオン	4,800	553.00	2,654,400		
イーレックス	13,200	1,228.00	16,209,600	貸付株式数	100株
レノバ	19,800	1,649.00	32,650,200	貸付株式数	7,900株
東京瓦斯	157,100	3,065.00	481,511,500		
大阪瓦斯	150,600	2,232.00	336,139,200		
東邦瓦斯	29,300	2,499.50	73,235,350		
北海道瓦斯	4,400	2,099.00	9,235,600	貸付株式数	1,400株
広島ガス	15,700	360.00	5,652,000	貸付株式数	600株
西部ガスＨＬＤＧＳ	7,000	2,049.00	14,343,000	貸付株式数	200株
静岡ガス	16,900	1,215.00	20,533,500	貸付株式数	6,800株
メタウォーター	9,300	1,768.00	16,442,400		
アイネット	4,500	1,494.00	6,723,000		
松　竹	4,300	11,870.00	51,041,000		
東　宝	46,700	5,638.00	263,294,600		
エイチ・アイ・エス	20,000	1,949.00	38,980,000	貸付株式数	7,800株
東　映	2,100	18,340.00	38,514,000		
ラックランド	3,200	3,360.00	10,752,000	貸付株式数	1,200株
ＮＴＴデータ	233,900	2,042.50	477,740,750		
共立メンテナンス	13,100	5,395.00	70,674,500	貸付株式数	5,200株
イチネンホールディングス	8,100	1,293.00	10,473,300		
建設技術研究所	3,900	3,435.00	13,396,500		
スペース	5,500	1,032.00	5,676,000		
アインホールディングス	10,800	5,086.00	54,928,800	貸付株式数	4,200株
燦ホールディングス	3,300	2,211.00	7,296,300		
ピー・シー・エー	4,300	1,291.00	5,551,300	貸付株式数	500株
スバル興業	400	9,590.00	3,836,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,200	1,125.00	2,475,000	貸付株式数	1,000株
タナベコンサルティンググル	2,300	877.00	2,017,100		
ビジネスＢ太田昭和	3,200	2,285.00	7,312,000	貸付株式数	600株
ナ　ガ　ワ	2,000	6,590.00	13,180,000	貸付株式数	600株
東京都競馬	6,400	4,115.00	26,336,000	貸付株式数	2,400株
常磐興産	2,100	1,225.00	2,572,500	貸付株式数	1,000株
カナモト	14,000	2,151.00	30,114,000		
ＤＴＳ	15,900	3,595.00	57,160,500		
スクウェア・エニックス・ＨＤ	37,500	6,338.00	237,675,000		
シーイーシー	10,500	1,495.00	15,697,500		
カプコン	74,100	5,796.00	429,483,600	貸付株式数	16,700株
ニシオホールディングス	7,100	3,270.00	23,217,000	貸付株式数	1,500株

アイ・エス・ビー	3,800	1,593.00	6,053,400	貸付株式数	1,200株
アゴーラ　ホスピタリティーG	32,600	25.00	815,000	貸付株式数	15,600株
日本空港ビルデング	25,900	6,604.00	171,043,600		
トランス・コスモス	9,500	3,395.00	32,252,500	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	33,300	937.00	31,202,100		
ジャステック	4,600	1,281.00	5,892,600	貸付株式数	1,500株
ＳＣＳＫ	60,800	2,268.50	137,924,800		
藤田観光	3,400	3,705.00	12,597,000	貸付株式数	1,300株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,600	1,411.00	6,490,600	貸付株式数	1,800株
トーカイ	6,800	1,849.00	12,573,200		
白　洋　舎	800	2,596.00	2,076,800	貸付株式数	300株
セコム	77,800	9,313.00	724,551,400		
ＮＳＷ	2,900	2,404.00	6,971,600		
セントラル警備保障	4,100	2,855.00	11,705,500	貸付株式数	1,300株
アイネス	5,200	1,473.00	7,659,600		
丹青社	14,800	804.00	11,899,200		
メイテツク	29,800	2,387.00	71,132,600		
ＴＫＣ	11,900	3,790.00	45,101,000		
富士ソフト	8,400	9,020.00	75,768,000	貸付株式数	400株
応用地質	7,100	1,907.00	13,539,700		
船井総研ホールディン	15,900	2,720.00	43,248,000		
ＮＳＤ	26,600	2,780.00	73,948,000		
進学会ホールディングス	1,900	292.00	554,800	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	500	2,109.00	1,054,500		
オ　オ　バ	3,700	740.00	2,738,000	貸付株式数	500株
コナミグループ	31,900	7,697.00	245,534,300	貸付株式数	12,700株
いであ	1,300	1,661.00	2,159,300	貸付株式数	600株
学　究　社	3,000	2,183.00	6,549,000		
ベネッセホールディングス	28,500	1,872.00	53,352,000		
イオンディライト	8,500	3,015.00	25,627,500	貸付株式数	3,200株
ナック	3,400	967.00	3,287,800	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータＨＬＤＳ	5,200	2,816.00	14,643,200		
ダイセキ	15,600	3,750.00	58,500,000		
ステップ	2,800	1,811.00	5,070,800	貸付株式数	200株
日鉄物産	5,200	9,280.00	48,256,000		
泉州電業	3,900	3,400.00	13,260,000	貸付株式数	1,400株
元気寿司	2,200	3,310.00	7,282,000	貸付株式数	800株
トラスコ中山	16,500	2,194.00	36,201,000		

ヤマダホールディングス	322,400	422.90	136,342,960	貸付株式数	97,400株
オートバックスセブン	27,400	1,504.50	41,223,300		
モリト	5,600	1,011.00	5,661,600		
アークランズ	11,500	1,577.00	18,135,500		
ニトリホールディングス	31,800	17,185.00	546,483,000		
グルメ杵屋	6,400	1,056.00	6,758,400	貸付株式数	2,500株
愛　眼	4,500	176.00	792,000	貸付株式数	2,700株
ケーユーホールディングス	4,600	1,259.00	5,791,400		
吉野家ホールディングス	30,800	2,596.50	79,972,200	貸付株式数	12,300株
加藤産業	9,700	3,940.00	38,218,000		
北恵	1,400	733.00	1,026,200	貸付株式数	500株
イノテック	5,000	1,557.00	7,785,000		
イエローハット	13,900	1,839.00	25,562,100		
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,700	4,130.00	15,281,000	貸付株式数	1,200株
ＪＢＣＣホールディングス	5,400	2,335.00	12,609,000		
ＪＫホールディングス	6,000	969.00	5,814,000		
サガミホールディングス	12,600	1,263.00	15,913,800	貸付株式数	1,500株
日　伝	4,700	2,209.00	10,382,300	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	7,100	1,506.00	10,692,600	貸付株式数	100株
ミロク情報サービス	6,800	1,540.00	10,472,000	貸付株式数	1,800株
北沢産業	3,200	357.00	1,142,400	貸付株式数	1,400株
杉本商事	3,500	2,033.00	7,115,500	貸付株式数	400株
因幡電機産業	20,400	3,190.00	65,076,000		
王将フードサービス	5,200	6,390.00	33,228,000	貸付株式数	1,800株
ミニストップ	5,700	1,442.00	8,219,400	貸付株式数	2,200株
アークス	14,400	2,415.00	34,776,000	貸付株式数	4,100株
バローホールディングス	15,000	1,924.00	28,860,000		
東　テ　ク	2,600	4,195.00	10,907,000		
ミスミグループ本社	118,700	3,188.00	378,415,600		
アルテック	3,400	257.00	873,800	貸付株式数	800株
ベ　ル　ク	3,900	6,090.00	23,751,000		
大　庄	3,300	1,110.00	3,663,000	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	1,500	959.00	1,438,500	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	35,400	34,160.00	1,209,264,000		
ソフトバンクグループ	367,700	6,022.00	2,214,289,400		
蔵王産業	1,000	2,242.00	2,242,000	貸付株式数	100株
スズケン	23,000	3,693.00	84,939,000		
サンドラッグ	29,900	4,103.00	122,679,700		

サックスバーホールディング	7,500	1,011.00	7,582,500	
ジェコス	4,700	841.00	3,952,700	
ヤマザワ	1,100	1,243.00	1,367,300	貸付株式数　400株
や　ま　や	1,300	2,665.00	3,464,500	貸付株式数　600株
グローセル	7,400	404.00	2,989,600	貸付株式数　600株
ベルーナ	18,900	689.00	13,022,100	
合計			235,920,131,577	

（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。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年6月6日現在 金　額（円）	2023年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,785,323,632	784,015,541
コール・ローン	2,859,391,174	5,690,886,574

株式	258,776,639,198	327,359,557,109
投資証券	6,825,418,951	7,257,163,279
派生商品評価勘定	183,753,161	625,902,486
未収入金	59,346,882	193,360,845
未収配当金	401,762,924	502,849,758
差入委託証拠金	4,355,430,192	6,119,865,130
流動資産合計	275,247,066,114	348,533,600,722
資産合計	275,247,066,114	348,533,600,722
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	97,190,351	11,405,787
未払金	491,234,462	170,226,669
未払解約金	33,560,500	238,776,100
その他未払費用	189	-
流動負債合計	621,985,502	420,408,556
負債合計	621,985,502	420,408,556
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	65,219,352,126	73,305,284,321
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	209,405,728,486	274,807,907,845
元本等合計	274,625,080,612	348,113,192,166
純資産合計	274,625,080,612	348,113,192,166
負債純資産合計	275,247,066,114	348,533,600,722

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1. ※1 期首	2021年6月8日	2022年6月7日
期首元本額	58,182,794,639円	65,219,352,126円
期中追加設定元本額	13,258,685,462円	13,276,965,835円
期中一部解約元本額	6,222,127,975円	5,191,033,640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	349,068,733円	294,614,706円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,751,596円	2,700,422円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	45,554,421円	33,702,693円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	7,085,384円	5,352,543円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	205,400,687円	150,034,208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）	52,416,335円	87,595,091円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	-円	105,598,925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）	510,901,757円	628,464,988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）	2,693,828,278円	3,545,008,347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）	636,825,515円	598,060,561円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	17,598,341円	18,214,545円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	42,109,081円	49,601,005円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	5,032,009,377円	6,838,207,767円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,256,810,253円	1,473,361,115円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	220,052,668円	285,687,220円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	160,733円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	41,251,827,650円	45,285,958,135円
ダイワ・ライフ・バランス３０	528,041,544円	530,080,997円
ダイワ・ライフ・バランス５０	988,869,306円	1,054,132,356円
ダイワ・ライフ・バランス７０	798,656,593円	921,363,577円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,825,240,470円	1,948,055,233円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,623,928円	12,522,141円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	11,303,219円	12,720,324円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,007,956,945円	1,735,073,784円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,932,349円	2,074,276円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,153,578円	2,254,312円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	4,254,951円	5,627,914円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	246,407円	5,028,864円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	81,384,880円	66,467,884円

	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	153,275,360円	40,358,122円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,330,992,536円	1,086,845,160円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	68,880,810円	58,861,714円
	ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	188,669,046円	160,746,206円
	ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,063,368,930円	1,270,278,248円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	385,242,890円	419,653,362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）	1,570,304,135円	1,544,600,019円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,779,529,325円	2,938,348,326円
	ダイワライフスタイル２５	11,267,821円	10,050,870円
	ダイワライフスタイル５０	44,106,095円	43,338,052円
	ダイワライフスタイル７５	35,810,932円	34,479,576円
計		65,219,352,126円	73,305,284,321円
2.	期末日における受益権の総数	65,219,352,126口	73,305,284,321口

⑷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2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。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	2023年6月5日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△29,993,463,493	21,845,872,690
投資証券	△550,957,982	△267,067,608
合計	△30,544,421,475	21,578,805,082

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	8,633,026,393	-	8,683,393,283	50,366,890	13,027,055,445	-	13,587,168,704	560,113,259
合計	8,633,026,393	-	8,683,393,283	50,366,890	13,027,055,445	-	13,587,168,704	560,113,259

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

2．通貨関連

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	2,573,465,390	-	2,609,661,310	36,195,920	5,725,440,370	-	5,779,823,810	54,383,440
アメリカ・ドル	772,485,000	-	784,039,800	11,554,800	3,006,153,860	-	3,026,854,880	20,701,020
イギリス・ポンド	211,045,900	-	212,047,290	1,001,390	345,030,080	-	346,964,200	1,934,120
オーストラリア・ドル	305,737,740	-	310,782,120	5,044,380	441,188,160	-	451,376,240	10,188,080
カナダ・ドル	254,487,500	-	259,509,750	5,022,250	643,298,790	-	654,772,230	11,473,440
スイス・フラン	268,806,800	-	271,902,400	3,095,600	518,741,400	-	522,870,700	4,129,300
ユーロ	760,902,450	-	771,379,950	10,477,500	771,028,080	-	776,985,560	5,957,480
合計	2,573,465,390	-	2,609,661,310	36,195,920	5,725,440,370	-	5,779,823,810	54,383,440

（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）

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額	4.2108円	4.7488円
（1万口当たり純資産額）	(42,108円)	(47,488円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,500	153.250	842,875.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	14,100	217.240	3,063,084.000	
	FIRST SOLAR INC	4,700	206.740	971,678.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,300	163.260	1,355,058.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,200	103.700	642,940.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,000	128.340	385,020.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	33.040	697,144.000	
	ABBOTT LABORATORIES	80,866	104.200	8,426,237.200	
	HOWMET AEROSPACE INC	18,283	45.130	825,111.790	
	VERISK ANALYTICS INC	7,100	221.370	1,571,727.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	16,000	58.940	943,040.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	27,700	77.570	2,148,689.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,100	497.250	1,044,225.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27,600	55.380	1,528,488.000	
	QORVO INC	4,620	98.040	452,944.800	
	AFLAC INC	26,800	66.600	1,784,880.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,600	164.040	918,624.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,900	82.830	654,357.000	
	ADOBE INC	21,320	436.370	9,303,408.400	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,900	62.910	559,899.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,400	365.440	1,973,376.000	
	GARMIN LTD	7,100	106.470	755,937.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,300	281.040	2,894,712.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,000	198.850	6,164,350.000	
	WR BERKLEY CORP	9,842	57.650	567,391.300	
	AUTOZONE INC	920	2,381.230	2,190,731.600	
	DOLLAR TREE INC	10,271	133.610	1,372,308.310	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	53,100	7.230	383,913.000	
	CELANESE CORP	4,950	114.690	567,715.500	
	DR HORTON INC	14,916	112.020	1,670,890.320	
	DENTSPLY SIRONA INC	9,600	38.790	372,384.000	
	AUTODESK INC	10,000	204.240	2,042,400.000	
	MOODY'S CORP	7,700	326.990	2,517,823.000	

DEVON ENERGY CORP	30,600	48.530	1,485,018.000	
ALBEMARLE CORP	5,500	208.360	1,145,980.000	
ATMOS ENERGY CORP	6,700	114.520	767,284.000	
ALLIANT ENERGY CORP	11,700	51.980	608,166.000	
CITIGROUP INC	90,673	46.320	4,199,973.360	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,300	216.520	4,178,836.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,000	83.450	2,002,800.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,630	303.190	494,199.700	
HESS CORP	12,900	133.670	1,724,343.000	
DAVITA INC	2,750	98.740	271,535.000	
DANAHER CORP	32,350	234.620	7,589,957.000	
FORTIVE CORP	16,500	67.270	1,109,955.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	26,100	107.980	2,818,278.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,400	71.970	1,828,038.000	
BUNGE LTD	7,000	92.280	645,960.000	
TE CONNECTIVITY LTD	14,695	126.270	1,855,537.650	
APPLE INC	737,400	180.950	133,432,530.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,400	109.090	1,352,716.000	
BOEING CO/THE	26,500	213.320	5,652,980.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,315	100.580	735,742.700	
BECTON DICKINSON AND CO	13,199	251.790	3,323,376.210	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,100	81.490	497,089.000	
NISOURCE INC	19,300	26.760	516,468.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,500	97.670	537,185.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,571	42.740	1,605,784.540	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	195,604	34.580	6,763,986.320	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	60,550	329.480	19,950,014.000	
ANSYS INC	4,000	325.000	1,300,000.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	61,917	32.080	1,986,297.360	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	32,900	89.000	2,928,100.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	97,900	65.660	6,428,114.000	
JPMORGAN CHASE & CO	136,470	140.470	19,169,940.900	
T ROWE PRICE GROUP INC	10,500	110.920	1,164,660.000	
LKQ CORP	12,500	53.750	671,875.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,412	64.050	923,088.600	
CADENCE DESIGN SYS INC	12,700	229.690	2,917,063.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,900	313.200	1,534,680.000	
DOLLAR GENERAL CORP	10,200	166.120	1,694,424.000	
SERVICENOW INC	9,500	548.180	5,207,710.000	

CATERPILLAR INC	24,000	226.630	5,439,120.000	
BROWN & BROWN INC	11,300	63.790	720,827.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,700	40.940	478,998.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,400	200.680	481,632.000	
CMS ENERGY CORP	13,600	58.360	793,696.000	
MOSAIC CO/THE	15,400	33.080	509,432.000	
DELTA AIR LINES INC	7,300	37.010	270,173.000	
CORNING INC	37,500	31.510	1,181,625.000	
CISCO SYSTEMS INC	190,750	50.020	9,541,315.000	
MORGAN STANLEY	58,352	84.350	4,921,991.200	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,300	476.780	619,814.000	
MSCI INC	3,700	478.760	1,771,412.000	
FAIR ISAAC CORP	1,200	790.840	949,008.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,500	298.230	447,345.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,500	56.610	594,405.000	
BROADCOM INC	19,412	812.000	15,762,544.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,200	217.220	477,884.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	128.410	398,071.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,800	193.670	1,123,286.000	
ARAMARK	10,600	39.700	420,820.000	
DTE ENERGY COMPANY	9,600	108.880	1,045,248.000	
CENTENE CORP	25,507	66.460	1,695,195.220	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,800	135.180	648,864.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	22,100	27.790	614,159.000	
DARLING INGREDIENTS INC	7,500	64.060	480,450.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,000	205.680	2,056,800.000	
GARTNER INC	3,750	345.010	1,293,787.500	
SPLUNK INC	7,400	102.880	761,312.000	
DOMINION ENERGY INC	38,941	49.860	1,941,598.260	
MONSTER BEVERAGE CORP	36,600	59.480	2,176,968.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,700	68.410	389,937.000	
DEERE & CO	13,100	371.070	4,861,017.000	
QUANTA SERVICES INC	6,800	180.080	1,224,544.000	
POOL CORP	1,800	326.360	587,448.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	12,384	100.390	1,243,229.760	
VMWARE INC-CLASS A	11,000	137.910	1,517,010.000	
BURLINGTON STORES INC	3,000	150.980	452,940.000	
NASDAQ INC	16,000	56.330	901,280.000	
VAIL RESORTS INC	1,900	252.190	479,161.000	

TARGA RESOURCES CORP	9,800	71.490	700,602.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,400	116.660	396,644.000	
WESTLAKE CORP	1,800	113.010	203,418.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,100	91.760	1,477,336.000	
COGNEX CORP	7,900	56.870	449,273.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,900	38.470	303,913.000	
TELEFLEX INC	2,200	236.470	520,234.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,900	172.590	673,101.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,500	343.730	1,203,055.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,000	372.360	372,360.000	
CATALENT INC	8,400	37.720	316,848.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,800	195.000	1,326,000.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,700	287.170	775,359.000	
CARLISLE COS INC	2,400	225.930	542,232.000	
IDEX CORP	3,500	209.100	731,850.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	36,800	76.050	2,798,640.000	
ROLLINS INC	11,607	40.630	471,592.410	
AECOM	6,200	81.000	502,200.000	
WATSCO INC	1,600	340.760	545,216.000	
GRACO INC	8,000	79.800	638,400.000	
AMETEK INC	10,700	150.680	1,612,276.000	
TORO CO	4,900	102.040	499,996.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,400	93.810	1,069,434.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,550	56.930	429,821.500	
HEICO CORP	2,000	162.000	324,000.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,800	114.780	321,384.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,800	398.810	717,858.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,100	89.920	1,088,032.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,000	397.690	795,380.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	20,660	512.590	10,590,109.400	
EPAM SYSTEMS INC	2,700	259.650	701,055.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,900	83.730	494,007.000	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,800	241.690	676,732.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,300	2,062.230	2,680,899.000	
UGI CORP	9,500	28.060	266,570.000	
CUMMINS INC	6,600	217.800	1,437,480.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,600	80.500	2,865,800.000	
CDW CORP/DE	6,300	174.220	1,097,586.000	
COSTAR GROUP INC	18,900	81.880	1,547,532.000	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,600	319.670	1,470,482.000	
MERCADOLIBRE INC	2,090	1,270.670	2,655,700.300	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,400	152.740	519,316.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,416	142.800	1,773,004.800	
DEXCOM INC	18,100	122.570	2,218,517.000	
NORDSON CORP	2,390	227.220	543,055.800	
COPART INC	20,000	88.030	1,760,600.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,000	131.350	1,050,800.000	
SEAGEN INC	6,500	195.380	1,269,970.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,400	302.000	1,026,800.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,700	202.770	750,249.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,590	793.820	2,055,993.800	
BIO-TECHNE CORP	7,320	83.000	607,560.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,600	92.320	424,672.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,400	99.930	939,342.000	
KINDER MORGAN INC	94,181	16.750	1,577,531.750	
HCA HEALTHCARE INC	10,200	274.260	2,797,452.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,800	281.510	506,718.000	
COTERRA ENERGY INC	35,500	23.900	848,450.000	
T-MOBILE US INC	28,327	131.190	3,716,219.130	
ZILLOW GROUP INC - C	7,150	46.680	333,762.000	
COCA-COLA CO/THE	191,450	61.160	11,709,082.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,100	63.480	641,148.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	113.960	837,606.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,000	25.020	350,280.000	
CSX CORP	95,400	31.920	3,045,168.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,100	216.980	889,618.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,825	103.270	704,817.750	
AMAZON.COM INC	430,200	124.250	53,452,350.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,100	85.340	2,398,054.000	
EXXON MOBIL CORP	188,905	105.760	19,978,592.800	
AES CORP	31,200	20.190	629,928.000	
EVEREST RE GROUP LTD	2,000	343.130	686,260.000	
EOG RESOURCES INC	27,400	111.920	3,066,608.000	
EQT CORP	16,900	36.550	617,695.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,300	93.510	682,623.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	1,298.030	649,015.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,100	174.520	1,413,612.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,800	118.220	1,631,436.000	

FORD MOTOR CO	183,023	12.390	2,267,654.970	
EXACT SCIENCES CORP	8,300	83.840	695,872.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,137	16.230	115,833.510	
ENTEGRIS INC	7,000	108.390	758,730.000	
AERCAP HOLDINGS NV	8,200	59.070	484,374.000	
FORTINET INC	31,000	68.130	2,112,030.000	
MARKEL CORP	600	1,362.180	817,308.000	
NEXTERA ENERGY INC	94,280	73.850	6,962,578.000	
MASIMO CORP	2,300	163.300	375,590.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	66,608	37.190	2,477,151.520	
INSULET CORP	3,200	281.030	899,296.000	
US BANCORP	71,700	31.740	2,275,758.000	
UNITED RENTALS INC	3,200	361.600	1,157,120.000	
F5 NETWORKS INC	2,800	146.750	410,900.000	
FASTENAL CO	26,600	55.370	1,472,842.000	
FISERV INC	29,133	113.900	3,318,248.700	
GENERAL ELECTRIC CO	50,806	105.800	5,375,274.800	
AXON ENTERPRISE INC	3,200	193.250	618,400.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,900	181.350	344,565.000	
GENERAL MOTORS CO	64,600	34.280	2,214,488.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	10,900	209.090	2,279,081.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,550	323.650	5,032,757.500	
FIRST HORIZON CORP	23,900	11.040	263,856.000	
ALPHABET INC-CL A	277,400	124.670	34,583,458.000	
ALPHABET INC-CL C	249,940	125.230	31,299,986.200	
OWENS CORNING	4,300	113.520	488,136.000	
GENERAL MILLS INC	27,300	84.590	2,309,307.000	
FIRSTENERGY CORP	25,318	37.700	954,488.600	
GENUINE PARTS CO	6,650	153.350	1,019,777.500	
FIFTH THIRD BANCORP	31,200	25.950	809,640.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,850	182.220	1,612,647.000	
HALLIBURTON CO	42,000	31.640	1,328,880.000	
REPLIGEN CORP	2,500	167.260	418,150.000	
HOME DEPOT INC	47,150	295.940	13,953,571.000	
ASSURANT INC	2,450	123.430	302,403.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	67,200	10.890	731,808.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,910	207.480	396,286.800	
HERSHEY CO/THE	6,900	260.910	1,800,279.000	
HUMANA INC	5,800	520.780	3,020,524.000	

NXP SEMICONDUCTORS NV	12,100	181.600	2,197,360.000	
HENRY SCHEIN INC	6,100	74.420	453,962.000	
HP INC	47,300	30.550	1,445,015.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	60,400	15.240	920,496.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,328	28.200	206,649.600	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,200	71.860	661,112.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,400	70.900	1,233,660.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	37,303	38.510	1,436,538.530	
ENPHASE ENERGY INC	6,400	181.860	1,163,904.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,300	132.420	5,601,366.000	
HUBBELL INC	2,500	294.490	736,225.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	15,300	30.380	464,814.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	5,900	64.310	379,429.000	
ZOETIS INC	21,500	171.880	3,695,420.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,699	173.010	1,851,033.990	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	79.550	540,940.000	
CHENIERE ENERGY INC	11,400	145.770	1,661,778.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	115.080	264,684.000	
ALLEGION PLC	4,050	109.270	442,543.500	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,800	118.970	808,996.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	17.080	221,578.840	
WASTE CONNECTIONS INC	12,037	139.490	1,679,041.130	
JUNIPER NETWORKS INC	15,000	30.970	464,550.000	
JM SMUCKER CO/THE	5,000	148.980	744,900.000	
JOHNSON & JOHNSON	121,000	156.970	18,993,370.000	
ABBVIE INC	82,172	136.870	11,246,881.640	
HOLOGIC INC	11,500	79.060	909,190.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	15,700	136.090	2,136,613.000	
KROGER CO	31,800	45.920	1,460,256.000	
KLA CORP	6,400	458.060	2,931,584.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	10,700	454.490	4,863,043.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,300	234.840	774,972.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	37.710	395,955.000	
LOWE'S COS INC	27,700	209.810	5,811,737.000	
ELI LILLY & CO	37,585	442.330	16,624,973.050	
LAM RESEARCH CORP	6,280	613.670	3,853,847.600	
LOEWS CORP	9,100	58.020	527,982.000	

MCDONALD'S CORP	34,050	289.910	9,871,435.500	
3M CO	25,690	102.530	2,633,995.700	
META PLATFORMS INC CLASS A	103,100	272.610	28,106,091.000	
S&P GLOBAL INC	15,339	376.030	5,767,924.170	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,900	415.080	1,203,732.000	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,620	291.060	762,577.200	
ALCOA CORP	8,000	34.940	279,520.000	
PHILLIPS 66	21,400	97.030	2,076,442.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,100	183.900	1,305,690.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	40.710	653,395.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,700	88.460	1,034,982.000	
METLIFE INC	30,600	52.970	1,620,882.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	39,900	60.180	2,401,182.000	
ARISTA NETWORKS INC	12,200	162.500	1,982,500.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,798	282.730	2,204,728.540	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,000	1,332.660	1,332,660.000	
BAKER HUGHES CO	47,223	29.580	1,396,856.340	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,300	292.840	1,552,052.000	
MERCK & CO. INC.	118,221	112.520	13,302,226.920	
DUPONT DE NEMOURS INC	22,551	72.370	1,632,015.870	
MASCO CORP	10,300	51.470	530,141.000	
M & T BANK CORP	7,799	125.590	979,476.410	
MARSH & MCLENNAN COS	23,070	176.400	4,069,548.000	
BLACK KNIGHT INC	7,350	57.310	421,228.500	
HEICO CORP-CLASS A	3,420	128.790	440,461.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,302	177.220	2,180,160.440	
WORKDAY INC-CLASS A	9,500	213.500	2,028,250.000	
BLOCK INC CLASS A	25,212	63.460	1,599,953.520	
TRANSUNION	9,000	74.460	670,140.000	
VISTRA CORP	17,600	24.720	435,072.000	
NOVOCURE LTD	4,350	79.520	345,912.000	
NETAPP INC	9,800	70.980	695,604.000	
NIKE INC -CL B	57,200	107.780	6,165,016.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,600	215.870	2,288,222.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,500	77.200	1,968,600.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,605	94.350	906,231.750	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	28.220	400,724.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,700	443.830	2,973,661.000	
APTIV PLC	12,600	93.690	1,180,494.000	

NEWMONT CORP	37,011	42.090	1,557,792.990	
MCKESSON CORP	6,400	390.160	2,497,024.000	
XYLEM INC	11,300	105.060	1,187,178.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	72,300	91.780	6,635,694.000	
NUCOR CORP	11,700	141.290	1,653,093.000	
GODADDY INC - CLASS A	7,000	75.730	530,110.000	
EVERGY INC	10,750	57.730	620,597.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	59.690	2,001,047.560	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,250	217.710	272,137.500	
OKTA INC	7,200	73.830	531,576.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	74.530	417,368.000	
WIX.COM LTD	2,610	76.540	199,769.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	16,800	25.750	432,600.000	
KKR & CO INC	28,200	53.630	1,512,366.000	
PAYCHEX INC	15,100	110.250	1,664,775.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	895.340	2,596,486.000	
ALTRIA GROUP INC	83,200	45.330	3,771,456.000	
P G & E CORP	84,500	16.650	1,406,925.000	
PFIZER INC	263,013	38.360	10,089,178.680	
CIGNA CORP	13,900	257.030	3,572,717.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	47.270	557,833.270	
XCEL ENERGY INC	25,600	63.140	1,616,384.000	
STERIS PLC	4,600	205.470	945,162.000	
SEA LTD-ADR	18,000	59.390	1,069,020.000	
FOX CORP - CLASS B	6,533	29.840	194,944.720	
FOX CORP - CLASS A	13,699	31.870	436,587.130	
STRYKER CORP	15,880	278.300	4,419,404.000	
DOW INC	33,018	51.610	1,704,058.980	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,100	70.360	358,836.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,000	67.090	737,990.000	
PARKER HANNIFIN CORP	6,000	340.730	2,044,380.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	85,300	39.730	3,388,969.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,900	205.670	2,241,803.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	109,867	146.520	16,097,712.840	
EXELON CORP	46,322	39.690	1,838,520.180	
INGERSOLL-RAND INC	18,908	61.360	1,160,194.880	
NVR INC	150	5,711.000	856,650.000	
CONOCOPHILLIPS	56,702	102.350	5,803,449.700	
TWILIO INC - A	8,300	67.150	557,345.000	

DOCUSIGN INC	9,400	57.470	540,218.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,500	293.320	733,300.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,800	64.910	441,388.000	
PEPSICO INC	64,200	184.060	11,816,652.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,020	149.310	301,606.200	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	23.680	286,528.000	
MONGODB INC	3,300	376.300	1,241,790.000	
SNAP INC - A	49,700	10.410	517,377.000	
CORTEVA INC	33,168	55.920	1,854,754.560	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,100	83.040	1,419,984.000	
AMCOR PLC	69,300	9.970	690,921.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,400	151.320	1,573,728.000	
ROKU INC	5,500	60.140	330,770.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,100	145.790	1,326,689.000	
ACCENTURE PLC-CL A	29,400	311.390	9,154,866.000	
PENTAIR PLC	7,475	58.500	437,287.500	
QUALCOMM INC	51,900	115.620	6,000,678.000	
INVESCO LTD	15,200	15.260	231,952.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,750	67.560	185,790.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,100	69.470	771,117.000	
DATADOG INC - CLASS A	11,600	98.770	1,145,732.000	
PINTEREST INC- CLASS A	27,700	23.470	650,119.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,000	739.950	3,699,750.000	
REPUBLIC SERVICES INC	10,300	144.500	1,488,350.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,800	2,625.650	4,726,170.000	
ROSS STORES INC	15,800	103.300	1,632,140.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,230	128.080	541,778.400	
RESMED INC	6,800	220.640	1,500,352.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,230	135.560	708,978.800	
ROBERT HALF INTL INC	4,900	69.880	342,412.000	
MODERNA INC	15,300	130.510	1,996,803.000	
HUBSPOT INC	2,180	524.140	1,142,625.200	
REVVITY INC	5,900	115.220	679,798.000	
CARRIER GLOBAL CORP	38,887	43.440	1,689,251.280	
OTIS WORLDWIDE CORP	19,238	85.600	1,646,772.800	
BILL HOLDINGS INC	4,500	107.460	483,570.000	
AVANTOR INC	31,500	20.020	630,630.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,200	28.790	293,658.000	
DYNATRACE INC	10,100	52.620	531,462.000	

TRADE DESK INC/THE -CLASS A	20,700	74.240	1,536,768.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	43,485	18.060	785,339.100	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	13,200	26.450	349,140.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	17,600	33.420	588,192.000	
MATCH GROUP INC	12,600	38.970	491,022.000	
CHEVRON CORP	83,718	156.260	13,081,774.680	
ZSCALER INC	4,100	142.390	583,799.000	
EDISON INTERNATIONAL	17,800	66.680	1,186,904.000	
ETSY INC	5,700	85.010	484,557.000	
TESLA INC	133,350	213.970	28,532,899.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	12,200	175.210	2,137,562.000	
GEN DIGITAL INC	26,700	17.990	480,333.000	
UNITY SOFTWARE INC	11,300	31.000	350,300.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,102	80.730	573,344.460	
SYNOPSYS INC	7,100	449.360	3,190,456.000	
CHEWY INC - CLASS A	4,350	35.510	154,468.500	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,700	70.640	897,128.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,005	329.320	1,648,246.600	
VIATRIS INC	55,821	9.330	520,809.930	
DOORDASH INC - A	11,950	67.880	811,166.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	19,700	40.340	794,698.000	
AIRBNB INC-CLASS A	19,300	118.060	2,278,558.000	
CBRE GROUP INC - A	14,500	77.130	1,118,385.000	
SOUTHERN CO/THE	50,800	69.450	3,528,060.000	
SYSCO CORP	23,600	72.640	1,714,304.000	
TRAVELERS COS INC/THE	10,803	175.130	1,891,929.390	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	38.980	113,042.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,300	58.520	310,156.000	
STEEL DYNAMICS INC	8,150	97.710	796,336.500	
SCHLUMBERGER LTD	66,152	46.770	3,093,929.040	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	42.940	300,580.000	
AT&T INC	332,091	15.210	5,051,104.110	
APA CORP	14,400	33.680	484,992.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,950	30.070	208,986.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	20,100	86.830	1,745,283.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,000	44.860	448,600.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,400	240.830	2,745,462.000	
SEMPRA ENERGY	14,700	144.570	2,125,179.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	49.960	524,580.000	

CLARIVATE PLC	17,500	8.010	140,175.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	84,100	14.520	1,221,132.000	
UIPATH INC - CLASS A	17,500	18.240	319,200.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,850	62.210	550,558.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,800	64.550	503,490.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	42,300	175.230	7,412,229.000	
SALESFORCE.COM INC	46,566	213.030	9,919,954.980	
WESTROCK CO	11,900	28.860	343,434.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	18,609	69.700	1,297,047.300	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	32,034	62.390	1,998,601.260	
TERADYNE INC	7,300	103.220	753,506.000	
UNION PACIFIC CORP	28,380	198.660	5,637,970.800	
MARATHON OIL CORP	29,900	23.260	695,474.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	22,188	108.910	2,416,495.080	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	68,079	96.080	6,541,030.320	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	33,700	170.140	5,733,718.000	
IQVIA HOLDINGS INC	8,704	201.370	1,752,724.480	
AMEREN CORPORATION	12,200	81.170	990,274.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	43,466	499.580	21,714,744.280	
TOAST INC CLASS A	14,400	21.070	303,408.000	
VERISIGN INC	4,400	226.970	998,668.000	
LUCID GROUP INC	30,500	6.600	201,300.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	30,900	14.480	447,432.000	
VALERO ENERGY CORP	17,642	109.270	1,927,741.340	
ULTA BEAUTY INC	2,300	422.400	971,520.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,688	35.140	410,716.320	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	135.460	383,351.800	
ELEVANCE HEALTH INC	11,100	471.020	5,228,322.000	
WALT DISNEY CO/THE	85,062	90.770	7,721,077.740	
WELLS FARGO & CO	175,222	41.240	7,226,155.280	
WASTE MANAGEMENT INC	18,900	164.960	3,117,744.000	
WILLIAMS COS INC	56,800	30.230	1,717,064.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,100	211.190	1,077,069.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	135.690	325,656.000	
WALMART INC	69,000	148.820	10,268,580.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,800	129.810	1,272,138.000	
WYNN RESORTS LTD	4,800	100.350	481,680.000	

GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	92,000	3.020	277,840.000	
WABTEC CORP	8,411	97.920	823,605.120	
TJX COMPANIES INC	53,700	78.110	4,194,507.000	
WATERS CORP	2,700	258.770	698,679.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,400	278.010	667,224.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,200	31.190	1,066,698.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,963	224.530	1,114,342.390	
WESTERN DIGITAL CORP	14,900	40.240	599,576.000	
WEC ENERGY GROUP INC	14,700	87.080	1,280,076.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	23,200	61.040	1,416,128.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	75,750	228.790	17,330,842.500	
PPL CORP	34,300	26.520	909,636.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	15,324	87.540	1,341,462.960	
PULTEGROUP INC	10,350	69.380	718,083.000	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	107,753	11.750	1,266,097.750	
PPG INDUSTRIES INC	11,000	139.580	1,535,380.000	
NORTHERN TRUST CORP	9,700	75.180	729,246.000	
FERGUSON PLC	9,600	147.760	1,418,496.000	
NVIDIA CORP	115,080	393.270	45,257,511.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	18,613	123.580	2,300,194.540	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,400	165.500	231,700.000	
TYSON FOODS INC-CL A	13,200	51.340	677,688.000	
NETFLIX INC	20,690	400.470	8,285,724.300	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,900	520.140	9,310,506.000	
NRG ENERGY INC	10,550	33.300	351,315.000	
GLOBE LIFE INC	4,255	107.040	455,455.200	
TEXTRON INC	9,400	64.050	602,070.000	
NEWS CORP - CLASS A	17,887	18.800	336,275.600	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,372.000	480,200.000	
OMNICOM GROUP	9,300	91.320	849,276.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,920	114.990	680,740.800	
ORACLE CORP	75,533	105.890	7,998,189.370	
MASTERCARD INC - A	39,600	373.730	14,799,708.000	
ONEOK INC	20,800	58.740	1,221,792.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,000	458.860	2,294,300.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	4,600	49.360	227,056.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	7,400	89.290	660,746.000	

CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,200	79.630	414,076.000	
HF SINCLAIR CORP	7,300	43.260	315,798.000	
OVINTIV INC	11,300	35.590	402,167.000	
YUM! BRANDS INC	13,000	134.530	1,748,890.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,900	137.520	1,086,408.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,800	63.870	562,056.000	
BANK OF AMERICA CORP	335,301	28.710	9,626,491.710	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,200	397.420	874,324.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,800	93.360	821,568.000	
AMERICAN EXPRESS CO	29,500	168.560	4,972,520.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	16,935	79.970	1,354,291.950	
LINDE PLC	22,846	360.470	8,235,297.620	
ANALOG DEVICES INC	23,591	179.800	4,241,661.800	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	14,100	20.500	289,050.000	
MONDAYCOM LTD	900	175.000	157,500.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	75,027	117.860	8,842,682.220	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	33,872	55.200	1,869,734.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,300	105.120	767,376.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,700	86.230	922,661.000	
AVERY DENNISON CORP	3,830	166.330	637,043.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,700	63.760	1,511,112.000	
EMERSON ELECTRIC CO	26,900	82.810	2,227,589.000	
AON PLC-CLASS A	9,600	313.800	3,012,480.000	
AMGEN INC	24,900	218.070	5,429,943.000	
EATON CORP PLC	18,536	186.480	3,456,593.280	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,700	245.420	1,889,734.000	
APPLIED MATERIALS INC	39,300	134.630	5,290,959.000	
CME GROUP INC	16,800	185.300	3,113,040.000	
ECOLAB INC	11,900	173.100	2,059,890.000	
EQUIFAX INC	5,700	213.650	1,217,805.000	
GILEAD SCIENCES INC	58,200	77.890	4,533,198.000	
KEURIG DR PEPPER INC	42,900	31.450	1,349,205.000	
HORMEL FOODS CORP	14,000	40.770	570,780.000	
STATE STREET CORP	16,713	71.550	1,195,815.150	
SCHWAB (CHARLES) CORP	70,140	54.370	3,813,511.800	
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,600	41.330	975,388.000	
CAMPBELL SOUP CO	9,400	51.470	483,818.000	
CROWN HOLDINGS INC	5,580	80.370	448,464.600	

CARDINAL HEALTH INC	12,100	84.590	1,023,539.000	
FEDEX CORP	11,200	221.740	2,483,488.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,754	110.490	1,961,639.460	
FMC CORP	5,850	107.070	626,359.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,913	80.050	953,635.650	
INTEL CORP	194,400	31.310	6,086,664.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,000	38.670	696,060.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,450	70.550	1,019,447.500	
WOLFSPEED INC	5,800	49.060	284,548.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,200	229.180	3,254,356.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	3.580	138,188.000	
ILLUMINA INC	7,400	207.310	1,534,094.000	
SEALED AIR CORP	6,700	39.720	266,124.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	16,300	312.180	5,088,534.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,850	124.030	601,545.500	
SNAP-ON INC	2,500	259.710	649,275.000	
CARMAX INC	7,400	74.660	552,484.000	
DUKE ENERGY CORP	35,928	89.680	3,222,023.040	
TARGET CORP	21,400	133.220	2,850,908.000	
DOVER CORP	6,400	139.860	895,104.000	
WW GRAINGER INC	2,100	677.770	1,423,317.000	
CINTAS CORP	4,300	481.560	2,070,708.000	
CONAGRA BRANDS INC	22,200	35.130	779,886.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,800	113.270	770,236.000	
CLOROX COMPANY	5,800	161.370	935,946.000	
ENTERGY CORP	9,900	99.440	984,456.000	
MICROSOFT CORP	329,400	335.400	110,480,760.000	
INCYTE CORP	8,600	62.540	537,844.000	
CVS HEALTH CORP	59,669	69.990	4,176,233.310	
MEDTRONIC PLC	61,998	83.760	5,192,952.480	
MICRON TECHNOLOGY INC	51,000	69.170	3,527,670.000	
BLACKROCK INC	7,000	681.860	4,773,020.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	29,300	28.600	837,980.000	
HASBRO INC	6,000	60.020	360,120.000	
KELLOGG CO	12,800	67.390	862,592.000	
KEYCORP	43,100	10.280	443,068.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	63,511	74.270	4,716,961.970	
COOPER COS INC/THE	2,300	356.470	819,881.000	
CHUBB LTD	19,299	192.360	3,712,355.640	

	ARROW ELECTRONICS INC	2,900	128.790	373,491.000	
	ALLSTATE CORP	12,300	110.080	1,353,984.000	
	EBAY INC	24,900	44.390	1,105,311.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	49,650	63.960	3,175,614.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,500	82.570	454,135.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,800	188.290	2,033,532.000	
	TRIMBLE INC	11,500	49.560	569,940.000	
	LENNAR CORP-A	11,800	112.000	1,321,600.000	
	LEAR CORP	2,800	131.060	366,968.000	
	PROGRESSIVE CORP	27,300	129.500	3,535,350.000	
	PACCAR INC	24,255	73.300	1,777,891.500	
	BIOGEN INC	6,700	300.200	2,011,340.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,900	470.830	1,836,237.000	
	STARBUCKS CORP	53,500	99.500	5,323,250.000	
	PTC INC	5,200	137.930	717,236.000	
	EVERSOURCE ENERGY	16,200	70.010	1,134,162.000	
	INTUIT INC	13,080	430.490	5,630,809.200	
	BORGWARNER INC	10,600	47.680	505,408.000	
	BEST BUY CO INC	9,250	73.210	677,192.500	
	BALL CORP	14,604	54.440	795,041.760	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	51.820	3,471,784.540	
	ELECTRONIC ARTS INC	12,800	127.670	1,634,176.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,200	202.730	1,256,926.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,000	333.780	4,005,360.000	
	VF CORP	14,700	18.120	266,364.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	27,125	15.400	417,725.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	96.680	241,700.000	
	CARNIVAL CORP	46,800	12.180	570,024.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	23,100	15.050	347,655.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	196,190	39.190	7,688,686.100	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	48.440	421,428.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	53,500	4.310	230,585.000	
アメリカ・ドル 小計				1,729,467,790.650 (242,436,794,894)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	315,129	22.900	7,216,454.100	
	HALEON PLC	231,333	3.272	756,921.570	
	WISE PLC CLASS A	30,273	6.060	183,454.380	
	BP PLC	816,509	4.743	3,873,110.440	

UNILEVER PLC	115,022	40.565	4,665,867.430	
BARCLAYS PLC	707,553	1.567	1,109,160.080	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	381,060	1.500	571,590.000	
PRUDENTIAL PLC	125,414	11.530	1,446,023.420	
NATWEST GROUP PLC	262,737	2.650	696,253.050	
JOHNSON MATTHEY PLC	8,388	18.045	151,361.460	
BAE SYSTEMS PLC	139,042	9.424	1,310,331.800	
AVIVA PLC	127,014	4.091	519,614.270	
GSK	186,614	13.676	2,552,133.060	
INFORMA PLC	62,995	7.048	443,988.760	
AUTO TRADER GROUP PLC	41,019	6.170	253,087.230	
DCC PLC	4,301	47.520	204,383.520	
OCADO GROUP PLC	23,827	3.582	85,348.310	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,270	111.800	365,586.000	
HALMA PLC	16,864	24.620	415,191.680	
ENTAIN PLC	26,861	13.280	356,714.080	
JD SPORTS FASHION PLC	112,804	1.569	176,989.470	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	32,680	5.670	185,295.600	
M&G PLC	104,504	2.040	213,188.160	
ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	21.780	199,090.980	
RELX PLC	86,625	25.660	2,222,797.500	
DIAGEO PLC	102,628	33.725	3,461,129.300	
RIO TINTO PLC	51,279	50.700	2,599,845.300	
STANDARD CHARTERED PLC	108,504	6.640	720,466.560	
TESCO PLC	333,384	2.624	874,799.610	
SMITH & NEPHEW PLC	39,859	12.090	481,895.310	
GLENCORE PLC	487,397	4.339	2,114,815.580	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,095	8.172	123,356.340	
SMITHS GROUP PLC	15,383	16.190	249,050.770	
PEARSON PLC	28,363	8.206	232,746.770	
SAINSBURY (J) PLC	78,274	2.785	217,993.090	
NEXT PLC	5,620	65.020	365,412.400	
TAYLOR WIMPEY PLC	157,039	1.180	185,384.530	
WHITBREAD PLC	9,218	33.740	311,015.320	
BUNZL PLC	15,410	31.560	486,339.600	
VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.756	866,411.220	
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,203	62.300	386,446.900	
KINGFISHER PLC	85,779	2.389	204,926.030	
WPP PLC	48,968	8.790	430,428.720	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,105	10.365	322,403.320	
	SEVERN TRENT PLC	11,475	27.060	310,513.500	
	RENTOKIL INITIAL PLC	114,775	6.482	743,971.550	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	32,621	63.080	2,057,732.680	
	ST JAMES'S PLACE PLC	24,174	11.535	278,847.090	
	SCHRODERS PLC	39,815	4.633	184,462.890	
	SSE PLC	49,692	18.680	928,246.560	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	43,245	4.818	208,354.410	
	ASTRAZENECA PLC	70,592	117.480	8,293,148.160	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	272,067	2.360	642,078.120	
	3I GROUP PLC	44,331	19.600	868,887.600	
	ASHTEAD GROUP PLC	19,973	51.120	1,021,019.760	
	SAGE GROUP PLC/THE	46,665	8.722	407,012.130	
	NATIONAL GRID PLC	167,557	10.550	1,767,726.350	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,016,079	0.454	1,370,657.100	
	IMPERIAL BRANDS PLC	39,967	17.310	691,828.770	
	CENTRICA PLC	279,988	1.204	337,245.540	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,918	40.440	198,883.920	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	96,741	25.705	2,486,727.400	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,800	18.695	295,381.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	910,010	6.027	5,484,630.270	
	ANGLO AMERICAN PLC	57,876	24.180	1,399,441.680	
	MONDI PLC	22,149	12.910	285,943.590	
	COMPASS GROUP PLC	79,435	22.070	1,753,130.450	
	PERSIMMON PLC	13,915	12.525	174,285.370	
	BT GROUP PLC	345,300	1.436	496,023.450	
	COCA-COLA HBC AG-DI	10,136	23.890	242,149.040	
	BURBERRY GROUP PLC	17,053	21.860	372,778.580	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,005	54.020	432,430.100	
	INTERTEK GROUP PLC	7,169	42.680	305,972.920	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,564	84.940	1,576,826.160	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,361	18.030	132,718.830	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,779	23.740	232,153.460	
	ANTOFAGASTA PLC	17,513	14.565	255,076.840	
	ABRDN PLC	90,862	2.035	184,904.170	
	EXPERIAN PLC	41,857	28.980	1,213,015.860	
イギリス・ポンド 小計				82,443,008.320 (14,364,869,770)	

イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	60,911	18.240	1,111,016.640	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	199.500	364,287.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,051	143.200	723,303.200	
	ICL GROUP LTD	38,090	20.850	794,176.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,310	739.000	968,090.000	
	BANK HAPOALIM BM	62,536	30.380	1,899,843.680	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	76,017	27.020	2,053,979.340	
	NICE LTD	3,128	769.000	2,405,432.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7,598	122.400	929,995.200	
イスラエル・シュケル 小計				11,250,123.560 (421,016,750)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	95,515	4.990	476,619.850	
	TELSTRA GROUP LTD	176,757	4.340	767,125.380	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	131,029	22.770	2,983,530.330	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	116,553	3.580	417,259.740	
	BHP GROUP LTD	220,895	43.250	9,553,708.750	
	SOUTH32 LTD	194,263	3.930	763,453.590	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	82,795	34.550	2,860,567.250	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	73,842	19.690	1,453,948.980	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	136,792	25.790	3,527,865.680	
	WESTPAC BANKING CORP	153,058	20.540	3,143,811.320	
	SANTOS LTD	144,925	7.440	1,078,242.000	
	RIO TINTO LTD	16,187	110.150	1,782,998.050	
	ORIGIN ENERGY LTD	75,281	8.370	630,101.970	
	AURIZON HOLDINGS LTD	75,100	3.590	269,609.000	
	PILBARA MINERALS LTD	113,184	4.470	505,932.480	
	XERO LTD	6,302	111.870	705,004.740	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	32.770	340,414.760	
	COLES GROUP LTD	58,509	17.820	1,042,630.380	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,381	76.630	565,606.030	
	IDP EDUCATION LTD	11,169	21.750	242,925.750	
	IGO LTD	30,405	14.090	428,406.450	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,726	13.620	677,268.120	
	REECE LTD	10,500	18.320	192,360.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	60,660	6.160	373,665.600	
	SEEK LTD	14,264	23.570	336,202.480	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	30,976	11.410	353,436.160	

	NEWCREST MINING LTD	39,092	27.500	1,075,030.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	73,593	96.910	7,131,897.630	
	AMPOL LTD	10,454	31.760	332,019.040	
	ORICA LTD	19,499	15.290	298,139.710	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	65,087	14.620	951,571.940	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	53,152	37.550	1,995,857.600	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	6.680	261,067.760	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	18,801	38.250	719,138.250	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,010	171.000	2,737,710.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,750	37.880	975,410.000	
	CSL LTD	21,034	308.000	6,478,472.000	
	WESFARMERS LTD	49,470	47.800	2,364,666.000	
	COCHLEAR LTD	2,823	245.010	691,663.230	
	BLUESCOPE STEEL LTD	19,124	19.590	374,639.160	
	SUNCORP GROUP LTD	54,249	13.300	721,511.700	
	ASX LTD	8,307	67.450	560,307.150	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	22.160	557,745.040	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	103,987	5.130	533,453.310	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,599	35.810	701,840.190	
	BRAMBLES LTD	60,760	13.380	812,968.800	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,602	69.500	528,339.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,857	57.850	454,527.450	
	REA GROUP LTD	2,236	136.980	306,287.280	
オーストラリア・ドル 小計				67,036,957.080 (6,198,237,052)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	35,500	67.670	2,402,285.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	15,181	42.490	645,040.690	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	64.440	612,180.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	900	2,775.840	2,498,256.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,187	102.530	1,352,063.110	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,800	60.890	1,205,622.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,850	200.850	1,576,672.500	
	BCE INC	4,930	61.380	302,603.400	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,500	198.210	1,684,785.000	
	SUNCOR ENERGY INC	59,230	39.250	2,324,777.500	
	METRO INC/CN	10,300	71.920	740,776.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	15,000	98.650	1,479,750.000	

BANK OF NOVA SCOTIA	53,000	66.710	3,535,630.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,300	57.360	2,311,608.000	
TORONTO-DOMINION BANK	81,000	78.890	6,390,090.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	12,500	38.820	485,250.000	
ROYAL BANK OF CANADA	61,650	124.060	7,648,299.000	
TOURMALINE OIL CORP	14,400	59.730	860,112.000	
TC ENERGY CORP	45,350	55.230	2,504,680.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	24,529	43.000	1,054,747.000	
BARRICK GOLD CORP	78,300	23.230	1,818,909.000	
CAE INC	14,200	28.800	408,960.000	
THOMSON REUTERS CORP	7,512	165.920	1,246,391.040	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	34.700	246,370.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	95.080	332,780.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,550	63.180	413,829.000	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	20.550	361,680.000	
HYDRO ONE LTD	14,400	38.840	559,296.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,960	118.490	824,690.400	
NORTHLAND POWER INC	11,200	29.770	333,424.000	
WSP GLOBAL INC	5,500	175.790	966,845.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,700	108.320	400,784.000	
PARKLAND CORP	6,600	34.400	227,040.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,800	32.480	220,864.000	
EMERA INC	11,800	56.550	667,290.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,500	148.210	518,735.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,400	36.550	197,370.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,800	59.610	941,838.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	98.490	157,584.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	26,700	11.120	296,904.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	22,117	69.740	1,542,439.580	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	11.440	335,192.000	
AIR CANADA	7,600	21.720	165,072.000	
KINROSS GOLD CORP	56,100	6.510	365,211.000	
BANK OF MONTREAL	31,700	116.650	3,697,805.000	
POWER CORP OF CANADA	26,000	35.360	919,360.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	53,300	78.250	4,170,725.000	
NUTRIEN LTD	23,119	73.600	1,701,558.400	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,800	47.090	273,122.000	
CAMECO CORP	18,900	40.380	763,182.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,800	198.610	357,498.000	

	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,700	50.400	488,880.000	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	41.100	106,860.000	
	TELUS CORP	10,800	25.730	277,884.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,500	58.210	1,193,305.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	168.290	403,896.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	49,300	75.270	3,710,811.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	986.500	986,500.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	12,100	68.720	831,512.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,137	160.280	502,798.360	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	20.810	353,770.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	103.390	392,882.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	26,100	67.430	1,759,923.000	
	ENBRIDGE INC	90,000	50.260	4,523,400.000	
	BROOKFIELD CORP	62,625	41.650	2,608,331.250	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	81,800	25.880	2,116,984.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,420	105.660	4,376,437.200	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,400	89.150	392,260.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	39.080	293,100.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,250	157.980	3,988,995.000	
	CGI INC - CLASS A	9,400	141.600	1,331,040.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	61.730	179,017.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	39.700	142,920.000	
	TMX GROUP LTD	2,500	148.090	370,225.000	
	OPEN TEXT CORP	12,100	56.500	683,650.000	
	SAPUTO INC	10,800	35.200	380,160.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	25,800	30.080	776,064.000	
	FORTIS INC	21,600	57.640	1,245,024.000	
	RB GLOBAL INC	8,400	73.860	620,424.000	
	LUNDIN MINING CORP	27,800	10.070	279,946.000	
	CENOVUS ENERGY INC	63,200	22.820	1,442,224.000	
	DOLLARAMA INC	12,800	83.480	1,068,544.000	
	ALTAGAS LTD	12,100	24.280	293,788.000	
	KEYERA CORP	10,200	31.320	319,464.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	16.840	481,624.000	
カナダ・ドル 小計				105,970,618.930 (11,060,153,497)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	128,100	3.310	424,011.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	62,300	27.840	1,734,432.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	89,200	30.600	2,729,520.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,975	6.600	435,435.000	
	KEPPEL CORP LTD	71,700	6.260	448,842.000	
	UOL GROUP LTD	22,900	6.480	148,392.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,600	6.780	166,788.000	
	SEATRIUM	2,016,022	0.121	243,938.660	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,400	32.140	141,416.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	166,700	12.230	2,038,741.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	279,500	1.000	279,500.000	
	VENTURE CORP LTD	12,800	14.970	191,616.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	406,650	2.500	1,016,625.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	72,200	3.650	263,530.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,200	9.380	395,836.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	94,600	3.880	367,048.000	
シンガポール・ドル 小計				11,025,670.660 (1,143,582,561)	
スイス・フラン	DUFRY AG-REG	4,854	41.500	201,441.000	
	UBS GROUP AG-REG	145,555	18.080	2,631,634.400	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	313.000	452,911.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	307	719.000	220,733.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,823	28.470	194,250.810	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	31,265	292.800	9,154,392.000	
	SIKA AG-REG	6,499	255.800	1,662,444.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	112,600.000	563,000.000	
	ABB LTD-REG	69,946	33.940	2,373,967.240	
	SWISS RE AG	13,423	93.200	1,251,023.600	
	NESTLE SA-REG	122,379	109.600	13,412,738.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,010	841.600	850,016.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,774	196.750	349,034.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,536	57.200	545,459.200	
	SGS SA-REG	6,925	83.880	580,869.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,026	189.700	194,632.200	
	TEMENOS AG - REG	2,716	78.120	212,173.920	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	126.600	231,424.800	
	VAT GROUP AG	1,176	375.100	441,117.600	
	BKW AG	942	162.800	153,357.600	
	ALCON INC	22,237	72.100	1,603,287.700	
	SIG GROUP N AG	13,641	24.920	339,933.720	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,290	267.300	344,817.000	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,696	432.300	2,894,680.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,956	142.400	278,534.400	
	CLARIANT AG-REG	9,678	13.160	127,362.480	
	NOVARTIS AG-REG	94,023	89.370	8,402,835.510	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,867.000	296,853.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,424	94.550	134,639.200	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	23,230	145.750	3,385,772.500	
	SWISSCOM AG-REG	1,153	568.800	655,826.400	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	92.550	124,387.200	
	GEBERIT AG-REG	1,559	498.500	777,161.500	
	GIVAUDAN-REG	411	3,043.000	1,250,673.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,967	136.150	676,257.050	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,279	239.200	545,136.800	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,375	57.520	424,210.000	
	LONZA GROUP AG-REG	3,314	586.800	1,944,655.200	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	50.500	114,584.500	
	HOLCIM LTD	24,669	57.240	1,412,053.560	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	538.000	738,136.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,424	264.300	640,663.200	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,275	77.700	254,467.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	11,130.000	489,720.000	
スイス・フラン 小計				63,533,268.690 (9,784,758,711)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	8,813	232.000	2,044,616.000	
	INVESTOR CLASS A	23,863	222.700	5,314,290.100	
	VOLVO CAR CLASS B	28,514	40.160	1,145,122.240	
	ERICSSON LM-B SHS	143,721	56.520	8,123,110.920	
	VOLVO AB-B SHS	74,305	207.850	15,444,294.250	
	SKF AB-B SHARES	17,719	179.650	3,183,218.350	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	94.920	2,499,528.360	
	GETINGE AB-B SHS	10,572	254.000	2,685,288.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	79,569	118.350	9,416,991.150	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,793	89.900	6,274,390.700	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,333	174.200	7,548,608.600	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	142.340	4,974,213.640	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	29,833	149.550	4,461,525.150	
	SKANSKA AB-B SHS	15,724	146.450	2,302,779.800	
	SANDVIK AB	52,501	203.300	10,673,453.300	

	INVESTOR AB-B SHS	87,179	221.800	19,336,302.200	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	131,528	159.800	21,018,174.400	
	VOLVO AB-A SHS	9,255	216.400	2,002,782.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,336	426.000	1,847,136.000	
	SECURITAS AB-B SHS	22,743	83.800	1,905,863.400	
	TELIA CO AB	122,866	25.150	3,090,079.900	
	ALFA LAVAL AB	13,863	397.000	5,503,611.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	76,858	137.600	10,575,660.800	
	ASSA ABLOY AB-B	49,353	248.500	12,264,220.500	
	SAAB AB-B	3,943	596.600	2,352,393.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,027	296.100	1,784,594.700	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	30,192	39.540	1,193,791.680	
	INDUTRADE AB	13,454	262.400	3,530,329.600	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,807	213.000	1,662,891.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,513	466.000	1,637,058.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	222.600	1,523,251.800	
	LIFCO AB-B SHS	10,774	230.700	2,485,561.800	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	74,623	105.800	7,895,113.400	
	BEIJER REF AB	16,584	161.000	2,670,024.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,993	293.000	8,787,949.000	
	EMBRACER GROUP AB	30,041	25.270	759,136.070	
	BOLIDEN AB	13,087	357.800	4,682,528.600	
	EPIROC AB-A	31,534	201.400	6,350,947.600	
	EPIROC AB-B	19,202	171.200	3,287,382.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	86.220	1,672,236.900	
	NORDEA BANK ABP	160,871	110.700	17,808,419.700	
	EQT AB	17,511	211.200	3,698,323.200	
	EVOLUTION AB	9,024	1,449.000	13,075,776.000	
	KINNEVIK AB - B	11,612	160.900	1,868,370.800	
	HEXAGON AB-B SHS	102,232	128.300	13,116,365.600	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,118	294.400	2,095,539.200	
スウェーデン・クローナ 小計				267,573,245.610 (3,465,073,531)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	79,858	1,081.000	86,326,498.000	
	DANSKE BANK A/S	33,963	148.300	5,036,712.900	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	12,140.000	1,857,420.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	49,726	204.300	10,159,021.800	
	CARLSBERG AS-B	4,849	1,046.500	5,074,478.500	

	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,071	341.800	3,442,267.800	
	COLOPLAST-B	5,850	881.400	5,156,190.000	
	DSV PANALPINA A/S	9,166	1,363.500	12,497,841.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,760.000	749,760.000	
	DEMANT A/S	4,275	269.900	1,153,822.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	240	12,270.000	2,944,800.000	
	TRYG A/S	17,729	158.250	2,805,614.250	
	PANDORA A/S	4,341	565.000	2,452,665.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,194	513.000	2,664,522.000	
	GENMAB A/S	3,249	2,722.000	8,843,778.000	
	ORSTED A/S	9,315	610.600	5,687,739.000	
デンマーク・クローネ 小計				156,853,130.750 (3,157,453,521)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	59,568	5.575	332,091.600	
	MERCURY NZ LTD	34,143	6.650	227,050.950	
	EBOS GROUP LTD	7,660	41.460	317,583.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,147	5.195	478,703.660	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,644	8.790	541,850.760	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	27,626	23.960	661,918.960	
ニュージーランド・ドル 小計				2,559,199.530 (217,173,672)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	45,804	190.550	8,727,952.200	
	NORSK HYDRO ASA	64,351	69.840	4,494,273.840	
	ORKLA ASA	36,983	79.200	2,929,053.600	
	TELENOR ASA	34,455	112.900	3,889,969.500	
	EQUINOR ASA	46,908	294.750	13,826,133.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,153	422.600	3,445,457.800	
	MOWI ASA	21,643	190.000	4,112,170.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,244	183.100	1,692,576.400	
	AKER BP ASA	15,560	257.000	3,998,920.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,098	453.200	1,857,213.600	
	SALMAR ASA	3,573	477.600	1,706,464.800	
	ADEVINTA ASA	13,944	80.700	1,125,280.800	
ノルウェー・クローネ 小計				51,805,465.540 (658,965,521)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	37,346	19.030	710,694.380	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	22,443	29.310	657,804.330	
	EXOR NV	4,786	79.960	382,688.560	

DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,136	118.000	606,048.000	
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	31.960	93,898.480	
DSM FIRMENICH AG	7,889	103.820	819,035.980	
BAYER AG-REG	44,238	52.610	2,327,361.180	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,486	18.375	174,305.250	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	90,946	9.862	896,909.450	
COMMERZBANK AG	48,018	9.576	459,820.360	
VOLKSWAGEN AG	1,304	150.150	195,795.600	
VOLKSWAGEN AG-PREF	9,372	121.540	1,139,072.880	
SIEMENS AG-REG	34,201	159.280	5,447,535.280	
E.ON SE	101,096	11.320	1,144,406.720	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,909	106.160	1,582,739.440	
GEA GROUP AG	6,681	40.100	267,908.100	
CONTINENTAL AG	4,853	66.680	323,598.040	
BASF SE	40,416	46.790	1,891,064.640	
ALLIANZ SE-REG	18,163	210.150	3,816,954.450	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,695	74.800	575,586.000	
RHEINMETALL AG	1,965	240.100	471,796.500	
RWE AG	28,268	39.330	1,111,780.440	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,029	9.303	251,450.780	
BRENNTAG SE	6,969	75.480	526,020.120	
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,055	26.230	499,812.650	
SAP SE	47,021	124.360	5,847,531.560	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,309	342.600	2,161,463.400	
ZALANDO SE	9,669	27.120	262,223.280	
HEIDELBERG MATERIALS AG	6,389	69.880	446,463.320	
COVESTRO AG	8,520	38.670	329,468.400	
RATIONAL AG	215	642.000	138,030.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	333.500	403,535.000	
TALANX AG	3,119	53.650	167,334.350	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,755	54.160	365,850.800	
DELIVERY HERO SE	7,584	36.690	278,256.960	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,748	111.600	195,076.800	
BECHTLE AG	3,626	37.310	135,286.060	
NEMETSCHEK SE	2,557	74.800	191,263.600	
SCOUT24 AG	3,600	61.240	220,464.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,721	53.800	684,389.800	

KNORR-BREMSE AG	3,158	65.780	207,733.240	
HELLOFRESH SE	7,177	20.550	147,487.350	
SIEMENS ENERGY AG	23,742	24.400	579,304.800	
BEIERSDORF AG	4,547	120.650	548,595.550	
MERCK KGAA	5,820	167.100	972,522.000	
ADIDAS AG	7,467	159.520	1,191,135.840	
PUMA SE	4,586	47.210	216,505.060	
HENKEL AG & CO KGAA	4,584	67.700	310,336.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	145,949	19.138	2,793,171.960	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,061	40.580	367,695.380	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	38,764	72.240	2,800,311.360	
QIAGEN N.V.	10,272	43.440	446,215.680	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	58,805	35.805	2,105,513.020	
HANNOVER RUECK SE	2,720	205.200	558,144.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	45,384	42.880	1,946,065.920	
DEUTSCHE BOERSE AG	8,556	165.600	1,416,873.600	
MTU AERO ENGINES AG	2,417	219.700	531,014.900	
WACKER CHEMIE AG	899	127.650	114,757.350	
SYMRISE AG	5,990	101.050	605,289.500	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.635	108,857.120	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,686	99.850	268,197.100	
VONOVIA SE	31,518	17.845	562,438.710	
LEG IMMOBILIEN SE	3,105	50.660	157,299.300	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,997	18.156	762,497.530	
NN GROUP NV	12,086	34.840	421,076.240	
ARCELORMITTAL	25,700	24.930	640,701.000	
HEINEKEN NV	11,672	94.320	1,100,903.040	
AEGON NV	77,429	4.350	336,816.150	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,015	29.355	1,350,770.320	
AKZO NOBEL N.V.	7,841	73.040	572,706.640	
WOLTERS KLUWER	11,595	112.100	1,299,799.500	
ING GROEP NV	163,846	11.970	1,961,236.620	
KONINKLIJKE KPN NV	143,197	3.172	454,220.880	
ASML HOLDING NV	18,154	674.600	12,246,688.400	
ABN AMRO BANK NV-CVA	17,828	14.040	250,305.120	
IMCD NV	2,514	144.650	363,650.100	
ADYEN NV	977	1,582.000	1,545,614.000	
JUST EAT TAKEAWAY	9,530	13.900	132,467.000	
PROSUS NV	36,049	66.220	2,387,164.780	

JDE PEET'S NV	5,785	27.500	159,087.500	
ASM INTERNATIONAL NV	2,115	397.750	841,241.250	
RANDSTAD NV	5,275	48.360	255,099.000	
HEINEKEN HOLDING NV	5,248	79.800	418,790.400	
OCI NV	4,386	21.000	92,106.000	
TOTALENERGIES SE	109,487	55.180	6,041,492.660	
MICHELIN (CGDE)	30,548	27.430	837,931.640	
AIR LIQUIDE SA	23,578	159.380	3,757,861.640	
KERING	3,350	506.700	1,697,445.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,430	165.620	4,046,096.600	
BOUYGUES SA	9,572	30.430	291,275.960	
BNP PARIBAS	50,023	56.480	2,825,299.040	
THALES SA	4,734	133.000	629,622.000	
DANONE	28,911	56.060	1,620,750.660	
CARREFOUR SA	26,778	17.315	463,661.070	
VIVENDI	31,166	8.376	261,046.410	
L'OREAL	10,842	407.800	4,421,367.600	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,086	54.670	1,207,441.620	
LEGRAND SA	12,015	88.720	1,065,970.800	
PERNOD RICARD SA	9,292	204.300	1,898,355.600	
EURAZEO SE	1,981	64.800	128,368.800	
SOCIETE GENERALE SA	35,528	22.610	803,288.080	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	12,431	830.900	10,328,917.900	
ACCOR SA	8,355	31.690	264,769.950	
CAPGEMINI SE	7,430	167.700	1,246,011.000	
VALEO SA	9,148	18.990	173,720.520	
PUBLICIS GROUPE	10,308	70.800	729,806.400	
BUREAU VERITAS SA	12,970	24.520	318,024.400	
EIFFAGE	3,675	100.250	368,418.750	
SODEXO SA	3,903	101.650	396,739.950	
IPSEN	1,706	110.600	188,683.600	
AMUNDI SA	2,569	54.050	138,854.450	
TELEPERFORMANCE	2,667	141.800	378,180.600	
EURONEXT NV	3,876	63.300	245,350.800	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,946	61.600	366,273.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,194	265.000	316,410.000	
SEB SA	997	88.350	88,084.950	
ESSILORLUXOTTICA	13,103	171.320	2,244,805.960	
DASSAULT AVIATION SA	1,108	164.500	182,266.000	

WORLDLINE SA	10,790	36.570	394,590.300	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,561	36.660	167,206.260	
AXA SA	82,807	27.255	2,256,904.780	
EDENRED	11,258	60.720	683,585.760	
RENAULT SA	8,329	33.095	275,648.250	
HERMES INTERNATIONAL	1,426	1,957.200	2,790,967.200	
STMICROELECTRONICS NV	30,776	42.010	1,292,899.760	
REMY COINTREAU	1,009	140.050	141,310.450	
DASSAULT SYSTEMES SE	30,068	41.675	1,253,083.900	
WENDEL	1,124	102.200	114,872.800	
ORANGE	87,788	11.030	968,301.640	
ALSTOM	14,107	26.950	380,183.650	
SANOFI	51,072	94.980	4,850,818.560	
VINCI SA	23,903	107.580	2,571,484.740	
AIRBUS SE	26,700	128.380	3,427,746.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,624	27.960	856,247.040	
CREDIT AGRICOLE SA	54,582	10.954	597,891.220	
BIOMERIEUX	1,852	94.720	175,421.440	
ENGIE	82,244	14.104	1,159,969.370	
SAFRAN SA	15,391	139.040	2,139,964.640	
ARKEMA	2,576	85.680	220,711.680	
ADP	1,343	142.900	191,914.700	
GETLINK SE	19,411	16.155	313,584.700	
BOLLORE	39,141	5.935	232,301.830	
UCB SA	5,577	82.500	460,102.500	
KBC GROUP NV	11,272	62.760	707,430.720	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	73.500	322,150.500	
SOLVAY SA	3,212	102.750	330,033.000	
UMICORE	9,239	27.330	252,501.870	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,112	50.910	1,991,191.920	
AGEAS	7,114	38.640	274,884.960	
D'IETEREN GROUP	1,036	166.500	172,494.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,462	115.500	168,861.000	
SOFINA	670	202.000	135,340.000	
ARGENX SE	2,509	369.100	926,071.900	
PRYSMIAN SPA	11,238	36.500	410,187.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	48,878	18.140	886,646.920	
MEDIOBANCA SPA	26,230	10.705	280,792.150	
TENARIS SA	20,832	12.345	257,171.040	

UNICREDIT SPA	84,516	18.858	1,593,802.720	
TELECOM ITALIA SPA	434,374	0.252	109,592.560	
INTESA SANPAOLO	721,438	2.271	1,638,746.410	
POSTE ITALIANE SPA	22,639	10.000	226,390.000	
MONCLER SPA	9,291	64.360	597,968.760	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,624	42.840	198,092.160	
ENI SPA	110,008	13.142	1,445,725.130	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,654	12.445	281,929.030	
DIASORIN SPA	1,144	98.840	113,072.960	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,648	11.815	173,066.120	
NEXI SPA	25,005	7.436	185,937.180	
AMPLIFON SPA	5,632	33.450	188,390.400	
ENEL SPA	366,238	6.046	2,214,274.940	
SNAM SPA	88,957	4.979	442,916.900	
TERNA SPA	63,467	7.918	502,531.700	
CNH INDUSTRIAL NV	46,159	12.565	579,987.830	
FINECOBANK SPA	26,908	12.675	341,058.900	
STELLANTIS NV	101,275	14.786	1,497,452.150	
FERRARI NV	5,676	279.100	1,584,171.600	
TELEFONICA SA	234,049	3.891	910,684.650	
ENDESA SA	14,367	20.970	301,275.990	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	271,306	6.490	1,760,775.940	
IBERDROLA SA	270,354	11.580	3,130,699.320	
REPSOL SA	60,600	13.370	810,222.000	
GRIFOLS SA	12,949	11.550	149,560.950	
BANCO SANTANDER SA	738,996	3.210	2,372,177.160	
AMADEUS IT GROUP SA	20,286	68.440	1,388,373.840	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.860	276,658.000	
CAIXABANK SA	195,084	3.631	708,350.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,544	31.320	298,918.080	
AENA SME SA	3,383	146.850	496,793.550	
CELLNEX TELECOM SA	25,443	38.200	971,922.600	
ACCIONA SA	1,117	156.850	175,201.450	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	49,119	32.150	1,579,175.850	
ENAGAS SA	10,803	18.195	196,560.580	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,900	16.020	286,758.000	
FERROVIAL SA	23,057	29.290	675,339.530	
UPM-KYMMENE OYJ	24,034	28.640	688,333.760	
NOKIA OYJ	238,120	3.835	913,190.200	

	WARTSILA OYJ ABP	20,930	10.890	227,927.700	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	26,320	12.405	326,499.600	
	ELISA OYJ	6,414	52.360	335,837.040	
	SAMPO OYJ-A SHS	21,110	43.580	919,973.800	
	FORTUM OYJ	19,800	12.205	241,659.000	
	KESKO OYJ-B SHS	12,355	17.925	221,463.370	
	KONE OYJ-B	15,332	51.280	786,224.960	
	NESTE OYJ	19,050	37.370	711,898.500	
	ORION OYJ-CLASS B	4,846	40.320	195,390.720	
	METSO CORPORATION	31,351	10.625	333,104.370	
	VERBUND AG	2,951	68.050	200,815.550	
	OMV AG	6,496	43.880	285,044.480	
	ERSTE GROUP BANK AG	15,510	31.480	488,254.800	
	VOESTALPINE AG	4,878	30.300	147,803.400	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,784	34.660	408,433.440	
	AIB GROUP PLC	61,254	3.900	238,890.600	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	47,750	9.150	436,912.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,975	63.940	445,981.500	
	JERONIMO MARTINS	12,272	24.080	295,509.760	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	132,745	4.642	616,202.290	
	GALP ENERGIA SGPS SA	21,724	10.515	228,427.860	
	EDP RENOVAVEIS SA	12,491	19.235	240,264.380	
	KERRY GROUP PLC-A	7,189	92.460	664,694.940	
	CRH PLC	33,337	45.460	1,515,500.020	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,983	185.850	1,483,640.550	
ユーロ 小計				213,757,630.140 (32,040,131,181)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	68,000	42.100	2,862,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	108,000	49.800	5,378,400.000	
	MTR CORP	76,500	36.500	2,792,250.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,500	101.800	7,278,700.000	
	SINO LAND CO	182,000	10.300	1,874,600.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	132,169	47.650	6,297,852.850	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	54.000	1,296,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	80,500	56.350	4,536,175.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,507	24.550	1,632,746.850	
	HONG KONG & CHINA GAS	536,475	7.210	3,867,984.750	
	HANG SENG BANK LTD	36,600	106.900	3,912,540.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,500	19.260	1,396,350.000	

	WH GROUP LTD	399,000	4.160	1,659,840.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	59,100	302.400	17,871,840.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	12.960	1,257,120.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	12.360	1,075,320.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	54,000	19.260	1,040,040.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	95,669	43.700	4,180,735.300	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	42.250	1,267,500.000	
	AIA GROUP LTD	565,600	78.000	44,116,800.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	13.360	855,040.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	80,000	39.700	3,176,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	82,400	20.100	1,656,240.000	
	ESR CAYMAN LTD	95,800	12.440	1,191,752.000	
	SANDS CHINA LTD	119,600	26.500	3,169,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	68,000	73.750	5,015,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	177,000	23.750	4,203,750.000	
香港・ドル 小計				134,862,776.750 (2,411,346,448)	
合計				327,359,557,109 [327,359,557,109]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,537	1,184,504.400	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,207	1,619,697.570	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,700	339,288.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,000	1,128,250.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,800	1,059,912.000	
		EQUINIX INC	4,408	3,339,544.880	
		AMERICAN TOWER CORP	21,700	4,147,955.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,343	586,836.800	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,200	530,328.000	
		KIMCO REALTY CORP	28,900	542,164.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	17,300	331,987.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,200	613,050.000	
		INVITATION HOMES INC	28,500	982,965.000	
		VICI PROPERTIES INC	46,900	1,482,509.000	
		VENTAS INC	18,600	842,394.000	
		WEYERHAEUSER CO	34,214	986,389.620	

	CROWN CASTLE INTL CORP	20,200	2,302,800.000	
	IRON MOUNTAIN INC	13,600	751,128.000	
	SUN COMMUNITIES INC	5,800	768,906.000	
	PROLOGIS INC	42,954	5,365,813.680	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,700	888,349.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,000	538,100.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,000	685,650.000	
	WELLTOWER INC	23,200	1,757,632.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	25,500	528,360.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,400	813,564.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,200	541,938.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,100	452,991.000	
	REALTY INCOME CORP	30,895	1,844,431.500	
	PUBLIC STORAGE	7,400	2,134,086.000	
	REGENCY CENTERS CORP	7,200	419,472.000	
	UDR INC	14,500	596,820.000	
	WP CAREY INC	10,000	706,100.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,600	1,432,080.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,300	920,115.000	
アメリカ・ドル 小計			43,166,111.450 (6,051,025,503)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,834	192,897.500	
	SEGRO PLC	55,182	456,686.230	
	BRITISH LAND CO PLC	38,375	136,346.370	
イギリス・ポンド 小計			785,930.100 (136,940,461)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	45,529	375,614.250	
	LENDLEASE GROUP	28,107	218,391.390	
	TRANSURBAN GROUP	134,358	1,964,313.960	
	APA GROUP	50,633	512,912.290	
	SCENTRE GROUP	218,948	595,538.560	
	GPT GROUP	81,080	338,914.400	
	MIRVAC GROUP	173,080	405,007.200	
	STOCKLAND	104,777	459,971.030	
	GOODMAN GROUP	73,798	1,467,104.240	
	VICINITY CENTRES	163,150	303,459.000	

	オーストラリア・ドル 小計			6,641,226.320 (614,047,786)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	172,414.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	117,566.000	
	カナダ・ドル 小計			289,980.000 (30,265,213)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	165,600	447,120.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	261,870	523,740.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170,200	284,234.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112,700	185,955.000	
	シンガポール・ドル 小計			1,441,049.000 (149,465,602)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,203	232,574.100	
		GECINA SA	1,995	197,604.750	
		KLEPIERRE	9,340	205,760.200	
		COVIVIO	2,000	94,040.000	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,389	201,276.360	
	ユーロ 小計			931,255.410 (139,585,873)	
	香港・ドル	LINK REIT	124,500	5,870,175.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	181,000	1,726,740.000	
	香港・ドル 小計			7,596,915.000 (135,832,841)	
投資証券 合計				7,257,163,279 [7,257,163,279]	
合計				7,257,163,279 [7,257,163,279]	

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 604銘柄 投資証券 35銘柄	97.6%	2.4%	74.4%
イギリス・ポンド	株式 79銘柄 投資証券 3銘柄	99.1%	0.9%	4.3%
イスラエル・シュケル	株式 9銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄 投資証券 10銘柄	91%	9.0%	2.0%
カナダ・ドル	株式 85銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.3%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 4銘柄	88.4%	11.6%	0.4%
スイス・フラン	株式 44銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式 6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 221銘柄 投資証券 5銘柄	99.6%	0.4%	9.6%
香港・ドル	株式 27銘柄 投資証券 2銘柄	94.7%	5.3%	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

	2022年6月6日現在 金　額（円）	2023年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	5,696,408,831	8,083,687,965

コール・ローン	1,304,305,964	1,316,481,366
国債証券	234,504,938,294	251,403,629,306
派生商品評価勘定	21,748,461	7,667,397
未収入金	15,749,407	11,204,843
未収利息	1,315,513,379	1,601,633,414
前払費用	43,054,119	71,242,440
流動資産合計	242,901,718,455	262,495,546,731
資産合計	242,901,718,455	262,495,546,731
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	712,889
未払金	4,935,132,601	5,474,668,258
未払解約金	145,405,730	248,983,806
流動負債合計	5,080,538,331	5,724,364,953
負債合計	5,080,538,331	5,724,364,953
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	75,518,465,344	79,326,984,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	162,302,714,780	177,444,197,721
元本等合計	237,821,180,124	256,771,181,778
純資産合計	237,821,180,124	256,771,181,778
負債純資産合計	242,901,718,455	262,495,546,731

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1. ※1 期首	2021年6月8日	2022年6月7日
期首元本額	72,171,959,824円	75,518,465,344円
期中追加設定元本額	9,393,523,151円	9,967,747,761円
期中一部解約元本額	6,047,017,631円	6,159,229,048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	468,789,568円	420,348,520円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,719,452円	7,898,412円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	60,069,032円	47,909,085円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	21,864,771円	18,253,368円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	273,677,757円	216,841,012円
外国債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	262,828,185円	457,193,545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）	582,097,301円	730,996,597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）	2,435,159,714円	3,033,257,830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）	637,283,512円	855,201,324円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	946,025円	1,615,120円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	11,046,385円	17,415,830円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,957,942,756円	2,204,039,693円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,635,638,497円	2,093,016,152円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	281,749,418円	408,215,928円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	15,487円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	49,873,381,777円	50,799,853,169円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,015,192,007円	1,133,031,789円
ダイワ・ライフ・バランス５０	638,155,597円	746,371,730円
ダイワ・ライフ・バランス７０	416,524,630円	532,513,009円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	613,659,406円	676,398,361円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	475,082,867円	527,279,690円

	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	179,008,193円	206,860,176円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	31,677,555円	34,610,415円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,390,426円	17,092,551円
	ダイワつみたてインデックス外国債券	1,091,284,840円	1,613,655,804円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,766,018円	4,454,951円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,373,889円	1,621,436円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,265,840円	3,253,618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）	8,553,439円	462,884,174円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	126,818,187円	112,079,398円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	101,559,044円	29,164,889円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,578,350,089円	3,126,411,245円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	218,536,659円	196,547,666円
	ダイワ・インデックスセレクト外国債券	147,279,804円	156,992,713円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	46,689,867円	58,631,967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）	2,584,864,644円	2,520,728,659円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,608,313,372円	5,747,816,771円
	ダイワライフスタイル２５	29,864,070円	28,914,057円
	ダイワライフスタイル５０	59,547,724円	61,248,945円
	ダイワライフスタイル７５	15,513,027円	16,348,971円
計		75,518,465,344円	79,326,984,057円
2.	期末日における受益権の総数	75,518,465,344口	79,326,984,057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2022年6月7日 至2023年6月5日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月5日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

	これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年6月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△30,035,105,080	△2,884,416,101
合計	△30,035,105,080	△2,884,416,101

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	-	-	-	-	51,467,935	-	52,180,720	△712,785
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	51,467,935	-	52,180,720	△712,785
買建	1,117,565,949	-	1,139,314,410	21,748,461	1,064,544,748	-	1,072,212,041	7,667,293
アメリカ・ドル	584,094,960	-	595,870,248	11,775,288	87,960,550	-	88,587,707	627,157
イギリス・ポンド	-	-	-	-	9,014,278	-	9,022,317	8,039
オフショア・人民元	171,335,360	-	175,005,048	3,669,688	723,623,800	-	727,275,700	3,651,900
シンガポール・ドル	-	-	-	-	27,108,708	-	27,276,004	167,296
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	195,982,580	-	199,129,385	3,146,805
ユーロ	362,135,629	-	368,439,114	6,303,485	20,854,832	-	20,920,928	66,096

合計	1,117,565,949	-	1,139,314,410	21,748,461	1,116,012,683	-	1,124,392,761	6,954,508

（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）

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額	3.1492円	3.2369円
（1万口当たり純資産額）	(31,492円)	(32,369円)

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	893,834.100	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	772,306.610	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	786,169.260	

		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	820,428.840	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,651,762.460	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,278,911.760	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	965,529.180	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	586,129.840	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	561,957.630	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,010,575.130	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,178,753.920	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,146,496.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,287,790.900	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,106,576.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,782,673.640	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,087,246.960	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,533,944.490	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,390,297.260	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,441,958.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,471,535.510	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,281,829.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,430,950.410	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,166,475.420	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,320,858.310	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,343,462.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,296,095.620	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,927,171.740	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,031,059.120	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,997,510.280	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,108,679.210	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,005,212.560	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,970,361.800	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,671,131.280	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,705,416.390	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,325,285.340	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,493,064.640	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,982,019.160	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,530,202.480	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,549,785.950	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,455,275.700	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,545,955.470	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,562,483.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	555,464.510	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,547,666.280	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,419,647.240	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,191,370.760	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,167,301.790	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,980,960.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,026,230.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,950,836.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	822,770.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,420,508.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,970,972.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,026,816.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,681,640.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	3,300,000.000	3,196,875.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,320,224.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,514,730.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,899,740.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,163,335.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,924,140.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,409,800.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,124,955.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,005,550.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,374,280.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,076,352.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,692,844.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,035,802.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,508,012.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,614,464.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,521,050.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,800,124.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,267,088.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,205,160.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,841,366.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,439,879.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,898,630.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,381,951.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,706,410.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,420,825.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,475,872.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,425,925.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,424,850.000	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,565,061.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,719,177.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,900,550.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,440,960.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,182,814.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,400,525.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,956,601.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,391,725.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,374,350.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,824,439.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,596,112.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,665,628.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,832,120.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,374,770.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,622,200.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,294,905.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,336,600.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,143,849.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,319,360.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,571,072.000	

		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,819,440.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,311,700.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,868,330.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	954,190.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,769,360.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,528,463.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,335,625.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,843,740.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,857,440.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,312,400.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,385,975.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,610,104.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,333,350.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,944,055.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,669,030.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	270,303.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,895,072.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,322,500.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,410,496.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,500,792.000	

		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,496,366.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,099,616.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,112,144.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,245,850.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,053,470.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,759,700.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,970,315.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,046,750.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,112,768.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,438,880.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,317,950.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,847,743.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,218,050.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,032,190.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,647,560.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,436,640.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,195,185.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,014,538.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,633,400.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,447,320.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,175,608.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,415,266.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,636,206.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,325,050.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,315,400.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	907,810.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,065,920.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,864,028.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,895,338.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,523,200.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,402,500.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,420,049.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,716,260.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,536,680.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,643,800.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,464,252.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,085,235.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,296,620.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,718,848.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,932,574.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,525,280.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,985,344.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,901,260.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,398,400.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,542,350.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,221,095.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,837,790.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,523,250.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,655,016.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,604,504.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,387,340.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,332,400.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,352,100.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,497,350.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,074,450.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,372,850.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,157,420.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,887,100.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,243,095.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,316,700.000	

		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,307,226.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,933,040.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,275,980.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,352,080.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,638,280.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,950,064.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,076,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,506,400.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,633,480.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	943,940.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,989,032.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,508,118.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,842,351.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,790,021.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,949,450.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,494,000.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,629,750.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,753,900.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,769,720.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,734,050.000	

		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,895,030.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,703,777.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,900,430.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,109,950.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,342,500.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,845,650.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,864,700.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,381,380.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,650,260.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,899,640.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,937,760.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,871,400.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,917,710.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,913,270.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,879,931.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	976,920.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,433,675.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,788,545.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,386,044.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,820,620.000	

		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,876,069.800	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,138,878.400	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,805,587.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,418,750.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,363,465.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,257,358.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,466,890.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,505,550.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,509,450.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,392,622.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	992,480.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,020,490.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,911,988.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,506,405.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,775,702.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,028,590.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,983,740.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,506,975.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,994,000.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,491,200.000	

		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,478,300.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,486,050.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	5,015,500.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,496,880.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,974,140.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	990,030.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,908,550.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,480,505.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,861,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,500,000.000	1,465,770.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	4,290,075.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,636,249.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,495,140.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	1,011,260.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,015,030.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,529,000.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,960,250.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,782,000.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,657,487.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,977,560.000	

	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,947,500.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,966,560.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	985,780.000	
	3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,300,000.000	3,213,375.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,300,000.000	1,240,473.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	1,500,000.000	1,466,475.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,949,600.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,583,116.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,663,555.000	
アメリカ・ドル 小計			895,695,411.650 (125,558,582,805)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	873,393.510	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	836,222.960	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,347,507.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	992,516.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,052,555.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	979,210.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,254,293.700	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,323,375.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	491,202.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	713,053.000	

		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	450,372.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,236,045.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,766,259.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	719,676.300	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	998,010.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	507,450.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,346,310.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,329,504.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	442,442.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,119,042.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,842,975.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	984,520.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,062,080.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	885,474.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,022,285.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,327,704.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	571,515.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,679,230.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	670,670.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,793,024.000	

		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	303,178.600	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,973,800.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	931,000.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	100,000.000	92,926.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	388,816.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	600,000.000	528,540.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	300,000.000	279,450.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,034,647.250	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,274,585.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,481,553.280	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,360,488.180	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,414,808.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,659,595.280	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,319,610.640	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,233,971.200	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,134,811.240	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,673,888.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,296,062.150	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,420,203.360	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,602,447.600	

	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,097,020.820	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,545,491.540	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,375,553.120	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,560,442.500	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,165,861.620	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,066,425.360	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,318,214.280	
イギリス・ポンド 小計			68,151,308.990 (11,874,684,079)	
イスラエル・シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,932,030.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,906,448.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,179,595.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,681,200.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,270,232.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,110,564.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,004,768.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,490,608.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,259,564.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	181,628.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	851,922.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	244,932.000	

	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	460,026.000	
イスラエル・シュケル 小計			17,573,517.000 (657,658,999)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,084,372.550	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,338,212.360	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,785,162.280	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,417,369.640	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,786,997.880	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,100,267.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,180,809.150	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	724,695.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,626,103.600	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,115,377.520	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,042,840.880	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,449,060.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,817,806.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,688,070.700	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,161,789.800	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,427,490.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,211,624.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,281,032.000	

	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,662,720.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	851,802.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,478,848.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,027,075.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,091,688.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,359,568.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,225,458.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,207,392.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,077,923.000	
オーストラリア・ドル 小計			42,221,555.480 (3,903,805,020)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,329,792.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,207,450.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,210,750.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,146,350.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,298,920.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,245,520.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,208,130.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,501,035.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,332,280.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,334,440.000	

		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,070,625.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,147,420.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,175,051.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,180,530.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,547,140.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,151,392.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,544,145.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,057,450.000	
		3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,191,400.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,795,735.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,353,550.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,336,200.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,561,510.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,748,310.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,257,935.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,092,477.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,362,670.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,506,880.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,605,105.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,311,210.000	

		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,064,380.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,973,650.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,199,424.000	
		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	10,013,500.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,159,750.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,679,795.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,004,150.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,027,160.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,979,440.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,955,250.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,597,440.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	22,000,000.000	21,965,680.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,482,995.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,193,120.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,025,760.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,522,385.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,005,760.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,141,170.000	
		2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	5,010,950.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,151,000.000	

	2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,088,740.000	
	2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,216,150.000	
	2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	23,076,590.000	
	2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,131,550.000	
	2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,191,750.000	
	3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	7,000,000.000	7,139,020.000	
	2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,008,540.000	
	2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	15,000,000.000	14,973,000.000	
オフショア・人民元 小計			671,789,501.000 (13,233,043,948)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	547,041.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,111,782.830	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,353,770.490	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,209,846.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,006,902.050	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,004,417.980	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,374,637.950	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,236,484.340	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,113,690.400	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	907,032.450	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,126,391.200	

		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	609,940.500	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,897,250.300	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,151,924.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,347,892.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,018,784.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	664,440.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,667,614.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,635,640.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,902,222.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	275,406.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,982,718.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	951,440.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,924,218.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,018,544.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,828,995.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	190,162.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,355,640.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	94,033.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	387,256.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	195,654.000	

	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	975,890.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	724,215.800	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	352,368.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	200,052.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	296,727.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	585,642.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	575,784.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	297,039.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	365,352.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,188,828.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	493,040.000	
カナダ・ドル 小計			46,146,708.290 (4,816,331,944)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	784,352.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	916,446.700	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	808,191.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	410,384.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	592,992.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	624,062.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	514,494.640	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	719,304.000	

		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	436,275.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	706,500.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	543,372.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	335,244.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	482,220.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	703,125.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	545,400.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	181,792.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,940.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	235,099.200	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	262,350.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,750.000	
	シンガポール・ドル 小計			10,089,294.540 (1,046,461,629)	
	スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,129,199.700	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,521,556.350	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,794,936.600	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,657,362.500	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,284,226.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,797,184.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,201,500.000	

	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,898,700.000	
スウェーデン・クローナ 小計			38,284,665.150 (495,786,414)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,951,672.980	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,863,757.340	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,669,509.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,580,417.300	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,839,775.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	405,770.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	957,510.000	
デンマーク・クローネ 小計			38,268,411.620 (770,343,126)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	603,564.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	900,000.000	840,663.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	403,720.800	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	560,820.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	431,918.200	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	230,688.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	329,188.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	446,250.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	365,543.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	278,038.400	

	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	616,563.200	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	198,136.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	507,190.000	
ニュージーランド・ドル 小計			5,812,283.300 (493,230,361)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,237,304.150	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,132,678.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,211,257.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,296,405.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,513,356.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,205,136.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,973,845.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,538,687.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,454,625.000	
ノルウェー・クローネ 小計			30,563,293.850 (388,765,097)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,969,807.690	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,794,196.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,067,826.400	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,233,060.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,821,100.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,190,060.000	

		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,832,534.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	935,890.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,290,060.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	462,115.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	1,000,000.000	1,072,460.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,313,670.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,006,600.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	824,560.350	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,191,049.000	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,354,655.320	
	ポーランド・ズロチ 小計			35,359,644.260 (1,180,202,381)	
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,370,484.620	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,242,460.160	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,554,696.320	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,345,422.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	739,910.890	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,431,423.700	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,899,164.280	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,442,038.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,066,777.250	

		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,756,923.390	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,258,466.600	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,006,845.900	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,570,506.500	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,748.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,207,742.900	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,108,691.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,211,916.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,293,180.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,209,580.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	659,600.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,340,792.300	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,343,484.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	401,064.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,293,578.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,688,505.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,595,410.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,664,712.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,388,352.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	433,860.000	

	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	523,325.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	737,142.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,002,140.000	
マレーシア・リンギット 小計			44,351,942.810 (1,358,029,878)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,863,049.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,127,826.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,057,202.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,179,880.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	916,640.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	12,480,160.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,133,300.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,691,051.930	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,418,852.480	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,695,111.220	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,081,931.840	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,074,567.220	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	30,532,235.300	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,004,416.560	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,336,522.320	
メキシコ・ペソ 小計			268,592,745.870 (2,145,223,402)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	311,587.640	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	267,348.960	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	762,275.120	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	260,391.600	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	730,008.000	

		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	389,912.000	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	445,975.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	435,870.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	192,612.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	213,084.700	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	247,704.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	409,195.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	183,060.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	481,914.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	183,198.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	276,021.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	266,886.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	257,061.600	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	380,372.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	302,088.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,323,530.810	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,055,129.560	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	570,775.520	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	142,682.400	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,177,241.600	

		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	390,695.400	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,095,780.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,127,705.600	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	773,720.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	812,939.400	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	396,984.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	232,960.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	144,973.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	965,328.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	454,920.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	414,012.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	133,224.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	259,176.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,271,595.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	231,645.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	293,469.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	298,365.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,006,570.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,630,751.170	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,543,610.620	

		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	888,741.160	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,389,718.330	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	880,055.360	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	540,903.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,021,251.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,014,961.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	449,517.400	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	482,292.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,361,860.000	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	560,690.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,352,460.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	490,917.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,015,833.000	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	535,436.000	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,069,080.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,263,136.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	212,079.500	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	319,508.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	500,768.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	373,252.000	

		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	500,000.000	500,710.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	578,034.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	705,488.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,351,981.170	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,470,755.220	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,061,473.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,423,727.300	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,728,526.960	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,839,760.000	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,849,280.090	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,626,305.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,272,473.030	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,190,449.100	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,813,054.400	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,701,074.960	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,949,034.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,111,220.380	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,057,090.640	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,944,636.880	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,238,088.600	

		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,885,882.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,059,562.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,167,054.100	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,749,577.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,695,986.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,199,591.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,613,060.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,497,162.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,509,130.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,581,069.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,805,980.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,535,994.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,025,436.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	759,105.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,023,512.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,769,860.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	580,360.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,005,352.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	584,913.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,134,468.000	

		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,302,752.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,573,964.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,027,404.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	197,782.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	100,000.000	99,928.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,700,085.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,048,131.000	
		0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	97,183.000	
		0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	513,130.100	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,484,400.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,491,240.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	999,960.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,633,377.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,281,080.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,161,356.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,146.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,047,188.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,197,898.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	91,240.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,870,580.000	

		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	412,559.200	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	99,406.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,243,072.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,825,736.670	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,005,158.780	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,121,825.540	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,994,096.160	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,621,655.680	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,716,054.720	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,391,444.780	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,720,487.780	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,919,174.580	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,078,272.800	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,035,010.860	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,810,573.050	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,333,463.200	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,884,972.650	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,689,254.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,108,820.330	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,371,470.300	

		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	927,001.450	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,723,651.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,127,420.300	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,186,480.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,998,129.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,925,772.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,330,995.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,474,998.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,952,763.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,838,048.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,110,685.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,544,380.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,481,479.100	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,784,660.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,428,042.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,278,560.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	562,355.600	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	881,160.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,660,312.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,808,290.000	

		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,355,172.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,818,152.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,996,491.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,200,000.000	928,836.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	2,300,000.000	2,106,547.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,484,928.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	886,010.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	1,022,560.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	200,000.000	198,352.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	700,000.000	708,862.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	600,000.000	601,662.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,280,657.430	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,993,802.850	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,968,086.120	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,452,747.480	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,934,516.940	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,497,421.700	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,699,408.260	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,815,188.940	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,045,010.000	

		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,234,993.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,045,800.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	629,109.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,170,820.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	728,696.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	593,812.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,059,318.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	601,173.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	781,128.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,209.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	498,984.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	254,484.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	890,541.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,293,266.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,249,127.400	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,698,821.840	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,792,848.760	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,272,796.230	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,401,546.680	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,739,948.350	

		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,802,101.750	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,230,362.000	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,269,897.240	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,875,468.000	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	995,974.080	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	672,595.440	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,310,205.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,445,945.800	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,427,151.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,563,299.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,558,928.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,113,606.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,974,084.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,255,787.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,464,830.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,522,317.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,179,398.200	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,511,994.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,842,487.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,162,028.000	

		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,024,757.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,072,475.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,639,453.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,238,744.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,153,775.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,086,689.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,104,210.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,458,165.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,660,240.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,819,356.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,990,186.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,578,416.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,043,745.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,539,893.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	703,428.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	469,133.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,637,249.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,404,810.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,340,614.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,002,111.000	

		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	261,933.200	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	690,680.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,512,438.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	961,400.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,794,030.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,331,780.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	758,277.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	285,372.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	513,608.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	275,928.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	477,885.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	766,544.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,426,640.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	267,075.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	193,770.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	494,260.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	301,230.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,906,148.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	303,456.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,497,930.000	

		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	100,508.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	502,305.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	400,200.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	505,690.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	914,805.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,199,472.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	600,000.000	616,818.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,570,549.120	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,296,805.820	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,065,515.650	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,485,493.820	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,685,665.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,208,501.120	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,177,558.160	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,429,169.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,132,638.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,557,154.600	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,901,764.480	

		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,211,718.870	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,304,926.480	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,924,828.620	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,256,163.840	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,798,966.200	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,047,266.220	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	847,056.600	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	679,933.920	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,495,789.400	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	744,325.740	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,076,085.630	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	945,614.390	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	753,132.450	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,021,259.940	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	464,623.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	736,712.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	653,257.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	682,275.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	869,012.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	412,320.000	

		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	262,206.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	454,600.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	669,656.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	640,296.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	257,580.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	80,541.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	194,454.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	932,934.750	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,522,519.700	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	922,363.750	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	388,405.940	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	720,570.720	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	728,479.350	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	915,494.280	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	682,567.780	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	390,322.600	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	379,181.550	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,062,450.040	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,992,116.300	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,906,554.240	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,152,565.920	

		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,655,710.760	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,678,817.600	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,385,111.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,491,819.800	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,800,592.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,607,077.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,923,863.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,232,648.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,794,672.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,684,965.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,469,600.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,895,400.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,224,652.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,413,628.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,160,486.400	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,380,050.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	736,498.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,200,200.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,112,168.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	882,726.000	

		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	462,590.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,741,190.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	290,607.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	308,178.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,182,725.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,322,210.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,532,274.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	376,098.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	808,398.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,699,614.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	389,796.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	94,168.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	87,644.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,604,953.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	945,330.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,480,260.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	300,000.000	297,918.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	816,752.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,620,051.390	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,875,797.760	

		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,139,078.240	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,221,045.560	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,882,794.070	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,133,990.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,957,584.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,551,460.650	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,092,030.110	
	ユーロ 小計			556,951,632.680 (83,481,480,223)	
国債証券 合計				251,403,629,306 [251,403,629,306]	
合計				251,403,629,306 [251,403,629,306]	

（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	272銘柄	100%	49.8%
イギリス・ポンド	国債証券	57銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券	58銘柄	100%	5.3%
カナダ・ドル	国債証券	42銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券	13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	16銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	32銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	371銘柄	100%	33.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年6月6日現在 金　額（円）	2023年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	177,904,644	844,965,775
国債証券	35,229,597,110	40,102,905,890
地方債証券	1,551,709,500	2,693,837,873
特殊債券	728,556,800	932,153,700
社債券	1,309,558,300	2,865,361,500
未収利息	71,218,476	80,306,475
前払費用	2,314,767	6,011,813
流動資産合計	39,070,859,597	47,525,543,026
資産合計	39,070,859,597	47,525,543,026
負債の部		
流動負債		
未払金	-	711,652,000
未払解約金	6,213,295	12,361,571
流動負債合計	6,213,295	724,013,571
負債合計	6,213,295	724,013,571
純資産の部		
元本等		
元本　※1	30,891,408,853	37,438,102,323
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,173,237,449	9,363,427,132
元本等合計	39,064,646,302	46,801,529,455
純資産合計	39,064,646,302	46,801,529,455
負債純資産合計	39,070,859,597	47,525,543,026

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1. ※1 期首	2021年6月8日	2022年6月7日
期首元本額	23,909,728,537円	30,891,408,853円
期中追加設定元本額	7,623,028,057円	7,312,021,169円
期中一部解約元本額	641,347,741円	765,327,699円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,062,564,538円	2,049,608,556円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	3,752,378,284円	3,549,142,220円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,043,649,325円	5,344,516,746円
ダイワ・ライフ・バランス３０	9,160,967,844円	10,631,228,521円
ダイワ・ライフ・バランス５０	6,276,037,979円	7,613,146,325円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,047,426,696円	2,742,507,483円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,508,957,237円	1,722,613,826円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,168,296,723円	1,341,988,777円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	439,742,656円	528,570,997円
ダイワつみたてインデックス日本債券	996,737,189円	1,594,215,198円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	33,857,772円	41,786,183円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	13,464,116円	16,600,215円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	11,216,859円	16,691,466円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	224,519,255円	201,596,693円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	151,592,380円	43,889,117円
計	30,891,408,853円	37,438,102,323円
2. 期末日における受益権の総数	30,891,408,853口	37,438,102,323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2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△890,726,460	314,736,180
地方債証券	△16,542,500	4,709,005
特殊債券	△6,764,900	△807,900
社債券	△16,865,000	△18,115,100
合計	△930,898,860	300,522,185

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2646円 (12,646円)	1.2501円 (12,501円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	４３８　２年国債	20,000,000	20,031,000	
	４３９　２年国債	390,000,000	390,627,900	
	４４０　２年国債	200,000,000	200,334,000	
	４４１　２年国債	150,000,000	150,247,500	
	４４２　２年国債	200,000,000	200,322,000	
	４４４　２年国債	70,000,000	70,115,500	
	４４５　２年国債	110,000,000	110,182,600	
	４４６　２年国債	250,000,000	250,390,000	
	４４７　２年国債	90,000,000	90,138,600	
	１４１　５年国債	620,000,000	621,760,800	
	１４２　５年国債	320,000,000	320,985,600	
	１４３　５年国債	630,000,000	632,079,000	
	１４４　５年国債	650,000,000	652,385,500	
	１４５　５年国債	710,000,000	712,847,100	
	１４６　５年国債	400,000,000	401,780,000	
	１４７　５年国債	600,000,000	601,254,000	
	１４８　５年国債	430,000,000	430,847,100	
	１４９　５年国債	660,000,000	661,194,600	
	１５０　５年国債	330,000,000	330,465,300	
	１５１　５年国債	450,000,000	450,337,500	
	１５３　５年国債	270,000,000	270,000,000	
	１５４　５年国債	440,000,000	441,412,400	
	１５５　５年国債	90,000,000	91,018,800	
	１５６　５年国債	40,000,000	40,262,400	
	１５７　５年国債	60,000,000	60,314,400	
	１　４０年国債	30,000,000	37,816,500	
	２　４０年国債	48,000,000	58,313,280	
	３　４０年国債	19,000,000	23,061,630	
	４　４０年国債	54,000,000	65,593,800	
	５　４０年国債	61,000,000	71,517,010	
	６　４０年国債	68,000,000	78,358,440	

７　４０年国債	41,000,000	45,202,090	
８　４０年国債	40,000,000	40,991,600	
９　４０年国債	40,000,000	30,329,600	
１０　４０年国債	240,000,000	212,964,000	
１１　４０年国債	85,000,000	72,728,550	
１２　４０年国債	99,000,000	75,769,650	
１３　４０年国債	252,000,000	191,126,880	
１４　４０年国債	273,000,000	220,592,190	
１５　４０年国債	250,000,000	221,247,500	
１６　４０年国債	120,000,000	115,312,800	
３３５　１０年国債	210,000,000	211,682,100	
３３７　１０年国債	550,000,000	553,388,000	
３３８　１０年国債	80,000,000	80,693,600	
３３９　１０年国債	165,000,000	166,617,000	
３４０　１０年国債	190,000,000	192,069,100	
３４１　１０年国債	15,000,000	15,143,100	
３４２　１０年国債	140,000,000	140,663,600	
３４３　１０年国債	270,000,000	271,314,900	
３４４　１０年国債	90,000,000	90,444,600	
３４５　１０年国債	410,000,000	411,959,800	
３４６　１０年国債	250,000,000	251,087,500	
３４７　１０年国債	690,000,000	692,642,700	
３４８　１０年国債	430,000,000	431,380,300	
３４９　１０年国債	500,000,000	501,130,000	
３５０　１０年国債	400,000,000	400,284,000	
３５１　１０年国債	100,000,000	99,974,000	
３５２　１０年国債	500,000,000	499,470,000	
３５３　１０年国債	520,000,000	519,136,800	
３５４　１０年国債	280,000,000	279,274,800	
３５５　１０年国債	290,000,000	288,958,900	
３５６　１０年国債	290,000,000	288,645,700	
３５７　１０年国債	420,000,000	417,555,600	
３５８　１０年国債	480,000,000	476,625,600	
３５９　１０年国債	340,000,000	336,936,600	
３６０　１０年国債	460,000,000	454,733,000	
３６１　１０年国債	480,000,000	473,443,200	
３６２　１０年国債	450,000,000	442,813,500	
３６３　１０年国債	380,000,000	373,300,600	
３６４　１０年国債	350,000,000	343,224,000	

３６５　１０年国債	280,000,000	274,080,800	
３６６　１０年国債	290,000,000	285,925,500	
３６７　１０年国債	360,000,000	354,337,200	
３６８　１０年国債	400,000,000	393,184,000	
３６９　１０年国債	650,000,000	655,668,000	
３７０　１０年国債	80,000,000	80,525,600	
２　３０年国債	9,000,000	10,317,690	
３　３０年国債	4,000,000	4,572,920	
４　３０年国債	8,000,000	9,548,560	
５　３０年国債	8,000,000	9,180,720	
６　３０年国債	9,000,000	10,537,110	
７　３０年国債	12,000,000	14,037,480	
１０　３０年国債	25,000,000	26,597,750	
１１　３０年国債	9,000,000	10,095,030	
１２　３０年国債	11,000,000	12,784,970	
１３　３０年国債	11,000,000	12,690,040	
１４　３０年国債	22,000,000	26,331,800	
１５　３０年国債	21,000,000	25,420,080	
１６　３０年国債	26,000,000	31,540,340	
１７　３０年国債	17,000,000	20,468,170	
１８　３０年国債	20,000,000	23,900,400	
１９　３０年国債	15,000,000	17,953,650	
２０　３０年国債	16,000,000	19,557,920	
２１　３０年国債	16,000,000	19,205,600	
２２　３０年国債	17,000,000	20,847,950	
２３　３０年国債	16,000,000	19,652,160	
２４　３０年国債	15,000,000	18,451,200	
２５　３０年国債	17,000,000	20,516,110	
２６　３０年国債	32,000,000	39,060,480	
２７　３０年国債	32,000,000	39,585,600	
２８　３０年国債	34,000,000	42,143,680	
２９　３０年国債	43,000,000	52,768,310	
３０　３０年国債	56,000,000	68,011,440	
３１　３０年国債	76,000,000	91,268,400	
３２　３０年国債	45,000,000	54,705,600	
３３　３０年国債	95,000,000	111,133,850	
３４　３０年国債	110,000,000	132,228,800	
３５　３０年国債	120,000,000	140,509,200	
３６　３０年国債	138,000,000	161,742,900	

３７　３０年国債	165,000,000	190,398,450	
３８　３０年国債	250,000,000	283,737,500	
３９　３０年国債	105,000,000	121,077,600	
４０　３０年国債	80,000,000	90,795,200	
４１　３０年国債	80,000,000	89,313,600	
４２　３０年国債	85,000,000	94,912,700	
４３　３０年国債	95,000,000	106,096,950	
４４　３０年国債	105,000,000	117,181,050	
４５　３０年国債	105,000,000	113,200,500	
４６　３０年国債	115,000,000	123,955,050	
４７　３０年国債	125,000,000	137,058,750	
４８　３０年国債	145,000,000	153,198,300	
４９　３０年国債	120,000,000	126,730,800	
５０　３０年国債	110,000,000	102,862,100	
５１　３０年国債	155,000,000	129,006,500	
５２　３０年国債	120,000,000	104,424,000	
５３　３０年国債	95,000,000	84,382,800	
５４　３０年国債	118,000,000	109,467,420	
５５　３０年国債	140,000,000	129,551,800	
５６　３０年国債	120,000,000	110,763,600	
５７　３０年国債	105,000,000	96,671,400	
５８　３０年国債	165,000,000	151,522,800	
５９　３０年国債	110,000,000	98,368,600	
６０　３０年国債	100,000,000	93,454,000	
６１　３０年国債	95,000,000	84,313,450	
６２　３０年国債	110,000,000	92,469,300	
６３　３０年国債	110,000,000	89,694,000	
６４　３０年国債	90,000,000	73,125,900	
６５　３０年国債	125,000,000	101,301,250	
６６　３０年国債	145,000,000	116,865,650	
６７　３０年国債	140,000,000	118,729,800	
６８　３０年国債	120,000,000	101,443,200	
６９　３０年国債	131,000,000	113,562,590	
７０　３０年国債	166,000,000	143,616,560	
７１　３０年国債	75,000,000	64,820,250	
７２　３０年国債	203,000,000	175,089,530	
７３　３０年国債	120,000,000	103,396,800	
７４　３０年国債	155,000,000	144,501,850	
７５　３０年国債	160,000,000	160,507,200	

７６　３０年国債	120,000,000	123,330,000	
７７　３０年国債	150,000,000	161,325,000	
７８　３０年国債	57,000,000	58,601,130	
７２　２０年国債	53,000,000	54,520,570	
７５　２０年国債	14,000,000	14,547,260	
７６　２０年国債	25,000,000	25,887,750	
７８　２０年国債	17,000,000	17,687,140	
７９　２０年国債	14,000,000	14,594,440	
８１　２０年国債	65,000,000	68,094,000	
８２　２０年国債	28,000,000	29,397,200	
８５　２０年国債	31,000,000	32,877,980	
８６　２０年国債	6,000,000	6,396,960	
８７　２０年国債	35,000,000	37,217,950	
８８　２０年国債	33,000,000	35,370,390	
８９　２０年国債	15,000,000	16,031,850	
９２　２０年国債	60,000,000	64,539,600	
９３　２０年国債	18,000,000	19,373,940	
９４　２０年国債	45,000,000	48,605,400	
９５　２０年国債	30,000,000	32,779,800	
９６　２０年国債	63,000,000	68,328,540	
９７　２０年国債	25,000,000	27,330,250	
９８　２０年国債	64,000,000	69,691,520	
９９　２０年国債	53,000,000	57,921,050	
１００　２０年国債	35,000,000	38,537,800	
１０１　２０年国債	18,000,000	19,990,980	
１０２　２０年国債	10,000,000	11,153,000	
１０３　２０年国債	21,000,000	23,315,880	
１０４　２０年国債	64,000,000	70,416,640	
１０５　２０年国債	38,000,000	41,966,060	
１０６　２０年国債	16,000,000	17,754,080	
１０７　２０年国債	40,000,000	44,346,000	
１０８　２０年国債	68,000,000	74,640,200	
１０９　２０年国債	60,000,000	66,061,200	
１１０　２０年国債	27,000,000	30,037,500	
１１１　２０年国債	35,000,000	39,293,450	
１１２　２０年国債	40,000,000	44,667,600	
１１３　２０年国債	70,000,000	78,432,200	
１１４　２０年国債	45,000,000	50,584,500	
１１５　２０年国債	42,000,000	47,483,520	

１１６　２０年国債	27,000,000	30,625,560	
１１７　２０年国債	77,000,000	86,824,430	
１１８　２０年国債	13,000,000	14,603,810	
１１９　２０年国債	23,000,000	25,518,730	
１２０　２０年国債	98,000,000	107,372,720	
１２３　２０年国債	42,000,000	47,679,240	
１２４　２０年国債	100,000,000	112,783,000	
１２５　２０年国債	25,000,000	28,635,750	
１２６　２０年国債	21,000,000	23,734,200	
１２７　２０年国債	110,000,000	123,484,900	
１２８　２０年国債	32,000,000	36,004,480	
１２９　２０年国債	95,000,000	106,142,550	
１３０　２０年国債	110,000,000	123,147,200	
１３１　２０年国債	150,000,000	166,717,500	
１３２　２０年国債	25,000,000	27,833,000	
１３３　２０年国債	150,000,000	168,243,000	
１３４　２０年国債	15,000,000	16,861,050	
１３５　２０年国債	20,000,000	22,311,000	
１３６　２０年国債	180,000,000	199,263,600	
１３７　２０年国債	18,000,000	20,111,220	
１３９　２０年国債	250,000,000	277,135,000	
１４０　２０年国債	100,000,000	111,895,000	
１４１　２０年国債	140,000,000	156,795,800	
１４２　２０年国債	210,000,000	237,123,600	
１４３　２０年国債	100,000,000	111,144,000	
１４４　２０年国債	50,000,000	55,101,500	
１４５　２０年国債	40,000,000	44,866,800	
１４６　２０年国債	240,000,000	269,371,200	
１４７　２０年国債	240,000,000	267,098,400	
１４８　２０年国債	220,000,000	242,638,000	
１４９　２０年国債	240,000,000	264,828,000	
１５０　２０年国債	225,000,000	245,853,000	
１５１　２０年国債	260,000,000	278,337,800	
１５２　２０年国債	215,000,000	230,086,550	
１５３　２０年国債	275,000,000	297,277,750	
１５４　２０年国債	230,000,000	245,794,100	
１５５　２０年国債	220,000,000	229,726,200	
１５６　２０年国債	220,000,000	213,254,800	
１５７　２０年国債	310,000,000	292,001,400	

	１５８　２０年国債	225,000,000	219,793,500	
	１５９　２０年国債	220,000,000	217,278,600	
	１６０　２０年国債	240,000,000	239,546,400	
	１６１　２０年国債	200,000,000	196,564,000	
	１６２　２０年国債	220,000,000	215,600,000	
	１６３　２０年国債	160,000,000	156,340,800	
	１６４　２０年国債	260,000,000	249,849,600	
	１６５　２０年国債	155,000,000	148,459,000	
	１６６　２０年国債	320,000,000	314,780,800	
	１６７　２０年国債	160,000,000	152,312,000	
	１６８　２０年国債	250,000,000	233,527,500	
	１６９　２０年国債	155,000,000	141,964,500	
	１７０　２０年国債	175,000,000	159,741,750	
	１７１　２０年国債	140,000,000	127,264,200	
	１７２　２０年国債	215,000,000	198,023,600	
	１７３　２０年国債	200,000,000	183,598,000	
	１７４　２０年国債	270,000,000	247,028,400	
	１７５　２０年国債	165,000,000	153,144,750	
	１７６　２０年国債	185,000,000	171,160,150	
	１７７　２０年国債	180,000,000	163,121,400	
	１７８　２０年国債	335,000,000	308,384,250	
	１７９　２０年国債	190,000,000	174,458,000	
	１８０　２０年国債	160,000,000	154,694,400	
	１８１　２０年国債	160,000,000	157,188,800	
	１８２　２０年国債	168,000,000	170,441,040	
	１８３　２０年国債	190,000,000	202,422,200	
	１８４　２０年国債	135,000,000	136,440,450	
	１　フイリピン共和国	100,000,000	98,914,100	
国債証券　合計			40,102,905,890	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	100,814,200	
	７９７　東京都公債	100,000,000	98,224,200	
	３２　東京都５年	100,000,000	99,951,000	
	２７－１５　北海道公債	100,000,000	100,402,500	
	３－５　北海道公債	100,000,000	96,934,300	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,960,800	
	４０１　大阪府公債	100,000,000	100,972,700	
	４５７　大阪府公債	100,000,000	97,758,000	
	３　兵庫県公債１２年	100,000,000	100,944,700	

	１１兵庫県公債２０年	100,000,000	109,897,200	
	２８－１　静岡県公債	100,000,000	100,058,400	
	２４－１　広島県２０年	100,000,000	110,053,100	
	１　埼玉県１５年	100,000,000	103,843,200	
	９　埼玉県２０年	100,000,000	112,124,800	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	103,962,100	
	２９－６　千葉県公債	100,000,000	100,147,000	
	３０－３　新潟県公債	134,160,000	133,084,573	
	３－１　茨城県公債	100,000,000	97,092,000	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,337,600	
	３－３　堺市公債	100,000,000	96,572,000	
	４－３　長崎県公債	100,000,000	98,282,100	
	２７－１　滋賀県公債	100,000,000	101,022,400	
	２－１　静岡市公債	100,000,000	97,755,500	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	111,539,800	
	１０　京都市２０年	100,000,000	110,513,200	
	６　札幌市２０年	100,000,000	111,590,500	
地方債証券　合計			2,693,837,873	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	104,014,900	
	８１　政保道路機構	100,000,000	111,055,400	
	２４１　政保道路機構	100,000,000	100,845,200	
	２６１　政保道路機構	100,000,000	100,940,700	
	３　地方公共団１５年	100,000,000	104,958,000	
	Ｆ２３１地方公共団体	100,000,000	105,079,600	
	６５　地方公共団体	100,000,000	100,673,100	
	１２７　都市再生	100,000,000	99,800,300	
	８０　住宅支援機構	100,000,000	104,786,500	
特殊債券　合計			932,153,700	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,779,600	
	２５　西日本高速道	100,000,000	100,707,200	
	２２　積水ハウス	100,000,000	99,882,200	
	１１サントリーホールデイング	100,000,000	99,878,200	
	１１　ヒユーリツク	100,000,000	100,052,900	
	２９　東急不動産ＨＤ	100,000,000	99,878,100	
	１４　セブンアンドアイ	100,000,000	99,835,900	
	１８　楽天グループ	100,000,000	73,389,300	
	１６　クボタ	100,000,000	100,392,000	
	１７　パナソニツク	100,000,000	100,308,500	
	３１　トヨタ自動車	100,000,000	99,793,800	

	６　楽天カード	100,000,000	92,012,300	
	２６　りそなホールデイン	100,000,000	99,887,400	
	３６　芙蓉総合リース	100,000,000	99,978,900	
	５　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,296,600	
	８１　ホンダファイナンス	100,000,000	99,876,500	
	４２　リコーリース	100,000,000	99,933,600	
	１　ＳＯＭＰＯＨＤ	100,000,000	99,880,600	
	７　三井住友海上	100,000,000	99,669,400	
	８２　三井不動産	100,000,000	99,882,200	
	８０　三菱地所	100,000,000	107,744,200	
	１４３　三菱地所	100,000,000	100,516,500	
	９　ソフトバンク	100,000,000	98,244,500	
	４９７　関西電力	100,000,000	101,574,500	
	４４８　中国電力	100,000,000	99,970,700	
	４８９　九州電力	100,000,000	98,558,200	
	１６　ＪＥＲＡ	100,000,000	100,730,400	
	６５　東京瓦斯	100,000,000	96,829,600	
	５０　大阪瓦斯	100,000,000	99,877,700	
社債券　合計			2,865,361,500	
合計			46,594,258,963	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月6日から2023年12月5日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス７０

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2023年12月5日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	138,626,477
親投資信託受益証券	21,387,821,349
未収入金	5,894,000
流動資産合計	21,532,341,826
資産合計	21,532,341,826
負債の部	
流動負債	
未払解約金	34,343,736
未払受託者報酬	3,238,300
未払委託者報酬	20,509,514
その他未払費用	809,489
流動負債合計	58,901,039
負債合計	58,901,039
純資産の部	
元本等	
元本	※1 7,310,605,309
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	14,162,835,478
（分配準備積立金）	3,578,832,378
元本等合計	21,473,440,787
純資産合計	21,473,440,787
負債純資産合計	21,532,341,826

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2023年6月6日 至　2023年12月5日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,117,885,014
営業収益合計	1,117,885,014
営業費用	
支払利息	20,543
受託者報酬	3,238,300
委託者報酬	20,509,514
その他費用	809,489
営業費用合計	24,577,846
営業利益又は営業損失（△）	1,093,307,168
経常利益又は経常損失（△）	1,093,307,168
中間純利益又は中間純損失（△）	1,093,307,168
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	34,663,298
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,272,038,913
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,567,434,116
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,567,434,116
剰余金減少額又は欠損金増加額	735,281,421
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	735,281,421
中間剰余金又は中間欠損金（△）	14,162,835,478

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当中間計算期間 自2023年6月6日 至2023年12月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	当中間計算期間末 2023年12月5日現在
1．　※1 期首元本額	6,358,044,062円
期中追加設定元本額	1,365,432,873円
期中一部解約元本額	412,871,626円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	7,310,605,309口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	当中間計算期間 自2023年6月6日 至2023年12月5日
	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月5日現在
1．　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

	これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月5日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2023年12月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9373円 (29,373円)

（参考）

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2023年12月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		12,351,531,255
株式	※2※3	274,720,226,710
未収入金		97,639,700
未収配当金		754,104,833
未収利息		660,476

その他未収収益	※4	6,549,586
差入委託証拠金		7,921,151
流動資産合計		287,938,633,711
資産合計		287,938,633,711
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		9,611,050
前受金		96,780,000
未払金		17,328,200
未払解約金		854,504,890
受入担保金		7,238,344,311
流動負債合計		8,216,568,451
負債合計		8,216,568,451
純資産の部		
元本等		
元本	※1	166,422,515,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		113,299,550,188
元本等合計		279,722,065,260
純資産合計		279,722,065,260
負債純資産合計		287,938,633,711

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2023年6月6日 至2023年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月5日現在
1.　※1 期首	2023年6月6日
期首元本額	154,707,449,700円
期中追加設定元本額	19,345,720,651円
期中一部解約元本額	7,630,655,279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	2,801,751,934円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,349,200,893円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	911,273円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	15,019,052円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	192,250,160円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	13,126,071円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	409,017,693円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	334,558,120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）	679,461,245円
Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス	13,683,461円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	250,892,420円
ｉＦｒｅｅ　ＴＯＰＩＸインデックス	7,280,005,929円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	4,607,390,202円
ｉＦｒｅｅ　年金バランス	999,592,602円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	638,850円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	70,750,314,109円

	ダイワ・ライフ・バランス３０	3,130,739,193円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	4,933,334,764円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	5,659,272,182円
	年金ダイワ日本株式インデックス	7,354,925,170円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	55,176,028円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	76,206,904円
	ダイワつみたてインデックス日本株式	4,787,553,654円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,445,814円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	11,685,906円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	29,768,814円
	ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	11,448,730,933円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	54,371,807円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	20,876,356円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,779,620,810円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	350,930,093円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	51,746,439円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	73,719,521円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	237,244,091円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	12,128,882,646円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	5,876,095,328円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,348,064,514円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,167,658,269円
	ダイワライフスタイル２５	107,308,072円
	ダイワライフスタイル５０	483,465,716円
	ダイワライフスタイル７５	404,428,524円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,140,449,510円
計		166,422,515,072円
2.	期末日における受益権の総数	166,422,515,072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　6,829,317,670円

4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　1,183,810,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2023年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買建	4,945,840,000	-	4,936,345,000	△9,495,000
合計	4,945,840,000	-	4,936,345,000	△9,495,000

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年12月5日現在
1口当たり純資産額	1.6808円
（1万口当たり純資産額）	(16,808円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,414,507,781
コール・ローン	9,729,761,967
株式	390,232,325,529
投資証券	8,501,333,670
派生商品評価勘定	706,428,001
未収入金	87,375,060
未収配当金	536,003,444
差入委託証拠金	7,799,110,489
流動資産合計	419,006,845,941
資産合計	419,006,845,941
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,388,107
未払金	279,763,719
未払解約金	575,527,000

流動負債合計		925,678,826
負債合計		925,678,826
純資産の部		
元本等		
元本	※1	78,782,685,463
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		339,298,481,652
元本等合計		418,081,167,115
純資産合計		418,081,167,115
負債純資産合計		419,006,845,941

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2023年6月6日 至2023年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023年12月5日現在
1. ※1 期首	2023年6月6日
期首元本額	73,305,284,321円
期中追加設定元本額	7,531,220,417円
期中一部解約元本額	2,053,819,275円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	252,159,607円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,398,033円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	27,113,381円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,173,336円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	131,811,172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）	102,286,592円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	90,561,111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）	731,492,283円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	4,494,733,779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）	564,169,530円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	20,923,332円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	53,313,694円

	ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	7,612,759,721円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,484,945,225円
	ｉＦｒｅｅ 年金バランス	321,035,811円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,052,677円
	ＤＣダイワ外国株式インデックス	47,549,251,480円
	ダイワ・ライフ・バランス３０	507,111,516円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	1,075,299,438円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	1,028,299,491円
	大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	2,017,055,591円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,568,923円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	13,068,453円
	ダイワつみたてインデックス外国株式	2,129,678,498円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,057,594円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,504,278円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,293,680円
	ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	11,618,359円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	52,676,509円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	33,932,785円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	910,373,309円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	48,117,622円
	ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	140,584,660円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,398,852,149円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	431,373,322円
	ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,324,047,271円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,022,029,754円
	ダイワライフスタイル２５	8,618,923円
	ダイワライフスタイル５０	39,067,351円
	ダイワライフスタイル７５	32,621,224円
	ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	89,653,999円
計		78,782,685,463円
2.	期末日における受益権の総数	78,782,685,463口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2023年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	18,577,271,170	-	19,256,655,104	679,383,934
合計	18,577,271,170	-	19,256,655,104	679,383,934

（注）　1．　時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2023年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	9,103,193,530	-	9,059,849,490	△43,344,040
アメリカ・ドル	5,287,986,000	-	5,265,381,600	△22,604,400
イギリス・ポンド	278,640,900	-	277,442,400	△1,198,500
オーストラリア・ドル	612,777,690	-	610,561,350	△2,216,340
カナダ・ドル	944,137,920	-	940,096,770	△4,041,150
スイス・フラン	776,370,520	-	775,144,620	△1,225,900
ユーロ	1,203,280,500	-	1,191,222,750	△12,057,750
合計	9,103,193,530	-	9,059,849,490	△43,344,040

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年12月5日現在
１口当たり純資産額	5.3068円
（1万口当たり純資産額）	(53,068円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,082,456,148
コール・ローン	1,424,513,974
国債証券	276,320,079,929
派生商品評価勘定	4,395
未収入金	43,204,333
未収利息	1,892,542,980
前払費用	76,724,407
流動資産合計	288,839,526,166
資産合計	288,839,526,166
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,137,287
未払金	5,742,876,764
未払解約金	326,661,323
流動負債合計	6,076,675,374
負債合計	6,076,675,374
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	82,578,920,852
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	200,183,929,940
元本等合計	282,762,850,792
純資産合計	282,762,850,792
負債純資産合計	288,839,526,166

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2023年6月6日 至2023年12月5日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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	2023年12月5日現在
1．　※1 期首	2023年6月6日

期首元本額	79,326,984,057円
期中追加設定元本額	6,194,292,139円
期中一部解約元本額	2,942,355,344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	391,220,587円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	7,319,300円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	40,271,896円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	15,003,665円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	203,109,383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）	569,147,604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）	789,537,760円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	3,678,762,630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）	846,963,929円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	2,551,780円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	19,850,729円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,158,748,213円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,278,798,652円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	496,915,006円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	317,728円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51,432,449,750円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,155,771,303円
ダイワ・ライフ・バランス５０	815,278,955円
ダイワ・ライフ・バランス７０	624,369,470円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	691,324,270円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	547,435,066円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	218,542,112円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	37,083,440円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	18,926,484円

ダイワつみたてインデックス外国債券	1,954,094,615円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,614,349円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,938,861円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,291,011円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	1,109,516,318円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	93,247,794円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	25,462,305円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,818,521,908円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	174,697,159円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	160,248,328円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	66,707,729円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	3,204,755,855円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,819,566,379円
ダイワライフスタイル２５	26,707,798円
ダイワライフスタイル５０	59,336,674円
ダイワライフスタイル７５	16,514,057円
計	82,578,920,852円
2. 期末日における受益権の総数	82,578,920,852口

〔金融商品に関する注記〕

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

〔デリバティブ取引に関する注記〕

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	271,760,551	-	272,064,759	△304,208
アメリカ・ドル	153,317,186	-	153,556,452	△239,266
イギリス・ポンド	16,921,049	-	16,920,803	246
ユーロ	101,522,316	-	101,587,504	△65,188
買建	1,166,271,232	-	1,159,442,548	△6,828,684
オフショア・人民元	1,046,331,594	-	1,040,423,296	△5,908,298
シンガポール・ドル	19,520,002	-	19,393,659	△126,343
ニュージーランド・ドル	25,779,248	-	25,636,396	△142,852
ポーランド・ズロチ	27,875,525	-	27,717,861	△157,664
メキシコ・ペソ	46,764,863	-	46,271,336	△493,527
合計	1,438,031,783	-	1,431,507,307	△7,132,892

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年12月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4242円 (34,242円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	229,467,217
国債証券	45,355,505,670
地方債証券	3,069,426,206
特殊債券	1,217,409,602
社債券	3,367,641,700
未収利息	94,651,120
前払費用	6,004,638
流動資産合計	53,340,106,153
資産合計	53,340,106,153
負債の部	
流動負債	
未払金	76,125,100
未払解約金	8,536,327
流動負債合計	84,661,427
負債合計	84,661,427
純資産の部	

元本等		
元本	※1	43,528,908,846
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		9,726,535,880
元本等合計		53,255,444,726
純資産合計		53,255,444,726
負債純資産合計		53,340,106,153

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2023年6月6日 至2023年12月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023年12月5日現在
1. ※1 期首	2023年6月6日
期首元本額	37,438,102,323円
期中追加設定元本額	6,477,246,121円
期中一部解約元本額	386,439,598円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,739,976,867円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	3,347,618,845円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	6,406,892,737円
ダイワ・ライフ・バランス３０	11,865,664,640円
ダイワ・ライフ・バランス５０	9,149,546,602円

ダイワ・ライフ・バランス７０	3,498,791,164円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,935,614,120円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,533,939,496円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	611,890,674円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,124,447,733円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	47,539,298円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	21,830,871円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	18,604,243円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	184,289,943円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	42,261,613円
計	43,528,908,846円
2.　期末日における受益権の総数	43,528,908,846口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年12月5日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2023年12月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2235円 (12,235円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	21,867,770,212円
Ⅱ	負債総額	12,325,609円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,855,444,603円
Ⅳ	発行済数量	7,373,643,449口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9640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

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	294,653,571,073円
Ⅱ	負債総額	7,718,688,250円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	286,934,882,823円
Ⅳ	発行済数量	168,766,987,274口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7002円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	53,648,651,741円
Ⅱ	負債総額	46,972,678円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,601,679,063円
Ⅳ	発行済数量	43,649,301,271口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2280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

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	427,502,403,105円
Ⅱ	負債総額	418,376,345円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	427,084,026,760円
Ⅳ	発行済数量	79,513,676,221口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.3712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

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	285,357,344,043円
Ⅱ	負債総額	581,926,437円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	284,775,417,606円
Ⅳ	発行済数量	82,919,285,917口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4344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

2023年12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。

2023年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	90	293,196
追加型株式投資信託	790	25,470,735
株式投資信託　　合計	880	25,763,932
単位型公社債投資信託	101	170,879
追加型公社債投資信託	14	1,533,421
公社債投資信託　合計	115	1,704,299
総合計	995	27,468,231

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64期事業年度（2022年４月１日から2023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65期事業年度に係る中間会計期間（2023年４月１日から2023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 （2022年３月31日）		当事業年度 （2023年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,168		1,982
有価証券		486		346
前払費用		332		393
未収委託者報酬		13,811		12,525
未収収益		52		47
関係会社短期貸付金		24,900		22,100
その他		45		59
流動資産計		42,799		37,455
固定資産				
有形固定資産	※1	203	※1	196
建物		4		3
器具備品		198		193
無形固定資産		1,770		1,482
ソフトウェア		1,738		1,351
ソフトウェア仮勘定		31		131
投資その他の資産		16,617		13,824

投資有価証券	10,755	8,260
関係会社株式	3,705	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,067	1,066
繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	65	101
未払金	9,856	5,874
未払収益分配金	26	38
未払償還金	12	12
未払手数料	4,917	4,525
その他未払金	※2 4,900	※2 1,297
未払費用	4,246	3,987
未払法人税等	980	560
未払消費税等	1,016	327
賞与引当金	866	692
その他	2	2
流動負債計	17,033	11,545
固定負債		
退職給付引当金	2,399	2,276
役員退職慰労引当金	13	51
その他	1	0
固定負債計	2,415	2,329
負債合計	19,449	13,874
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	13,925	11,505
利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692

福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	327	286
有価証券償還益	40	150
その他	264	171
営業外収益計	631	608
営業外費用		
投資有価証券売却損	59	244
有価証券償還損	0	2
その他	34	31
営業外費用計	93	277
経常利益	19,089	15,642
特別損失		
関係会社整理損失	-	229
投資有価証券評価損	331	257
特別損失計	331	486
税引前当期純利益	18,757	15,155
法人税、住民税及び事業税	5,950	4,589
法人税等調整額	69	248
法人税等合計	6,019	4,838
当期純利益	12,738	10,317

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

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　　15～18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。

（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）

（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。）を当事業年度の期首から適用し、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。この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-３項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（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 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）

建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

※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 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
未払金	4,694百万円	1,178百万円

３　保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2023年３月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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
③１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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2022年６月23日定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年３月31日	2022年６月24日

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

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

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

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド

運用に関係する業務を委託したこと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。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（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
有価証券及び投資有価証券	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

当事業年度（2023年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	－	7,939
資産合計	57	7,882	－	7,939

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,448
関連会社株式	2,027	2,027

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（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。

当事業年度（2023年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,448百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（2023年３月31日）

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

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	2,359	296	244
合計	2,359	296	244

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について331百万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257百万円、関係会社株式について229百万円の減損処理を行っております。

（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　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,452百万円	2,399百万円
勤務費用	152	150
退職給付の支払額	△ 303	△ 322
その他	98	48
退職給付債務の期末残高	2,399	2,276

(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　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,399百万円	2,276百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,399	2,276
退職給付引当金	2,399	2,276
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,399	2,276

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
勤務費用	152百万円	150百万円
その他	67	153
確定給付制度に係る退職給付費用	219	303

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度189百万円、当事業年度184百万円であります。

（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 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	734	697
賞与引当金	227	182
投資有価証券評価損	144	177
関係会社株式評価損	－	155
未払事業税	213	114
出資金評価損	94	94
システム関連費用	111	68
その他	437	309
繰延税金資産小計	1,963	1,799
評価性引当額	△ 356	△ 459
繰延税金資産合計	1,607	1,339
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 562	△ 356
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 722	△ 515
繰延税金資産の純額	885	824

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（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。

当事業年度（2023年３月31日）

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が69,845百万円、その他559百万円であります。

（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　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

[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　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。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(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）	17,100 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	22,100 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　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。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	2,112	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（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　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。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	13,072 1,062	未払手数料 長期差入保証金	2,663 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) ソフトウェアの購入については、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　2021年４月１日　至　2022年３月31日）	当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１株当たり純資産額　16,078.50円	１株当たり純資産額　14,983.42円
１株当たり当期純利益　4,883.43円	１株当たり当期純利益　3,955.35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　2021年４月１日　至　2022年３月31日）	当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

当期純利益（百万円）	12,738	10,317
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 （2023年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		2,879
有価証券		110
未収委託者報酬		14,148
関係会社短期貸付金		17,800
その他		629
流動資産合計		35,568
固定資産		
有形固定資産	※１	184
無形固定資産		
ソフトウエア		1,009
その他		203
無形固定資産合計		1,213
投資その他の資産		
投資有価証券		8,477
関係会社株式		3,475
繰延税金資産		628
その他		1,216
投資その他の資産合計		13,797
固定資産合計		15,196
資産合計		50,764

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2023年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		5,255
未払費用		4,567
未払法人税等		2,453
賞与引当金		727
その他	※２	725
流動負債合計		13,864
固定負債		
退職給付引当金		2,228
役員退職慰労引当金		58
固定負債合計		2,287
負債合計		16,152
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		6,594
利益剰余金合計		6,968
株主資本合計		33,638
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		973
評価・換算差額等合計		973
純資産合計		34,612
負債・純資産合計		50,764

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （自　2023年４月１日 至　2023年９月30日）
営業収益	
委託者報酬	36,557

その他営業収益		322
営業収益合計		36,879
営業費用		
支払手数料		15,250
その他営業費用		7,380
営業費用合計		22,631
一般管理費	※１	6,087
営業利益		8,160
営業外収益	※２	128
営業外費用	※３	116
経常利益		8,172
特別利益		―
特別損失	※４	258
税引前中間純利益		7,914
法人税、住民税及び事業税		2,505
法人税等調整額		2
中間純利益		5,405

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2023年４月１日 至　2023年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,316	△10,316	△10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-

当中間期変動額合計	-	-	-	△4,910	△4,910	△4,910
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,594	6,594	33,638

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,316
中間純利益	-	-	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	438	438	438
当中間期変動額合計	438	438	△4,472
当中間期末残高	973	973	34,612

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。

５．グループ通算制度の適用

当社は、株式会社大和証券グループ本社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2023年９月30日現在）
有形固定資産	340百万円

※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（2023年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,299百万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　2023年４月　１日 至　2023年９月30日）
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2023年４月　１日 至　2023年９月30日）
投資有価証券売却益	35百万円
有価証券償還益	32百万円
雑収入	32百万円
受取配当金	25百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2023年４月　１日 至　2023年９月30日）
有価証券償還損	103百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2023年４月　１日 至　2023年９月30日）
ソフトウェア除却損	153百万円
投資有価証券評価損	104百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023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
2023年６月26日定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年３月31日	2023年６月27日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2023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	111	7,809	－	7,921
資産合計	111	7,809	－	7,921

（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。

（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	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2023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　1,448百万円）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	111	55	56
（２）その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
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	2,297	2,623	△325
小計	2,297	2,623	△325
合計	7,921	6,518	1,403

（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36,557百万円、その他322百万円であります。

（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　2023年４月１日　至　2023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　2023年４月１日　至　2023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　2023年４月１日　至　2023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　2023年４月１日　至　2023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　2023年４月１日　至　2023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　2023年４月１日 至　2023年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,268.89円
１株当たり中間純利益	2,072.34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　2023年４月１日 至　2023年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
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

提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。

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 (2023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）	
	あかつき証券株式会社	3,067百万円	（注1）	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	（注1）	
	ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	（注1）	
	株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	（注1）	
	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	（注1）	
	岡三証券株式会社	5,000百万円	（注1）	
	きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	第四北越証券株式会社	600百万円	（注1）	
	大和コネクト証券株式会社	7,500百万円	（注1）	
	播陽証券株式会社	112百万円	（注1）	
	松井証券株式会社	11,945百万円	（注1）	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	（注1）	
	楽天証券株式会社	19,495百万円	（注1）	
	リテラ・クレア証券株式会社	3,794百万円	（注1）	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	（注1）	
	損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	株式会社北九州銀行	10,000百万円	（注3）	
	株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	（注3）	
	株式会社高知銀行	22,944百万円	（注3）	
	株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	（注3）	
	株式会社清水銀行	10,816百万円	（注3）	
	信金中央金庫	690,998百万円	（注4）	(*1)
	スルガ銀行株式会社	30,043百万円	（注3）	
	株式会社東北銀行	13,233百万円	（注3）	
	株式会社富山銀行	6,730百万円	（注3）	
	日本生命保険相互会社	1,450,000百万円	（注9）	
	PayPay銀行株式会社	72,216百万円	（注3）	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
	株式会社宮崎太陽銀行	8,752百万円	（注3）	
	株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	（注3）	
	株式会社もみじ銀行	10,000百万円	（注3）	
	株式会社山形銀行	12,008百万円	（注3）	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	（注3）	
	株式会社りそな銀行	279,928百万円	（注6）	

（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。
（*1）出資金を記載しています。

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】

委託会社は、播陽証券株式会社の株式を6,500株所有しています。
委託会社は、リテラ・クレア証券株式会社の株式を615,736株所有しています。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について
・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
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

2023年５月26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2023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。

独立監査人の監査報告書

2023年7月14日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	秋山　範之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス７０の2022年6月7日から2023年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス７０の2023年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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2023年４月１日から2024年３月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年４月１日から2023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2023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（2023年４月１日から2023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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年2月2日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	秋山　範之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス７０の2023年6月6日から2023年12月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス７０の2023年12月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月6日から2023年12月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

(注) 1．　上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。