【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2024年3月11日提出
【計算期間】	第8計算期間 （自　2022年12月20日　至　2023年12月18日）
【ファンド名】	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル（含む日本）	ファミリーファンド	あり（　　）
一般	年2回	日本		
大型株	年4回	北米		
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	ファンド・オブ・ファンズ	なし
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 資産配分変更型）（株式、債券、不動産投信））				
資産複合（　　）				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

（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、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

●当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2050年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減（ぜんげん）させ、債券の組入れを漸増（ぜんぞう）させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2050年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

〈2023年12月時点の基本配分比率〉

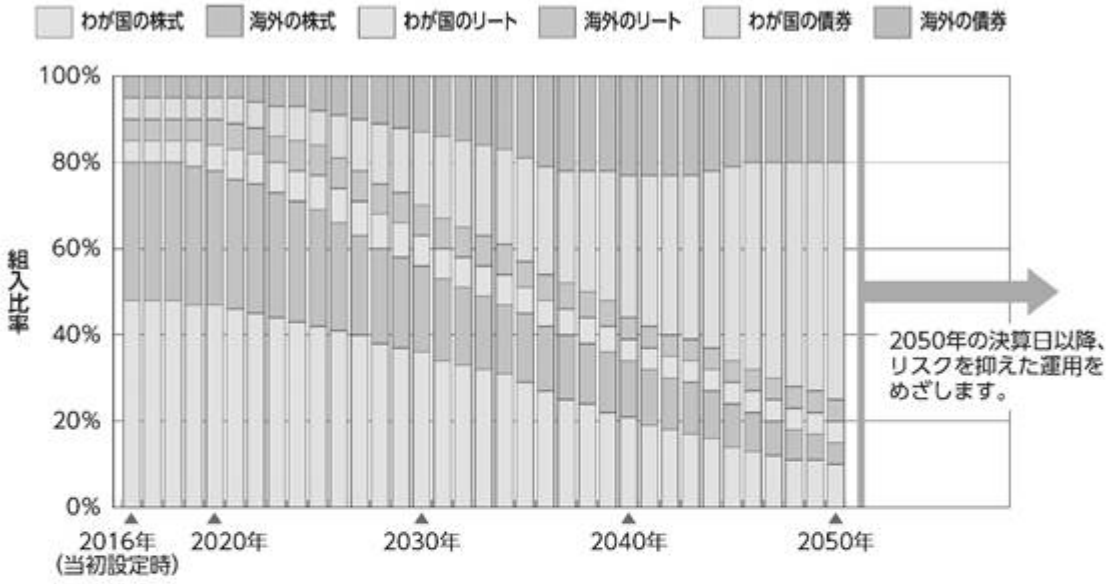
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	44%	29%	7%	6%	7%	7%

〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	48%	32%	5%	5%	5%	5%

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

ファンドの基本配分比率のイメージ



(注1) 2023年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2022年以前は過去の基本配分比率を示しています。

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

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

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

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

●東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

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

(c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス

ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるＴＯＰＩＸ（配当込み）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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。

3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

運用プロセス

ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

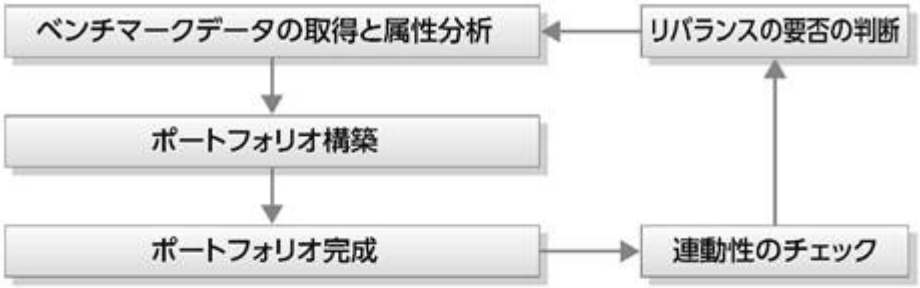
ＭＳＣＩコクサイ指数とは

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

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

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

運用プロセス



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

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

東証REIT指数とは

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

［算出方法の概要］

指数：算出時の時価総額(注1)÷基準時の時価総額(注2)×1,000

(注1) 算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

(注2) 2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

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

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

運用プロセス

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

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

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

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

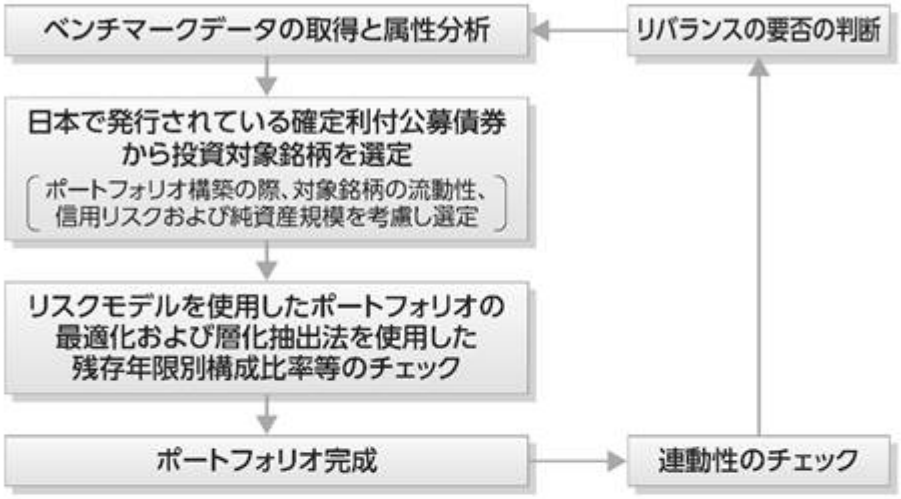
S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

[特徴]
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

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

運用プロセス



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

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

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

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

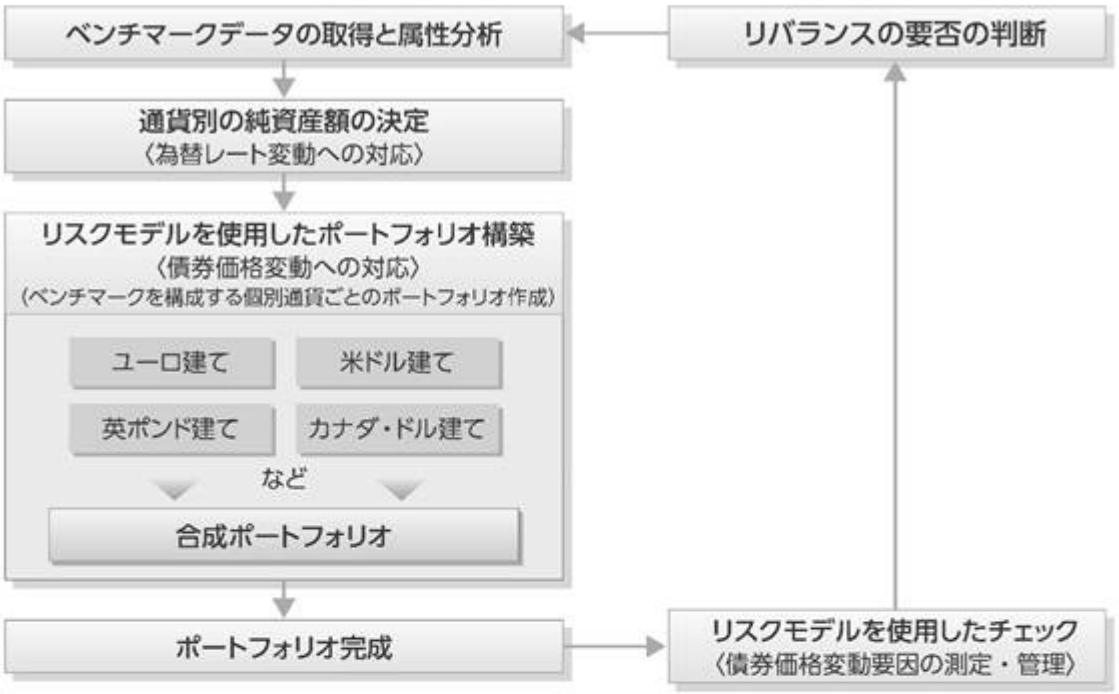
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

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

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

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

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応

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

③債券価格変動要因の測定・管理

リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

8 2050年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数とは

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

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

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

ファンドの仕組み

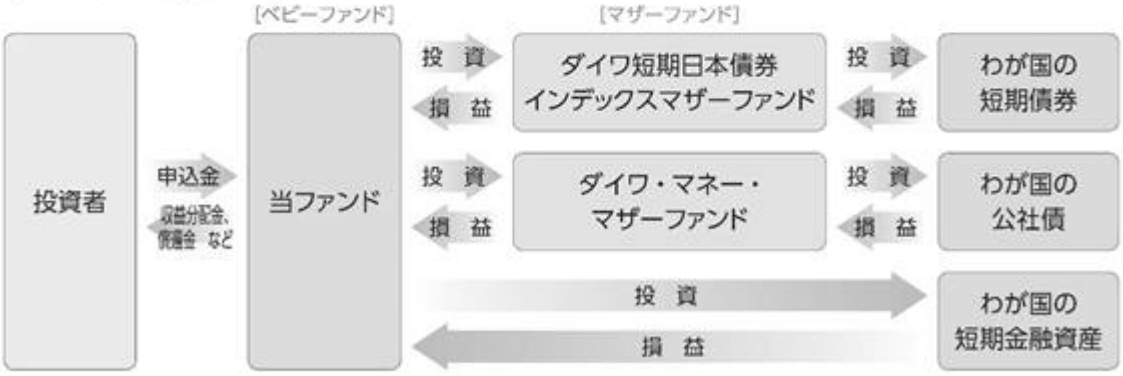
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

〈2050年の決算日前日まで〉

※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドおよびダイワ・マネー・マザーファンドに投資することがあります。

〈2050年の決算日から〉



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

- 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、ファンドの特色1.～8.の運用が行なわれないことがあります。

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

10 毎年12月18日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。
収益分配金は、自動的に再投資されます。

（注）第1計算期間は、2016年12月18日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈分配方針〉

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

②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2016年5月13日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金(※3)

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

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金(※3)

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

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金(※3)

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

損益↑↓投資

投資対象	内外の株式・債券・リート（ＲＥＩＴ）および短期金融資産　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（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。

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

②　投資態度

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

ロ．マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2050年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

当初設定時の基本配分比率

トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の48%

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の32%

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券

……信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

……信託財産の純資産総額の 5%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券　……信託財産の純資産総額の 5%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．2050年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドおよびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から8．までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の9．から12．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3．ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券

4．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券

5．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

7．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

8．ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券

9．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

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

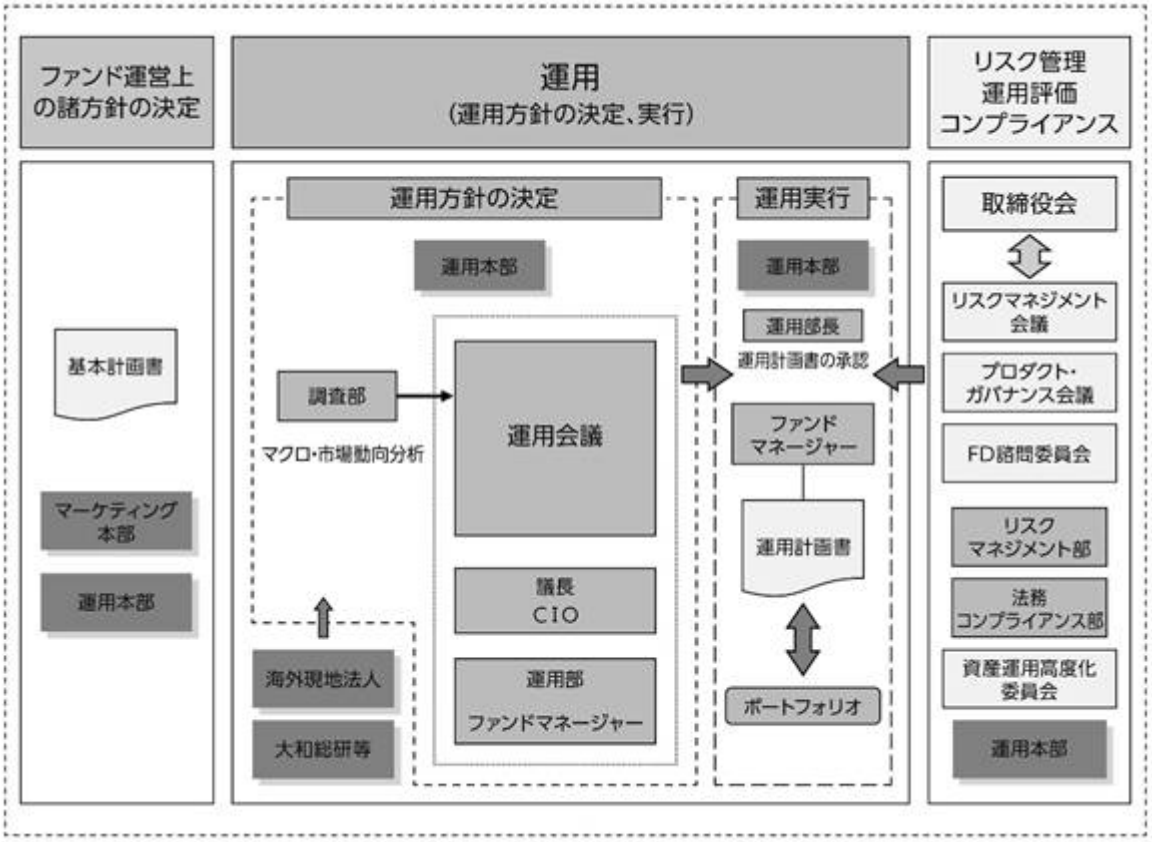
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



②　運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから

提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

③　職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、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】

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

②　原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑥　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞各マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

①　株式への投資には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資は、行ないません。

２．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3．ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

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

② 投資態度

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の投資信託証券

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

④　外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤　先物取引

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

４．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

※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。

②　投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「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

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑤ 先物取引

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

5．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

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

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

1．先物取引の売建ておよびコール・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。

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

7．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

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

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

8．ダイワ・マネー・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

本邦通貨表示の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。

ロ．邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。

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 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)⑥、⑦および⑧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．投資法人債券（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。）
10．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。）
11．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
12．外国の者に対する権利で前11.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.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.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

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30%以下とします。

②　投資信託証券

投資信託証券への投資は、行ないません。

③　同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への投資割合は、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　同一銘柄の転換社債等

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。

⑤　外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

⑥　先物取引等

イ．委託会社は、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、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）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、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

ロ．委託会社は、信託財産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、ヘッジの対象とする金利商品（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、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）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。

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ヘッジ対象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。

⑦　スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、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。

⑧　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、ならびに価格変動リスクを回避するため、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、ヘッジ対象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、上記ヘッジ対象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ヘッジ対象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【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなく

なることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

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

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

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

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

④　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

⑤　その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

②　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することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

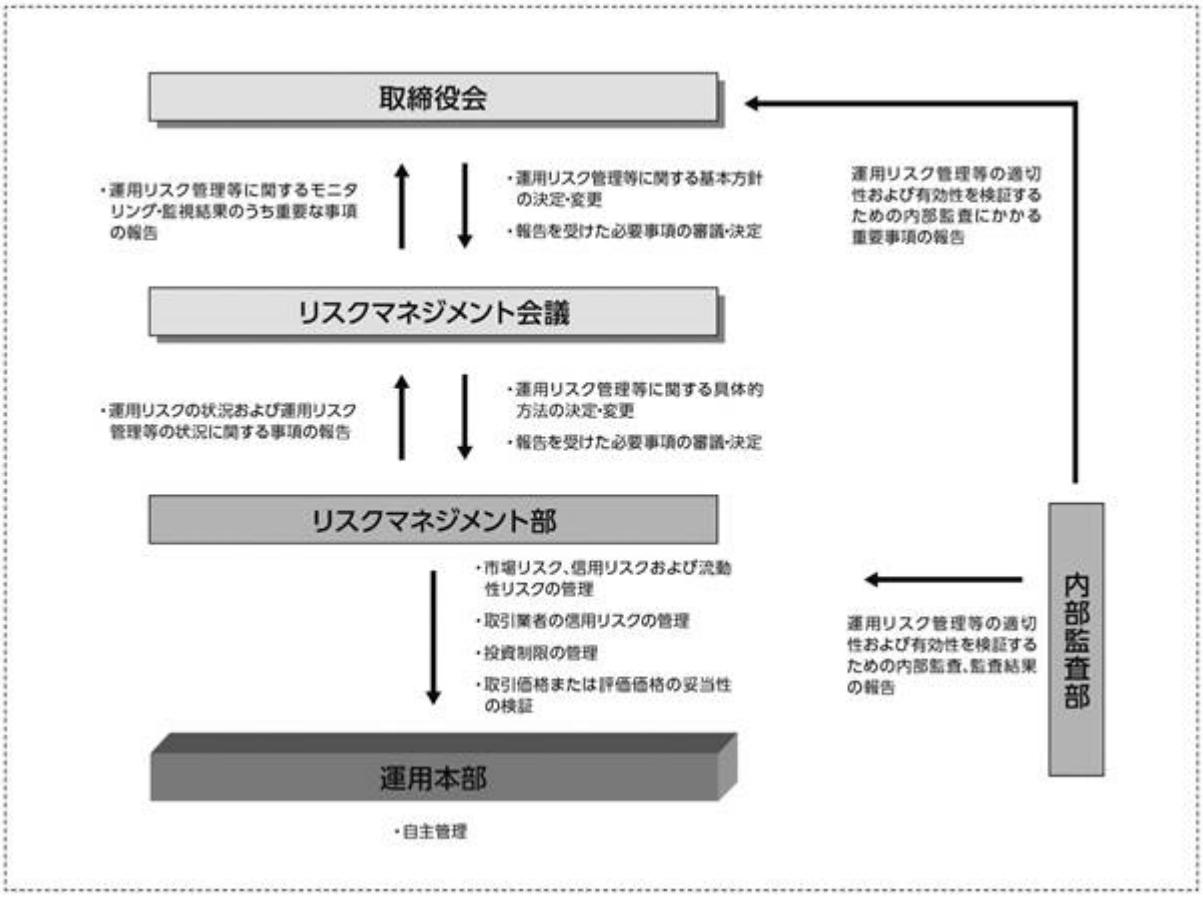
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

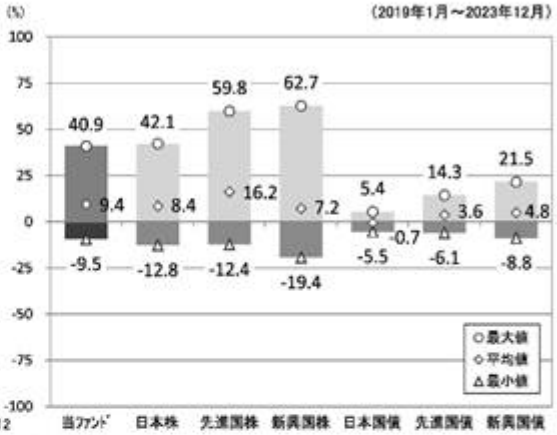
- **委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。**
- **取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。**

参　考　情　報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

①　換金手数料

ありません。

②　信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

	信託報酬率
第1計算期間から第20計算期間まで	年率0.396%（税抜0.36%）
第21計算期間から第30計算期間まで	年率0.374%（税抜0.34%）
第31計算期間から第35計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第36計算期間以降	年率0.242%（税抜0.22%）

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

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

＜第1計算期間から第20計算期間まで＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.165% (税抜)	年率0.165% (税抜)	年率0.03% (税抜)

＜第21計算期間から第30計算期間まで＞

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

＜第31計算期間から第35計算期間まで＞

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

＜第36計算期間以降＞

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.095% (税抜)	年率0.095% (税抜)	年率0.03% (税抜)

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（有価証券等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）

の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」について

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

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

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

当ファンドは、ＮＩＳＡの対象ではありません。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、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		981,143,558	99.81
	内 日本	981,143,558	99.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,906,522	0.19
純資産総額		983,050,080	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	253,933,521	1.6623 422,128,907	1.7002 431,737,772	43.92
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	52,902,578	5.2971 280,230,248	5.3712 284,150,326	28.90
3	ダイワJ－REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	21,081,807	3.2149 67,777,285	3.2510 68,536,954	6.97
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	19,906,441	3.3973 67,628,482	3.4344 68,366,680	6.95
5	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	65,194,418	1.0421 67,939,107	1.0429 67,991,258	6.92
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	16,986,230	3.4816 59,139,261	3.5535 60,360,568	6.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2016年12月19日)	1,133,176	1,133,176	1.1332	1.1332
第2計算期間末(2017年12月18日)	1,335,634	1,335,634	1.2975	1.2975
第3計算期間末(2018年12月18日)	1,437,343	1,437,343	1.1966	1.1966
第4計算期間末(2019年12月18日)	19,747,038	19,747,038	1.3816	1.3816
第5計算期間末(2020年12月18日)	63,744,579	63,744,579	1.4508	1.4508
第6計算期間末(2021年12月20日)	457,362,711	457,362,711	1.7142	1.7142
第7計算期間末(2022年12月19日)	675,630,367	675,630,367	1.7323	1.7323
2022年12月末日	662,758,667	－	1.6945	－
2023年1月末日	689,810,292	－	1.7509	－
2月末日	722,292,656	－	1.7806	－
3月末日	738,744,844	－	1.7809	－

4月末日	750,928,416	－	1.8253	－
5月末日	800,204,149	－	1.8838	－
6月末日	854,704,783	－	2.0009	－
7月末日	872,789,843	－	2.0214	－
8月末日	911,429,065	－	2.0424	－
9月末日	909,841,469	－	2.0209	－
10月末日	909,375,659	－	1.9640	－
11月末日	964,317,012	－	2.0748	－
第8計算期間末 (2023年12月18日)	967,175,428	967,175,428	2.0561	2.0561
12月末日	983,050,080	－	2.0905	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.3
第2計算期間	14.5
第3計算期間	△7.8
第4計算期間	15.5
第5計算期間	5.0
第6計算期間	18.2
第7計算期間	1.1
第8計算期間	18.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	29,370	0

第3計算期間	248,633	76,842
第4計算期間	15,611,182	2,518,983
第5計算期間	66,431,048	36,786,378
第6計算期間	295,237,620	72,365,338
第7計算期間	229,640,562	106,439,426
第8計算期間	176,866,566	96,477,774

(注)　当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（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	リクルートホールディングス	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。

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。

ダイワＪ－ＲＥＩＴ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(%)
投資証券		393,057,788,500	97.52
	内 日本	393,057,788,500	97.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,009,844,123	2.48
純資産総額		403,067,632,623	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		10,012,800,000	2.48
	内 日本	10,012,800,000	2.48

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

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

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

(2) 投資資産（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	日本ビルファンド	日本	投資証券	44,547	610,028.57 27,174,942,784	611,000.00 27,218,217,000	6.75
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	39,224	595,835.44 23,371,049,381	584,000.00 22,906,816,000	5.68
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	123,486	171,250.58 21,147,049,215	165,000.00 20,375,190,000	5.06
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	183,037	96,916.80 17,739,361,452	101,900.00 18,651,470,300	4.63
5	GLP投資法人	日本	投資証券	128,989	137,793.64 17,773,864,157	140,500.00 18,122,954,500	4.50
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	66,522	277,438.99 18,455,796,555	271,400.00 18,054,070,800	4.48

7	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	109,891	170,271.91 18,711,351,203	160,800.00 17,670,472,800	4.38
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	57,560	263,967.98 15,193,997,209	251,700.00 14,487,852,000	3.59
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	76,086	178,246.95 13,562,098,098	166,500.00 12,668,319,000	3.14
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	85,420	156,631.25 13,379,442,117	144,100.00 12,309,022,000	3.05
11	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	37,466	335,833.79 12,582,348,791	316,000.00 11,839,256,000	2.94
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	184,888	60,404.02 11,167,979,099	61,000.00 11,278,168,000	2.80
13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	26,115	371,892.70 9,711,978,077	350,000.00 9,140,250,000	2.27
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	114,746	85,349.81 9,793,549,848	77,100.00 8,846,916,600	2.19
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	127,830	76,004.92 9,715,709,744	69,200.00 8,845,836,000	2.19
16	産業ファンド	日本	投資証券	58,264	146,604.69 8,541,776,114	139,600.00 8,133,654,400	2.02
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	13,185	634,787.17 8,369,668,945	604,000.00 7,963,740,000	1.98
18	ＡＰＩ投資法人	日本	投資証券	20,033	414,877.91 8,311,249,294	388,500.00 7,782,820,500	1.93
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	48,813	145,821.99 7,118,008,878	152,000.00 7,419,576,000	1.84
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	15,883	483,292.21 7,676,130,261	457,500.00 7,266,472,500	1.80
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	24,460	296,678.13 7,256,747,098	286,000.00 6,995,560,000	1.74
22	イオンリート投資	日本	投資証券	46,841	147,257.93 6,897,709,010	141,400.00 6,623,317,400	1.64
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	44,904	146,640.31 6,584,736,815	140,200.00 6,295,540,800	1.56
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	14,168	469,785.96 6,655,927,564	433,000.00 6,134,744,000	1.52
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	18,777	333,387.93 6,260,025,324	317,000.00 5,952,309,000	1.48
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	56,233	115,564.38 6,498,532,298	104,300.00 5,865,101,900	1.46

27	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	73,605	73,694.83 5,424,308,387	72,500.00 5,336,362,500	1.32
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	35,727	162,707.89 5,813,064,893	149,200.00 5,330,468,400	1.32
29	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,911	667,992.12 5,284,485,730	665,000.00 5,260,815,000	1.31
30	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	13,186	386,386.04 5,094,886,418	374,500.00 4,938,157,000	1.23

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.52%
合計	97.52%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT　先物 0603月	買建	5,600	10,019,296,000	10,012,800,000	2.48%

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

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

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（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(%)
投資信託受益証券		1,166,784,351	3.15
	内 アメリカ	1,166,784,351	3.15
投資証券		34,713,442,369	93.84
	内 ガーンジィ	98,060,392	0.27
	内 韓国	62,583,675	0.17
	内 香港	416,386,775	1.13
	内 シンガポール	1,284,741,751	3.47
	内 イスラエル	44,790,574	0.12
	内 イギリス	1,735,311,490	4.69
	内 アイルランド	11,288,231	0.03
	内 オランダ	54,821,026	0.15
	内 ベルギー	365,335,247	0.99
	内 フランス	572,531,224	1.55
	内 ドイツ	11,500,730	0.03
	内 スペイン	137,697,221	0.37
	内 イタリア	2,509,780	0.01
	内 カナダ	534,405,633	1.44
	内 アメリカ	26,765,834,729	72.36
	内 オーストラリア	2,510,086,488	6.79
	内 ニュージーランド	105,557,403	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,110,516,223	3.00
純資産総額		36,990,742,943	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		1,104,594,304	2.99
	内 ドイツ	287,199,648	0.78
	内 アメリカ	817,394,656	2.21
為替予約取引（買建）		177,051,767	0.48
	内 日本	177,051,767	0.48

(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)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	160,756	16,032.46 2,577,314,654	19,173.99 3,082,335,174	8.33
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	16,346	114,642.60 1,873,948,059	115,462.38 1,887,348,140	5.10
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	96,347	12,509.40 1,205,243,740	12,929.22 1,245,691,829	3.37
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	27,579	36,577.95 1,008,783,476	43,655.27 1,203,968,802	3.25
5	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	92,000	11,705.37 1,076,900,355	12,682.43 1,166,784,351	3.15
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	56,853	17,411.05 989,870,471	20,463.23 1,163,396,152	3.15
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	125,888	7,617.68 958,982,263	8,308.40 1,045,928,035	2.83
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	52,776	19,600.90 1,034,457,415	19,305.89 1,018,888,157	2.75
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	36,812	18,371.23 676,282,083	22,999.15 846,644,813	2.29
10	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	179,928	4,203.55 756,344,551	4,564.08 821,207,478	2.22
11	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	322,195	2,260.73 728,424,629	2,443.85 787,398,635	2.13
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,712	24,228.81 598,742,573	26,890.96 664,529,601	1.80
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	60,145	8,024.74 482,648,072	8,864.37 533,147,834	1.44
14	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	50,823	8,975.00 456,136,547	10,013.19 508,900,762	1.38
15	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	70,011	6,440.50 450,905,867	7,226.23 505,916,184	1.37
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	27,245	15,460.88 421,231,902	18,281.88 498,090,011	1.35
17	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	100,119	4,674.71 468,027,971	4,921.50 492,735,759	1.33
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	21,712	18,154.24 394,164,859	19,165.48 416,121,073	1.12

19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,243	30,100.58 338,420,831	35,847.53 403,033,808	1.09
20	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	20,391	17,567.06 358,209,998	19,366.88 394,910,183	1.07
21	LINK REIT	香港	投資証券	477,600	707.55 337,932,237	795.87 380,111,094	1.03
22	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	222,169	1,482.29 329,320,825	1,621.06 360,149,491	0.97
23	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	37,970	8,824.23 335,057,249	9,315.39 353,705,525	0.96
24	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	122,771	2,473.51 303,675,935	2,789.79 342,506,057	0.93
25	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	107,895	2,697.60 291,058,264	3,091.89 333,599,903	0.90
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	32,445	9,940.86 322,531,355	10,157.86 329,571,917	0.89
27	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	46,385	6,508.86 301,914,202	7,044.69 326,768,229	0.88
28	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	アメリカ	投資証券	36,663	6,917.75 253,630,826	8,081.47 296,291,059	0.80
29	UDR INC	アメリカ	投資証券	52,658	4,721.52 248,625,837	5,498.74 289,553,130	0.78
30	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	55,372	5,076.09 281,073,571	5,148.42 285,078,811	0.77

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	3.15%
投資証券	93.84%
合計	97.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 24	買建	160	759,824,157	817,394,656	2.21%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 24	買建	270	271,148,677	287,199,648	0.78%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年1月	買建	730,000	107,228,605	103,321,645	0.28%
		ユーロ買/円売 2024年1月	買建	470,000	75,405,578	73,730,122	0.20%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（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		449,276,080	99.29
	内 日本	449,276,080	99.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,192,465	0.71
純資産総額		452,468,545	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	144 5年国債	日本	国債証券	126,000,000	100.10 126,132,300	100.14 126,182,700	0.100000 2025/06/20	27.89
2	148 5年国債	日本	国債証券	56,000,000	99.82 55,902,000	99.92 55,958,560	0.005000 2026/06/20	12.37

3	149 5年国債	日本	国債証券	53,000,000	99.76 52,875,980	99.89 52,942,230	0.005000 2026/09/20	11.70
4	146 5年国債	日本	国債証券	45,000,000	100.09 45,042,540	100.15 45,070,200	0.100000 2025/12/20	9.96
5	342 10年国債	日本	国債証券	43,000,000	100.07 43,033,540	100.15 43,066,220	0.100000 2026/03/20	9.52
6	145 5年国債	日本	国債証券	41,000,000	100.09 41,039,180	100.15 41,062,730	0.100000 2025/09/20	9.08
7	143 5年国債	日本	国債証券	38,000,000	100.12 38,047,120	100.14 38,054,720	0.100000 2025/03/20	8.41
8	150 5年国債	日本	国債証券	38,000,000	99.70 37,886,000	99.85 37,943,760	0.005000 2026/12/20	8.39
9	147 5年国債	日本	国債証券	9,000,000	99.86 8,987,850	99.94 8,994,960	0.005000 2026/03/20	1.99

(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	99.29%
合計	99.29%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（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

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2050

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	20,905円
純資産総額	9.8億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	3.4%
6カ月間	4.5%
1年間	23.4%
3年間	43.1%
5年間	81.3%
設定来	109.1%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第1期 16年12月	第2期 17年12月	第3期 18年12月	第4期 19年12月	第5期 20年12月	第6期 21年12月	第7期 22年12月	第8期 23年12月				
分配金	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	43.9%
外国株式・先物	1,203	28.3%
国内リート・先物	59	7.0%
国内債券	9	6.9%
外国債券	972	6.8%
外国リート・先物	311	6.5%
外国投資信託等	6	0.2%
コール・ローン、その他		3.9%
合計	4,693	-

通貨別構成	比率
日本円	58.0%
米ドル	29.6%
ユーロ	5.3%
英ポンド	1.9%
カナダ・ドル	1.2%
豪ドル	1.2%
スイス・フラン	0.8%
オフショア人民元	0.5%
シンガポール・ドル	0.3%
その他	1.2%
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(%)	1.7
修正デュレーション	4.4
残存年数	5.3

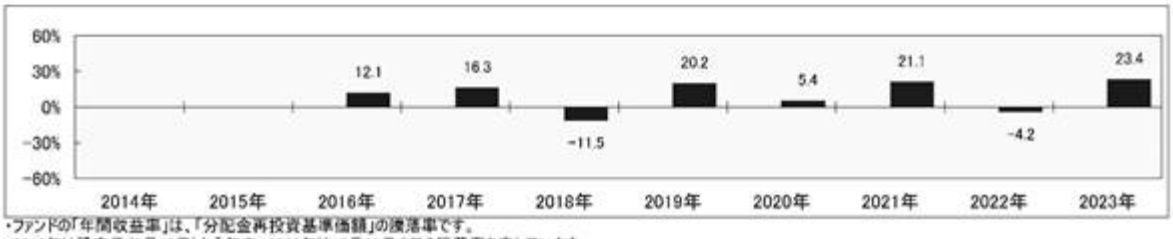
債券格付別構成	比率
AAA	88.2%
AA	7.3%
A	4.4%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	トヨタ自動車	日本	1.8%
株式	APPLE INC	アメリカ	1.5%
株式	TOPIX　先物 0603月	日本	1.4%
株式	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.3%
株式	ソニーグループ	日本	1.2%
リート	PROLOGIS INC	アメリカ	0.6%
リート	日本ビルファンド	日本	0.5%
リート	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
リート	野村不動産マスターF	日本	0.4%
リート	EQUINIX INC	アメリカ	0.4%
合計			9.3%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、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

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2016年は設定日（5月13日）から年末、2023年は12月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①+②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	0.41%	0.40%	0.02%

※対象期間は2022年12月20日～2023年12月18日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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

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。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- 東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- 外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- 海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- 公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。
基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。
大和アセットマネジメント株式会社
電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年5月13日から2016年12月18日までとします。

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

(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、あるいは、第36計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

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

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

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

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

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

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

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

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

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

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金にかかる請求権＞

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

＜償還金にかかる請求権＞

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2022年12月20日から2023年12月18日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2022年12月19日現在	第8期 2023年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,632,420	3,739,311
親投資信託受益証券	674,282,278	965,278,289
流動資産合計	676,914,698	969,017,600
資産合計	676,914,698	969,017,600
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,726	15,008
未払受託者報酬	103,204	149,121
未払委託者報酬	1,135,682	1,640,843
その他未払費用	25,719	37,200
流動負債合計	1,284,331	1,842,172
負債合計	1,284,331	1,842,172
純資産の部		
元本等		
元本	※1 390,011,448	※1 470,400,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	285,618,919	496,775,188
（分配準備積立金）	19,166,186	140,259,352
元本等合計	675,630,367	967,175,428
純資産合計	675,630,367	967,175,428
負債純資産合計	676,914,698	969,017,600

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2021年12月21日 至　2022年12月19日	第8期 自　2022年12月20日 至　2023年12月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	7,678,393	141,029,011
その他収益	8	-
営業収益合計	7,678,401	141,029,011
営業費用		
支払利息	580	793
受託者報酬	188,500	269,232
委託者報酬	2,074,509	2,962,405
その他費用	46,961	67,139
営業費用合計	2,310,550	3,299,569
営業利益又は営業損失（△）	5,367,851	137,729,442
経常利益又は経常損失（△）	5,367,851	137,729,442
当期純利益又は当期純損失（△）	5,367,851	137,729,442
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（△）	1,184,296	12,721,817
期首剰余金又は期首欠損金（△）	190,552,399	285,618,919
剰余金増加額又は欠損金減少額	166,840,836	158,324,067
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	166,840,836	158,324,067
剰余金減少額又は欠損金増加額	75,957,871	72,175,423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	75,957,871	72,175,423
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	285,618,919	496,775,188

(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8期 自2022年12月20日 至2023年12月18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12月18日が休日のため、前計算期間末日を2022年12月19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7期 2022年12月19日現在	第8期 2023年12月18日現在
1．　※1 期首元本額	266,810,312円	390,011,448円
期中追加設定元本額	229,640,562円	176,866,566円
期中一部解約元本額	106,439,426円	96,477,774円
2．　計算期間末日における受益権の総数	390,011,448口	470,400,240口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2021年12月21日 至2022年12月19日	第8期 自2022年12月20日 至2023年12月18日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（4,183,941円）、投資信託約款に規定される収益調整金（266,453,287円）及び分配準備積立金（14,982,245円）より分配対象額は285,619,473円（1万口当たり7,323.36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（125,007,915円）、投資信託約款に規定される収益調整金（356,516,581円）及び分配準備積立金（15,251,437円）より分配対象額は496,775,933円（1万口当たり10,560.71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8期 自2022年12月20日 至2023年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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8期 2023年12月18日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 2022年12月19日現在	第8期 2023年12月18日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	6,522,427	133,488,176
合計	6,522,427	133,488,176

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第7期 2022年12月19日現在	第8期 2023年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 自2022年12月20日 至2023年12月18日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第7期 2022年12月19日現在	第8期 2023年12月18日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7323円 (17,323円)	2.0561円 (20,561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	252,698,013	420,059,907	
	外国株式インデックスマザーファンド	53,190,442	281,755,090	
	外国債券インデックスマザーファンド	19,940,223	67,742,919	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	20,894,901	67,181,285	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	17,406,934	60,603,981	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	65,190,584	67,935,107	
親投資信託受益証券 合計			965,278,289	
合計			965,278,289	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2022年12月19日現在 金　額（円）	2023年12月18日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,825,381,928	12,509,355,185
株式	※2※3	197,542,891,460	271,694,881,710
派生商品評価勘定		275,600	-
未収配当金		21,088,470	34,216,517
未収利息		423,892	354,362
前払金		7,400,000	40,870,000
その他未収収益	※4	3,908,422	3,809,987
差入委託証拠金		-	83,656,486
流動資産合計		208,401,369,772	284,367,144,247
資産合計		208,401,369,772	284,367,144,247
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		22,884,700	88,366,150
未払解約金		37,423,620	45,582,510
受入担保金		7,604,153,067	6,027,500,124
流動負債合計		7,664,461,387	6,161,448,784
負債合計		7,664,461,387	6,161,448,784
純資産の部			
元本等			
元本	※1	148,213,575,565	167,363,042,675
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		52,523,332,820	110,842,652,788
元本等合計		200,736,908,385	278,205,695,463

純資産合計	200,736,908,385	278,205,695,463
負債純資産合計	208,401,369,772	284,367,144,247

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12月20日 至2023年12月18日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
1．　※1 期首	2021年12月21日	2022年12月20日
期首元本額	139,719,409,192円	148,213,575,565円
期中追加設定元本額	21,664,467,396円	33,709,870,987円
期中一部解約元本額	13,170,301,023円	14,560,403,877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	2,874,974,472円	2,806,589,377円

ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,748,856,911円	4,338,435,108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	917,439円	911,033円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,001,280円	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)	268,786,587円	186,897,779円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	20,586,631円	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)	565,944,626円	405,732,331円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	-円	335,745,401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）	473,487,596円	683,176,927円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	29,456,553円	13,681,132円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	224,512,137円	252,698,013円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	6,338,589,470円	7,316,732,442円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,293,637,156円	4,616,250,454円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	796,167,702円	1,010,425,277円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	606,201円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	69,222,715,190円	70,764,909,047円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,294,383,038円	3,117,247,592円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,747,389,276円	4,949,158,053円
ダイワ・ライフ・バランス７０	4,674,145,045円	5,667,590,984円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,699,274,926円	7,353,575,651円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	57,539,012円	55,620,720円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	70,612,808円	76,255,756円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,769,204,947円	4,843,673,479円

ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,751,428円	12,445,814円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	10,389,851円	11,685,906円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	26,305,509円	29,772,487円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	2,226,064,649円	11,959,611,664円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	77,693,100円	54,371,807円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	34,559,946円	21,015,894円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	5,037,989,016円	3,760,384,417円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	454,758,876円	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）	62,260,889円	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）	104,389,988円	73,719,521円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	201,590,167円	239,106,880円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	11,564,090,549円	12,349,270,983円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	2,005,467,634円	6,002,426,419円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,201,715,760円	3,346,831,688円
スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	86,587円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	145,111円
スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	202,435円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	74,055円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	128,381円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	203,035円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	74,654円

	スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	126,582円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	213,768円
	ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ	1,200,348,955円	1,153,362,208円
	ダイワライフスタイル２５	132,554,281円	107,605,154円
	ダイワライフスタイル５０	550,577,889円	481,894,635円
	ダイワライフスタイル７５	419,565,009円	403,714,677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）	8,698,319,267円	8,127,833,501円
計		148,213,575,565円	167,363,042,675円
2.	期末日における受益権の総数	148,213,575,565口	167,363,042,675口
3.	※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　7,162,022,940円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　5,729,754,780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　884,260,000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　617,720,000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12月20日 至2023年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月18日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	△947,914,652	△12,681,916,678
合計	△947,914,652	△12,681,916,678

（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12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	3,155,600,000	-	3,133,080,000	△22,520,000	6,859,435,000	-	6,771,230,000	△88,205,000
合計	3,155,600,000	-	3,133,080,000	△22,520,000	6,859,435,000	-	6,771,230,000	△88,205,000

（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）

	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.3544円	1.6623円
（1万口当たり純資産額）	(13,544円)	(16,623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	4,500	3,720.00	16,740,000	
ニッスイ	116,200	744.10	86,464,420	
マルハニチロ	17,400	2,726.50	47,441,100	
雪国まいたけ	10,100	924.00	9,332,400	
カネコ種苗	3,700	1,399.00	5,176,300	
サカタのタネ	13,200	3,870.00	51,084,000	
ホクト	9,400	1,729.00	16,252,600	
ホクリヨウ	1,100	1,052.00	1,157,200	貸付株式数 400株
ショーボンドＨＤ	15,800	5,891.00	93,077,800	
ミライト・ワン	38,300	1,800.00	68,940,000	
タマホーム	7,300	3,735.00	27,265,500	貸付株式数 2,900株
サンヨーホームズ	800	726.00	580,800	
日本アクア	2,600	847.00	2,202,200	貸付株式数 1,000株
ファーストコーポレーション	1,600	734.00	1,174,400	貸付株式数 700株
ベステラ	1,500	1,049.00	1,573,500	貸付株式数 600株 (600株)
キャンディル	1,100	558.00	613,800	貸付株式数 700株
住石ホールディングス	11,400	1,046.00	11,924,400	貸付株式数 5,100株
日鉄鉱業	4,600	5,030.00	23,138,000	
三井松島HLDGS	6,900	2,742.00	18,919,800	貸付株式数 2,700株
ＩＮＰＥＸ	428,200	1,892.50	810,368,500	貸付株式数 171,000株
石油資源開発	13,400	5,100.00	68,340,000	
K&Oエナジーグループ	5,200	2,043.00	10,623,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,300	1,079.00	1,402,700	
第一カッター興業	2,900	1,297.00	3,761,300	
明豊ファシリティワークス	2,300	806.00	1,853,800	
安藤・間	67,000	1,079.00	72,293,000	
東急建設	36,200	786.00	28,453,200	
コムシスホールディングス	37,000	3,065.00	113,405,000	
ビーアールホールディングス	16,900	349.00	5,898,100	
高松コンストラクショングループ	8,600	2,649.00	22,781,400	
東建コーポレーション	3,300	8,960.00	29,568,000	
ソネック	700	953.00	667,100	
ヤマウラ	5,800	1,403.00	8,137,400	貸付株式数 200株
オリエンタル白石	42,500	330.00	14,025,000	
大成建設	75,800	4,827.00	365,886,600	

大 林 組	289,700	1,187.00	343,873,900	
清水建設	229,700	911.40	209,348,580	
飛島建設	8,300	1,276.00	10,590,800	
長谷工コーポレーシヨン	74,300	1,778.00	132,105,400	貸付株式数　28,500株
松井建設	7,500	804.00	6,030,000	
錢 高 組	700	3,920.00	2,744,000	貸付株式数　200株
鹿島建設	179,600	2,298.00	412,720,800	
不動テトラ	5,600	2,186.00	12,241,600	
大末建設	1,800	1,297.00	2,334,600	貸付株式数　700株
鉄建建設	5,800	1,905.00	11,049,000	
西松建設	15,400	3,808.00	58,643,200	
三井住友建設	60,100	392.00	23,559,200	
大豊建設	2,800	3,715.00	10,402,000	貸付株式数　700株
佐田建設	2,800	607.00	1,699,600	
ナカノフドー建設	3,300	460.00	1,518,000	
奥 村 組	13,100	4,440.00	58,164,000	
東鉄工業	10,000	3,040.00	30,400,000	
イチケン	1,100	2,219.00	2,440,900	
富士ピー・エス	2,000	450.00	900,000	貸付株式数　800株
淺沼組	5,900	3,605.00	21,269,500	
戸田建設	109,600	905.40	99,231,840	
熊 谷 組	13,500	3,525.00	47,587,500	
北野建設	800	3,090.00	2,472,000	
植 木 組	1,300	1,450.00	1,885,000	
矢作建設	11,000	1,327.00	14,597,000	
ピーエス三菱	3,100	870.00	2,697,000	
日本ハウスHLDGS	17,100	307.00	5,249,700	貸付株式数　6,800株
大東建託	29,800	16,125.00	480,525,000	
新日本建設	11,400	1,067.00	12,163,800	
東亜道路	3,200	6,610.00	21,152,000	
日本道路	9,500	1,933.00	18,363,500	
東亜建設	6,200	3,375.00	20,925,000	貸付株式数　2,400株
日本国土開発	22,800	566.00	12,904,800	
若築建設	2,800	2,965.00	8,302,000	
東洋建設	20,300	1,228.00	24,928,400	
五洋建設	114,900	773.70	88,898,130	
世紀東急	10,400	1,582.00	16,452,800	貸付株式数　4,100株
福 田 組	3,000	5,010.00	15,030,000	貸付株式数　1,200株
日本ドライケミカル	1,100	2,669.00	2,935,900	貸付株式数　100株

住友林業	70,000	4,119.00	288,330,000	
日本基礎技術	2,700	434.00	1,171,800	
巴コーポレーション	5,700	553.00	3,152,100	
大和ハウス	224,000	4,147.00	928,928,000	
ライト工業	16,700	1,863.00	31,112,100	
積水ハウス	245,700	3,029.00	744,225,300	
日特建設	7,700	1,013.00	7,800,100	
北陸電気工事	5,500	951.00	5,230,500	
ユアテック	17,700	1,042.00	18,443,400	
日本リーテック	6,300	1,139.00	7,175,700	
四電工	3,400	3,035.00	10,319,000	
中電工	12,500	2,549.00	31,862,500	
関 電 工	50,700	1,356.00	68,749,200	
きんでん	57,000	2,365.50	134,833,500	
東京エネシス	8,100	1,017.00	8,237,700	
トーエネック	2,600	4,280.00	11,128,000	
住友電設	7,700	2,658.00	20,466,600	
日本電設工業	15,200	1,927.00	29,290,400	
エクシオグループ	40,700	3,035.00	123,524,500	
新日本空調	5,200	2,219.00	11,538,800	
九電工	17,500	5,045.00	88,287,500	
三機工業	17,500	1,700.00	29,750,000	
日揮ホールディングス	80,200	1,570.50	125,954,100	
中外炉工業	2,700	2,174.00	5,869,800	
ヤマト	3,700	900.00	3,330,000	
太平電業	5,000	4,010.00	20,050,000	
高砂熱学	21,700	3,145.00	68,246,500	
三晃金属	600	4,560.00	2,736,000	
NECネッツエスアイ	32,300	2,235.00	72,190,500	
朝日工業社	3,800	2,855.00	10,849,000	
明星工業	15,700	1,070.00	16,799,000	
大 氣 社	9,300	4,055.00	37,711,500	
ダイダン	10,600	1,334.00	14,140,400	
日比谷総合設備	5,800	2,287.00	13,264,600	
ニップン	24,600	2,237.00	55,030,200	貸付株式数　9,700株
日清製粉Ｇ本社	75,300	1,902.50	143,258,250	
日東富士製粉	1,500	4,740.00	7,110,000	
昭和産業	8,000	3,090.00	24,720,000	
鳥越製粉	4,600	662.00	3,045,200	貸付株式数　1,800株
中部飼料	11,600	1,089.00	12,632,400	

フィード・ワン	12,200	746.00	9,101,200	
東洋精糖	900	1,953.00	1,757,700	
日本甜菜糖	4,900	1,893.00	9,275,700	
DM三井製糖ホールディ	8,200	2,843.00	23,312,600	
塩水港精糖	6,700	225.00	1,507,500	
ウェルネオシュガー	4,200	2,035.00	8,547,000	貸付株式数 1,400株
ＬＩＦＵＬＬ	29,000	177.00	5,133,000	貸付株式数 10,900株
ＭＩＸＩ	18,200	2,339.00	42,569,800	
ジェイエイシーリクルートメント	7,600	2,653.00	20,162,800	
日本M&Aセンターホールデ	135,300	724.10	97,970,730	
メンバーズ	2,900	914.00	2,650,600	貸付株式数 1,100株
中広	700	410.00	287,000	
ＵＴグループ	11,200	2,191.00	24,539,200	
アイティメディア	3,200	914.00	2,924,800	貸付株式数 1,200株
E・Jホールディングス	5,000	1,555.00	7,775,000	貸付株式数 1,900株
オープンアップグループ	25,500	2,223.00	56,686,500	貸付株式数 9,600株
コシダカホールディングス	25,400	1,047.00	26,593,800	
アルトナー	2,000	1,959.00	3,918,000	貸付株式数 500株
パソナグループ	10,200	2,720.00	27,744,000	
ＣＤＳ	1,200	1,713.00	2,055,600	
リンクアンドモチベーション	24,400	574.00	14,005,600	貸付株式数 9,100株
エス・エム・エス	29,700	2,743.00	81,467,100	
サニーサイドアップG	1,400	585.00	819,000	
パーソルホールディングス	864,100	229.70	198,483,770	
リニカル	3,000	500.00	1,500,000	
クックパッド	23,100	113.00	2,610,300	貸付株式数 1,700株
エスクリ	1,900	277.00	526,300	貸付株式数 1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	2,400	625.00	1,500,000	貸付株式数 900株
森永製菓	17,500	4,985.00	87,237,500	
中 村 屋	2,100	3,055.00	6,415,500	貸付株式数 600株
江崎グリコ	23,400	4,099.00	95,916,600	
名糖産業	3,400	1,646.00	5,596,400	貸付株式数 1,200株
井村屋グループ	5,000	2,321.00	11,605,000	
不 二 家	5,600	2,451.00	13,725,600	貸付株式数 2,200株
山崎製パン	54,500	3,142.00	171,239,000	
第一屋製パン	1,000	699.00	699,000	
モロゾフ	2,700	3,715.00	10,030,500	

亀田製菓	4,700	3,925.00	18,447,500	
寿スピリッツ	38,400	2,167.00	83,212,800	
カルビー	37,300	2,750.00	102,575,000	
森永乳業	29,600	2,603.00	77,048,800	
六甲バター	6,200	1,303.00	8,078,600	貸付株式数 2,300株
ヤクルト	116,300	3,099.00	360,413,700	
明治ホールディングス	99,800	3,263.00	325,647,400	
雪印メグミルク	19,800	2,079.00	41,164,200	
プリマハム	11,100	2,230.00	24,753,000	
日本ハム	35,100	4,436.00	155,703,600	
林兼産業	1,900	570.00	1,083,000	貸付株式数 600株
丸大食品	8,400	1,569.00	13,179,600	
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	9,000	3,230.00	29,070,000	
柿安本店	3,100	2,392.00	7,415,200	貸付株式数 800株
伊藤ハム米久HLDGS	12,500	3,745.00	46,812,500	
学情	4,300	1,741.00	7,486,300	貸付株式数 200株
スタジオアリス	4,200	2,075.00	8,715,000	貸付株式数 1,600株
クロスキャット	5,200	1,039.00	5,402,800	貸付株式数 2,000株
シミックホールディングス	4,100	2,645.00	10,844,500	
エプコ	1,300	870.00	1,131,000	貸付株式数 500株
システナ	125,500	303.00	38,026,500	
ＮＪＳ	1,800	2,746.00	4,942,800	貸付株式数 700株
デジタルアーツ	5,200	4,870.00	25,324,000	
日鉄ソリューションズ	14,100	4,780.00	67,398,000	
綜合警備保障	141,800	795.90	112,858,620	
キューブシステム	4,400	1,073.00	4,721,200	貸付株式数 1,800株
いちご	93,900	333.00	31,268,700	
日本駐車場開発	86,000	195.00	16,770,000	
コア	3,700	1,688.00	6,245,600	
カカクコム	56,100	1,710.00	95,931,000	
アイロムグループ	3,400	1,890.00	6,426,000	貸付株式数 1,300株
セントケア・ホールディング	6,100	925.00	5,642,500	貸付株式数 2,000株
サイネックス	800	760.00	608,000	
ルネサンス	6,600	856.00	5,649,600	貸付株式数 2,600株
ディップ	13,000	3,155.00	41,015,000	
SBSホールディングス	7,300	2,474.00	18,060,200	
デジタルホールディングス	4,500	1,263.00	5,683,500	
新日本科学	7,700	1,658.00	12,766,600	貸付株式数 3,300株
キャリアデザインセンター	1,000	2,038.00	2,038,000	

ベネフィット・ワン	29,500	2,009.00	59,265,500		
エムスリー	167,700	2,213.00	371,120,100		
ツカダ・グローバルHOLD	3,100	365.00	1,131,500	貸付株式数	600株
ブラス	500	644.00	322,000	貸付株式数	200株
アウトソーシング	54,500	1,755.00	95,647,500		
ウェルネット	3,600	548.00	1,972,800	貸付株式数	1,600株
ワールドホールディングス	3,800	2,771.00	10,529,800	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	30,100	1,353.00	40,725,300		
博報堂ＤＹHLDGS	108,300	1,050.50	113,769,150		
ぐるなび	16,000	272.00	4,352,000		
タカミヤ	11,400	470.00	5,358,000		
ジャパンベストレスキューS	4,100	998.00	4,091,800		
ファンコミュニケーションズ	11,900	412.00	4,902,800		
ライク	3,100	1,387.00	4,299,700	貸付株式数	100株
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	1,700	416.00	707,200	貸付株式数	800株
エスプール	24,400	411.00	10,028,400	貸付株式数	9,700株
WDBホールディングス	4,300	2,215.00	9,524,500		
手間いらず	1,400	2,817.00	3,943,800		
ティア	2,700	450.00	1,215,000	貸付株式数	1,100株
ＣＤＧ	500	1,198.00	599,000		
アドウェイズ	11,700	528.00	6,177,600	貸付株式数	4,600株
バリューコマース	7,500	1,411.00	10,582,500		
インフォマート	88,100	428.00	37,706,800		
サッポロホールディングス	26,800	5,789.00	155,145,200		
アサヒグループホールディン	187,900	5,200.00	977,080,000	貸付株式数	2,300株
キリンＨＤ	338,900	2,066.50	700,336,850	貸付株式数	131,100株
宝ホールディングス	55,700	1,195.00	66,561,500		
オエノンホールディングス	24,500	353.00	8,648,500		
養 命 酒	2,800	1,842.00	5,157,600	貸付株式数	700株
コカ・コーラボトラーズJHD	63,900	2,039.00	130,292,100		
サントリー食品インター	57,300	4,600.00	263,580,000		
ダイドーグループHD	4,700	5,690.00	26,743,000	貸付株式数	1,500株
伊 藤 園	27,600	4,098.00	113,104,800		
キーコーヒー	9,300	2,044.00	19,009,200		
ユニカフェ	1,700	965.00	1,640,500	貸付株式数	700株
ジャパンフーズ	900	1,195.00	1,075,500		
日清オイリオグループ	11,500	4,130.00	47,495,000		
不二製油グループ	19,000	2,317.00	44,023,000		

かどや製油	600	3,540.00	2,124,000	
Ｊ－オイルミルズ	9,600	1,944.00	18,662,400	
ローソン	18,600	6,951.00	129,288,600	
サンエー	6,600	4,525.00	29,865,000	貸付株式数 1,300株
カワチ薬品	6,800	2,486.00	16,904,800	
エービーシー・マート	38,200	2,565.50	98,002,100	
ハードオフコーポレーション	2,700	1,539.00	4,155,300	
高千穂交易	2,400	3,400.00	8,160,000	貸付株式数 1,000株
アスクル	18,000	2,123.00	38,214,000	貸付株式数 7,200株
ゲオホールディングス	9,800	2,191.00	21,471,800	貸付株式数 3,200株
アダストリア	10,500	3,645.00	38,272,500	貸付株式数 3,600株
ジーフット	3,800	287.00	1,090,600	貸付株式数 200株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	600	659.00	395,400	貸付株式数 200株
オルバヘルスケアHLDGS	700	1,740.00	1,218,000	
伊藤忠食品	2,000	8,090.00	16,180,000	
くら寿司	10,200	3,305.00	33,711,000	貸付株式数 2,800株
キャンドゥ	3,100	2,611.00	8,094,100	貸付株式数 1,100株
エレマテック	7,800	1,700.00	13,260,000	
IKホールディングス	1,500	316.00	474,000	貸付株式数 300株
パルグループHLDGS	17,100	2,576.00	44,049,600	
エディオン	34,500	1,488.00	51,336,000	貸付株式数 13,800株
あらた	6,700	6,130.00	41,071,000	
サーラコーポレーション	18,200	703.00	12,794,600	貸付株式数 7,200株
ワッツ	2,300	588.00	1,352,400	貸付株式数 1,000株
トーメンデバイス	1,300	5,060.00	6,578,000	
ハローズ	3,900	3,980.00	15,522,000	貸付株式数 400株
JPホールディングス	21,700	428.00	9,287,600	貸付株式数 1,200株
フジオフードG本社	9,700	1,422.00	13,793,400	貸付株式数 3,800株 (100株)
あみやき亭	2,100	3,635.00	7,633,500	貸付株式数 600株
東京エレクトロンデバイス	8,700	4,955.00	43,108,500	
ひらまつ	11,300	245.00	2,768,500	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	15,000	1,208.00	18,120,000	貸付株式数 6,000株
双日	97,300	3,199.00	311,262,700	
アルフレッサホールディングス	87,700	2,382.00	208,901,400	
大黒天物産	2,700	6,970.00	18,819,000	
ハニーズホールディングス	6,900	1,784.00	12,309,600	貸付株式数 2,100株

ファーマライズHD	1,000	633.00	633,000	貸付株式数	300株
キッコーマン	53,900	8,610.00	464,079,000		
味 の 素	193,200	5,062.00	977,978,400		
ブルドックソース	4,400	2,097.00	9,226,800		
キユーピー	43,900	2,465.50	108,235,450		
ハウス食品Ｇ本社	28,100	3,062.00	86,042,200		
カ ゴ メ	35,100	3,067.00	107,651,700		
焼津水産化工	2,000	1,189.00	2,378,000		
アリアケジャパン	8,100	4,450.00	36,045,000		
ピエトロ	600	1,840.00	1,104,000	貸付株式数	200株
エバラ食品工業	2,000	2,781.00	5,562,000	貸付株式数	200株
やまみ	500	3,160.00	1,580,000		
ニチレイ	37,300	3,489.00	130,139,700		
横浜冷凍	23,900	1,061.00	25,357,900		
東洋水産	41,100	7,080.00	290,988,000		
イートアンドHLDGS	3,700	2,050.00	7,585,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
大冷	800	1,920.00	1,536,000		
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,700	1,049.00	3,881,300	貸付株式数	1,800株
日清食品ＨＤ	28,600	14,225.00	406,835,000		
永谷園ホールディングス	4,100	2,088.00	8,560,800		
一正蒲鉾	2,200	734.00	1,614,800	貸付株式数	300株
フジッコ	8,600	1,893.00	16,279,800		
ロックフィールド	9,300	1,524.00	14,173,200	貸付株式数	1,500株
日本たばこ産業	494,200	3,668.00	1,812,725,600	貸付株式数	197,300株
ケンコーマヨネーズ	5,700	1,645.00	9,376,500		
わらべや日洋HD	5,500	3,375.00	18,562,500		
なとり	5,300	2,036.00	10,790,800		
イフジ産業	900	1,349.00	1,214,100	貸付株式数	200株
ファーマフーズ	11,700	1,008.00	11,793,600	貸付株式数	4,600株
北の達人コーポ	34,800	205.00	7,134,000	貸付株式数	13,600株 (1,300株)
ユーグレナ	50,500	737.00	37,218,500	貸付株式数	20,200株
紀文食品	7,200	1,181.00	8,503,200	貸付株式数	100株
ピックルスホールディングス	4,900	1,188.00	5,821,200	貸付株式数	1,200株
スター・マイカ・HLDGS	9,400	593.00	5,574,200		
SREホールディングス	3,500	2,777.00	9,719,500	貸付株式数	1,500株
ADワークスグループ	11,600	231.00	2,679,600	貸付株式数	2,800株
片倉工業	7,600	1,637.00	12,441,200	貸付株式数	2,600株

グ ン ゼ	5,900	5,220.00	30,798,000	
ヒューリック	189,800	1,468.00	278,626,400	
神 栄	700	1,945.00	1,361,500	
ラサ商事	3,100	1,474.00	4,569,400	貸付株式数 900株
アルペン	7,100	1,962.00	13,930,200	貸付株式数 2,800株
ハブ	1,500	704.00	1,056,000	
ラクーンホールディングス	6,900	644.00	4,443,600	貸付株式数 1,700株
クオールホールディングス	12,000	1,667.00	20,004,000	
アルコニックス	11,600	1,280.00	14,848,000	
神戸物産	67,600	4,164.00	281,486,400	
ソリトンシステムズ	4,200	1,383.00	5,808,600	
ジンズホールディングス	5,200	4,505.00	23,426,000	貸付株式数 1,700株
ビックカメラ	46,400	1,266.00	58,742,400	貸付株式数 18,500株
DCMホールディングス	46,100	1,312.00	60,483,200	
ペッパーフードサービス	19,900	92.00	1,830,800	貸付株式数 7,900株
ハイパー	1,100	321.00	353,100	貸付株式数 400株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	123,800	1,574.00	194,861,200	
東京一番フーズ	1,100	497.00	546,700	
ＤＤグループ	3,100	1,304.00	4,042,400	貸付株式数 1,200株
あい ホールディングス	14,000	2,300.00	32,200,000	
ディーブイエックス	1,300	1,032.00	1,341,600	
きちりホールディングス	1,100	1,119.00	1,230,900	貸付株式数 500株
J. フロント リテイリング	100,300	1,284.00	128,785,200	
ドトール・日レスＨＤ	15,500	2,148.00	33,294,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	158,900	2,421.00	384,696,900	
ブロンコビリー	5,100	3,090.00	15,759,000	貸付株式数 1,900株
ＺＯＺＯ	57,700	3,161.00	182,389,700	
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,332.00	5,594,400	貸付株式数 1,600株
物語コーポレーション	14,600	4,135.00	60,371,000	貸付株式数 5,800株
三越伊勢丹ＨＤ	147,200	1,518.00	223,449,600	
東洋紡	35,700	1,026.00	36,628,200	
ユニチカ	26,900	170.00	4,573,000	貸付株式数 10,700株
富士紡ホールディングス	3,600	3,555.00	12,798,000	
日清紡ホールディングス	62,700	1,087.50	68,186,250	
倉敷紡績	6,200	2,420.00	15,004,000	
ダイワボウＨＤ	38,700	2,929.00	113,352,300	
シキボウ	3,700	1,056.00	3,907,200	
日東紡績	10,500	4,210.00	44,205,000	
トヨタ紡織	34,800	2,238.00	77,882,400	

マクニカホールディングス	20,700	7,583.00	156,968,100		
Ｈａｍｅｅ	3,000	870.00	2,610,000	貸付株式数	1,200株
マーケットエンタープライズ	500	1,017.00	508,500	貸付株式数	200株
ラクト・ジャパン	3,400	1,899.00	6,456,600	貸付株式数	1,300株
ウエルシアＨＤ	45,300	2,324.00	105,277,200		
クリエイトＳＤＨ	14,400	2,987.00	43,012,800	貸付株式数	5,700株
グリムス	3,700	1,913.00	7,078,100		
バイタルＫＳＫHD	13,200	1,025.00	13,530,000		
八洲電機	7,000	1,234.00	8,638,000	貸付株式数	200株
メディアスホールディングス	5,500	754.00	4,147,000		
レスターホールディングス	7,400	2,740.00	20,276,000		
ジオリーブグループ	1,100	1,246.00	1,370,600	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	5,600	328.00	1,836,800		
大光	2,300	657.00	1,511,100	貸付株式数	200株
OCHIホールディングス	1,100	1,401.00	1,541,100		
TOKAIホールディングス	47,300	948.00	44,840,400		
黒谷	1,300	583.00	757,900		
ミサワ	1,000	649.00	649,000		
ティーライフ	700	1,377.00	963,900	貸付株式数	100株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	900	777.00	699,300		
エー・ピーホールディングス	1,100	874.00	961,400	貸付株式数	500株
三洋貿易	9,900	1,205.00	11,929,500		
チムニー	1,500	1,413.00	2,119,500	貸付株式数	700株
シュッピン	7,900	1,135.00	8,966,500	貸付株式数	1,800株
ビューティガレージ	2,700	1,996.00	5,389,200		
オイシックス・ラ・大地	11,700	1,355.00	15,853,500	貸付株式数	4,600株
ウイン・パートナーズ	5,500	1,115.00	6,132,500	貸付株式数	500株
ネクステージ	19,900	2,471.00	49,172,900	貸付株式数	7,900株
ジョイフル本田	25,400	1,807.00	45,897,800	貸付株式数	10,100株
鳥貴族ホールディングス	3,200	3,155.00	10,096,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
ホットランド	6,600	1,907.00	12,586,200	貸付株式数	2,500株
すかいらーくHD	119,400	2,063.50	246,381,900	貸付株式数	47,700株
SFPホールディングス	4,800	2,092.00	10,041,600	貸付株式数	1,900株
綿半ホールディングス	6,600	1,365.00	9,009,000		
日本毛織	21,800	1,260.00	27,468,000		
ダイトウボウ	7,300	90.00	657,000	貸付株式数	800株

トーア紡コーポレーション	1,800	433.00	779,400	貸付株式数	700株
ダイドーリミテツド	6,600	417.00	2,752,200	貸付株式数	3,700株
ヨシックスホールディングス	1,600	2,715.00	4,344,000		
ユナイテッド・スーパーマーケ	24,200	990.00	23,958,000	貸付株式数	10,900株
野村不動産HLDGS	45,300	3,601.00	163,125,300		
三重交通グループHD	17,100	562.00	9,610,200	貸付株式数	2,700株
サムティ	13,000	2,312.00	30,056,000	貸付株式数	5,100株
地主	6,200	2,214.00	13,726,800	貸付株式数	2,300株
プレサンスコーポレーション	12,900	1,562.00	20,149,800	貸付株式数	4,800株
フィル・カンパニー	1,300	565.00	734,500	貸付株式数	500株
ハウスコム	700	887.00	620,900	貸付株式数	300株
ＪＰＭＣ	4,600	1,132.00	5,207,200		
サンセイランディック	1,300	1,023.00	1,329,900	貸付株式数	500株
エストラスト	500	642.00	321,000	貸付株式数	200株
フージャースHD	12,500	1,018.00	12,725,000		
オープンハウスグループ	29,800	4,099.00	122,150,200		
東急不動産ＨＤ	244,600	901.50	220,506,900		
飯田ＧＨＤ	78,000	2,171.00	169,338,000		
イーグランド	700	1,476.00	1,033,200	貸付株式数	300株
帝国繊維	9,300	1,992.00	18,525,600	貸付株式数	3,600株
日本コークス工業	83,800	118.00	9,888,400		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	693.00	2,702,700	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,200	1,093.00	1,311,600	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,600	1,376.00	4,953,600	貸付株式数	1,600株
あさひ	8,100	1,285.00	10,408,500		
日本調剤	5,900	1,305.00	7,699,500	貸付株式数	200株
コスモス薬品	8,600	15,440.00	132,784,000	貸付株式数	3,300株
シップヘルスケアHD	31,400	2,135.50	67,054,700		
トーエル	2,100	725.00	1,522,500	貸付株式数	900株
ソフトクリエイトHD	6,800	1,681.00	11,430,800		
セブン&アイ・HLDGS	301,100	5,381.00	1,620,219,100		
クリエイト・レストランツ・ホール	59,100	1,057.00	62,468,700	貸付株式数	23,900株
明治電機工業	3,400	1,359.00	4,620,600		
ツルハホールディングス	18,300	12,045.00	220,423,500		
デリカフーズHLDGS	2,400	579.00	1,389,600		

スターティアホールディングス	1,200	1,275.00	1,530,000	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	6,900	1,985.00	13,696,500		
フェリシモ	1,100	914.00	1,005,400	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	24,400	4,003.00	97,673,200	貸付株式数	6,400株
帝 人	79,500	1,294.50	102,912,750		
東 レ	554,300	725.30	402,033,790		
ク ラ レ	120,500	1,394.00	167,977,000		
旭 化 成	559,600	1,013.50	567,154,600		
TOKYO BASE	10,400	261.00	2,714,400	貸付株式数	4,000株
稲葉製作所	4,400	1,438.00	6,327,200	貸付株式数	1,700株
宮地エンジニアリングG	4,300	3,145.00	13,523,500	貸付株式数	1,600株
トーカロ	24,600	1,410.00	34,686,000		
アルファCO	1,700	1,366.00	2,322,200		
ＳＵＭＣＯ	151,400	2,193.00	332,020,200		
川田テクノロジーズ	2,000	6,220.00	12,440,000		
RS TECHNOLOGIES	5,700	2,855.00	16,273,500		
ジェイテックコーポレーション	600	1,812.00	1,087,200	貸付株式数	200株
信和	3,100	737.00	2,284,700	貸付株式数	1,100株
ビーロット	3,200	988.00	3,161,600	貸付株式数	1,200株
ファーストブラザーズ	1,000	944.00	944,000		
AND DOホールディングス	4,900	1,011.00	4,953,900	貸付株式数	1,700株
シーアールイー	4,500	1,335.00	6,007,500	貸付株式数	400株 (200株)
ケイアイスター不動産	3,900	3,105.00	12,109,500	貸付株式数	1,500株
アグレ都市デザイン	800	1,491.00	1,192,800		
ジェイ・エス・ビー	4,000	2,385.00	9,540,000		
ロードスターキャピタル	5,300	1,985.00	10,520,500		
テンポイノベーション	1,300	1,042.00	1,354,600	貸付株式数	400株
グロバルリンクマネジメント	800	2,235.00	1,788,000	貸付株式数	400株
フェイスネットワーク	1,200	1,340.00	1,608,000	貸付株式数	600株
霞ヶ関キャピタル	1,900	7,650.00	14,535,000	貸付株式数	700株
住江織物	900	2,137.00	1,923,300		
日本フエルト	2,700	419.00	1,131,300		
イチカワ	600	1,550.00	930,000		

エコナックホールディングス	4,300	137.00	589,100		
日東製網	500	1,519.00	759,500	貸付株式数	100株
芦森工業	900	2,014.00	1,812,600		
アツギ	3,100	509.00	1,577,900		
ウイルプラスHLDGS	800	978.00	782,400	貸付株式数	400株
JMホールディングス	6,500	2,156.00	14,014,000		
コメダホールディングス	21,300	2,694.00	57,382,200		
サツドラホールディングス	2,100	781.00	1,640,100	貸付株式数	1,100株
アレンザホールディングス	6,400	1,023.00	6,547,200	貸付株式数	700株
串カツ田中HLDGS	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数	900株
バロックジャパン	6,800	822.00	5,589,600	貸付株式数	2,700株
クスリのアオキHLDGS	23,400	3,305.00	77,337,000		
ダイニック	1,400	723.00	1,012,200		
共和レザー	2,600	728.00	1,892,800		
ピーバンドットコム	600	364.00	218,400	貸付株式数	200株
力の源HD	3,900	1,426.00	5,561,400	貸付株式数	1,500株
FOOD&LIFE COMPAN	46,600	2,866.00	133,555,600		
アセンテック	3,400	497.00	1,689,800	貸付株式数	100株
セーレン	15,900	2,490.00	39,591,000	貸付株式数	6,300株
ソトー	1,400	697.00	975,800	貸付株式数	100株
東海染工	400	904.00	361,600		
小松マテーレ	12,000	727.00	8,724,000		
ワコールホールディングス	16,900	3,369.00	56,936,100		
ホギメディカル	10,900	3,510.00	38,259,000		
クラウディアHLDGS	1,000	365.00	365,000	貸付株式数	500株
ＴＳＩホールディングス	27,800	761.00	21,155,800		
マツオカコーポレーション	1,400	1,572.00	2,200,800		
ワールド	11,700	1,683.00	19,691,100		
ＴＩＳ	90,600	3,075.00	278,595,000		
テクミラホールディングス	2,100	478.00	1,003,800	貸付株式数	700株
グリー	22,100	550.00	12,155,000		
GMOペパボ	1,000	1,181.00	1,181,000	貸付株式数	400株
コーエーテクモＨＤ	51,800	1,636.00	84,744,800	貸付株式数	20,700株
三菱総合研究所	4,100	4,615.00	18,921,500		
ボルテージ	1,300	255.00	331,500	貸付株式数	600株
電算	500	1,490.00	745,000	貸付株式数	200株
ＡＧＳ	1,900	790.00	1,501,000		
ファインデックス	6,600	955.00	6,303,000		

ブレインパッド	6,200	959.00	5,945,800		
ＫＬａｂ	15,300	277.00	4,238,100	貸付株式数	5,700株
ポールトゥウィンホールディン	14,100	450.00	6,345,000		
ネクソン	185,000	2,864.50	529,932,500		
アイスタイル	24,500	425.00	10,412,500	貸付株式数	9,600株 (3,800株)
エムアップホールディングス	10,100	1,014.00	10,241,400		
エイチーム	4,900	560.00	2,744,000		
エニグモ	10,600	332.00	3,519,200		
テクノスジャパン	4,100	617.00	2,529,700		
ｅｎｉｓｈ	4,000	175.00	700,000	貸付株式数	1,600株
コロプラ	32,000	596.00	19,072,000		
オルトプラス	3,800	140.00	532,000	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	39,300	581.00	22,833,300		
クロス・マーケティングG	2,700	535.00	1,444,500	貸付株式数	1,000株
デジタルハーツHLDGS	5,200	945.00	4,914,000	貸付株式数	2,000株
メディアドゥ	3,700	1,397.00	5,168,900	貸付株式数	1,400株
じげん	24,100	511.00	12,315,100		
ブイキューブ	9,900	305.00	3,019,500	貸付株式数	3,800株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	1,000	506.00	506,000	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	1,800	713.00	1,283,400	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	204.00	877,200		
フィックスターズ	9,300	1,236.00	11,494,800		
CARTA HOLDINGS	3,900	1,309.00	5,105,100	貸付株式数	1,500株
オプティム	8,400	792.00	6,652,800	貸付株式数	2,600株
セレス	3,300	1,055.00	3,481,500	貸付株式数	1,300株
ＳＨＩＦＴ	5,500	34,480.00	189,640,000		
特種東海製紙	4,500	3,775.00	16,987,500		
ティーガイア	8,600	1,854.00	15,944,400		
セック	900	4,470.00	4,023,000		
テクマトリックス	15,100	1,677.00	25,322,700		
プロシップ	4,000	1,339.00	5,356,000	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	21,500	2,258.00	48,547,000		
GMOペイメントゲートウェイ	16,500	8,854.00	146,091,000	貸付株式数	6,600株
ザッパラス	1,200	467.00	560,400	貸付株式数	700株
システムリサーチ	2,800	2,958.00	8,282,400	貸付株式数	900株

インターネットイニシアティブ	39,600	2,762.00	109,375,200		
さくらインターネット	9,300	1,862.00	17,316,600	貸付株式数	3,700株
ヴィンクス	1,100	2,014.00	2,215,400		
GMOグローバルサインHD	2,500	2,601.00	6,502,500	貸付株式数	1,000株
SRAホールディングス	4,200	3,465.00	14,553,000		
システムインテグレータ	1,300	394.00	512,200		
朝日ネット	8,800	609.00	5,359,200		
ｅＢＡＳＥ	11,700	746.00	8,728,200		
アバントグループ	10,400	1,371.00	14,258,400		
アドソル日進	3,500	1,527.00	5,344,500		
ODKソリューションズ	900	587.00	528,300	貸付株式数	600株
フリービット	4,300	1,344.00	5,779,200	貸付株式数	1,700株
コムチュア	11,900	1,792.00	21,324,800		
サイバーコム	700	1,903.00	1,332,100		
アステリア	6,500	648.00	4,212,000	貸付株式数	2,400株
アイル	3,900	3,080.00	12,012,000		
王子ホールディングス	344,500	521.70	179,725,650		
日本製紙	46,600	1,320.00	61,512,000		
三菱製紙	6,200	511.00	3,168,200	貸付株式数	2,400株
北越コーポレーション	40,600	1,558.00	63,254,800	貸付株式数	16,200株
中越パルプ	1,900	1,755.00	3,334,500	貸付株式数	300株
巴川製紙	1,300	913.00	1,186,900	貸付株式数	700株
大王製紙	36,400	1,112.50	40,495,000		
阿波製紙	1,200	376.00	451,200	貸付株式数	400株
マークラインズ	4,500	2,604.00	11,718,000		
メディカル・データ・ビジ	9,800	604.00	5,919,200	貸付株式数	4,400株
ｇｕｍｉ	12,200	370.00	4,514,000	貸付株式数	4,800株
ショーケース	1,000	296.00	296,000	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	1,000	642.00	642,000	貸付株式数	400株
テラスカイ	3,600	1,523.00	5,482,800	貸付株式数	1,400株
デジタル・インフォメーション	4,800	1,570.00	7,536,000		
PCIホールディングス	1,800	1,040.00	1,872,000	貸付株式数	200株
アイビーシー	700	468.00	327,600	貸付株式数	200株
ネオジャパン	2,700	984.00	2,656,800	貸付株式数	1,000株 (100株)
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	1,700	1,720.00	2,924,000	貸付株式数	600株
ラクス	39,100	2,602.50	101,757,750		
ランドコンピュータ	2,200	860.00	1,892,000		

ダブルスタンダード	2,500	1,434.00	3,585,000	貸付株式数	1,200株
オープンドア	4,900	778.00	3,812,200	貸付株式数	2,200株
マイネット	1,400	281.00	393,400	貸付株式数	600株
アカツキ	4,000	2,089.00	8,356,000		
ベネフィットジャパン	300	1,212.00	363,600	貸付株式数	200株
UBICOMホールディングス	2,600	1,602.00	4,165,200		
カナミックネットワーク	8,800	382.00	3,361,600		
ノムラシステムコーポレーション	4,900	115.00	563,500	貸付株式数	2,800株
レンゴー	75,200	906.90	68,198,880		
トーモク	4,700	2,063.00	9,696,100		
ザ・パック	6,100	3,140.00	19,154,000	貸付株式数	2,400株
チェンジホールディングス	18,000	1,412.00	25,416,000		
シンクロ・フード	2,900	737.00	2,137,300	貸付株式数	1,300株
オークネット	3,300	1,790.00	5,907,000	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	900	695.00	625,500		
セグエグループ	1,400	920.00	1,288,000	貸付株式数	500株
エイトレッド	700	1,385.00	969,500		
マクロミル	16,300	775.00	12,632,500		
ビーグリー	900	1,199.00	1,079,100		
オロ	3,000	2,772.00	8,316,000	貸付株式数	1,200株
ユーザーローカル	3,000	1,766.00	5,298,000	貸付株式数	1,200株
テモナ	1,000	220.00	220,000	貸付株式数	200株
ニーズウェル	2,500	723.00	1,807,500	貸付株式数	1,200株
マネーフォワード	18,400	4,199.00	77,261,600	貸付株式数	6,700株
サインポスト	1,800	356.00	640,800	貸付株式数	800株
レゾナック・ホールディング	79,900	2,888.00	230,751,200		
住友化学	613,600	327.20	200,769,920		
住友精化	3,900	4,670.00	18,213,000		
日産化学	38,900	5,279.00	205,353,100		
ラサ工業	3,200	2,060.00	6,592,000		
クレハ	6,000	8,600.00	51,600,000		
多木化学	3,200	3,330.00	10,656,000	貸付株式数	1,200株
テイカ	7,100	1,331.00	9,450,100		
石原産業	13,700	1,310.00	17,947,000		
片倉コープアグリ	1,100	1,080.00	1,188,000	貸付株式数	400株
日本曹達	9,800	5,410.00	53,018,000		
東ソー	110,500	1,758.00	194,259,000		

トクヤマ	26,700	2,268.00	60,555,600	
セントラル硝子	8,800	2,630.00	23,144,000	
東亞合成	41,400	1,290.50	53,426,700	
大阪ソーダ	5,800	8,920.00	51,736,000	貸付株式数　2,300株
関東電化	16,000	816.00	13,056,000	
SUN ASTERISK	5,900	896.00	5,286,400	貸付株式数　2,300株
デンカ	30,100	2,412.50	72,616,250	
イビデン	43,500	7,588.00	330,078,000	
信越化学	750,000	5,465.00	4,098,750,000	
日本カーバイド	3,100	1,398.00	4,333,800	
電算システムＨＤ	3,700	2,651.00	9,808,700	
堺 化 学	6,300	1,816.00	11,440,800	
第一稀元素化学工	9,000	944.00	8,496,000	貸付株式数　800株
エア・ウォーター	78,000	1,841.00	143,598,000	
日本酸素HLDGS	80,200	3,757.00	301,311,400	
日本化学工業	3,000	1,853.00	5,559,000	
東邦アセチレン	1,000	1,910.00	1,910,000	
日本パーカライジング	36,900	1,109.00	40,922,100	貸付株式数　1,900株
高圧ガス	11,800	865.00	10,207,000	
チタン工業	600	1,205.00	723,000	貸付株式数　200株
四国化成ホールディンク	10,600	1,644.00	17,426,400	
戸田工業	1,900	1,559.00	2,962,100	貸付株式数　600株
ステラ ケミファ	4,500	3,210.00	14,445,000	
保土谷化学	2,600	3,470.00	9,022,000	
日本触媒	12,600	5,260.00	66,276,000	
大日精化	5,800	2,454.00	14,233,200	
カネカ	21,000	3,506.00	73,626,000	
協和キリン	100,100	2,388.50	239,088,850	
APPIER GROUP	28,300	1,624.00	45,959,200	
三菱瓦斯化学	61,800	2,194.00	135,589,200	
三井化学	68,200	4,148.00	282,893,600	
ＪＳＲ	90,100	4,060.00	365,806,000	
東京応化工業	13,200	9,035.00	119,262,000	
大阪有機化学	6,900	2,615.00	18,043,500	
三菱ケミカルグループ	604,700	929.40	562,008,180	
ＫＨネオケム	12,600	2,249.00	28,337,400	
ダイセル	106,300	1,313.00	139,571,900	
住友ベークライト	12,300	7,226.00	88,879,800	
積水化学	167,700	1,989.00	333,555,300	
日本ゼオン	56,700	1,300.50	73,738,350	

アイカ工業	20,800	3,251.00	67,620,800	
ＵＢＥ	39,400	2,187.00	86,167,800	
積水樹脂	12,300	2,447.00	30,098,100	
タキロンシーアイ	20,900	640.00	13,376,000	
旭有機材	5,500	3,780.00	20,790,000	
ニチバン	4,400	1,695.00	7,458,000	
リケンテクノス	17,700	788.00	13,947,600	
大倉工業	3,800	2,668.00	10,138,400	貸付株式数 1,500株 (100株)
積水化成品	11,600	487.00	5,649,200	
群栄化学	1,900	2,926.00	5,559,400	
タイガース ポリマー	2,100	800.00	1,680,000	
ミライアル	1,600	1,440.00	2,304,000	貸付株式数 600株
ダイキアクシス	1,900	768.00	1,459,200	貸付株式数 700株
ダイキョーニシカワ	18,400	705.00	12,972,000	
竹本容器	1,700	791.00	1,344,700	
森六ホールディングス	4,700	2,781.00	13,070,700	
恵和	6,000	1,215.00	7,290,000	貸付株式数 2,300株
日本化薬	63,100	1,303.00	82,219,300	
カーリットホールディングス	9,000	914.00	8,226,000	貸付株式数 100株
ソルクシーズ	3,600	405.00	1,458,000	
CLホールディングス	2,000	852.00	1,704,000	貸付株式数 800株
プレステージ・インター	39,700	576.00	22,867,200	
フェイス	1,300	475.00	617,500	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	9,000	1,328.00	11,952,000	
ハイマックス	2,500	1,369.00	3,422,500	
アミューズ	5,200	1,473.00	7,659,600	
野村総合研究所	183,500	4,055.00	744,092,500	
ドリームインキュベータ	2,800	2,791.00	7,814,800	貸付株式数 100株
サイバネットシステム	5,900	1,092.00	6,442,800	
クイック	5,900	2,395.00	14,130,500	
ＴＡＣ	2,200	199.00	437,800	貸付株式数 200株
ＣＥホールディングス	2,400	614.00	1,473,600	
日本システム技術	2,700	2,727.00	7,362,900	
電通グループ	83,400	3,586.00	299,072,400	
インテージホールディングス	9,300	1,514.00	14,080,200	
テイクアンドギヴニーズ	2,900	1,113.00	3,227,700	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	2,700	1,143.00	3,086,100	

ぴあ	2,900	3,315.00	9,613,500	貸付株式数	1,100株
イオンファンタジー	3,000	2,455.00	7,365,000	貸付株式数	1,300株
ソースネクスト	38,000	165.00	6,270,000	貸付株式数	15,800株
シーティーエス	10,600	620.00	6,572,000		
ネクシィーズグループ	1,400	714.00	999,600	貸付株式数	500株
インフォコム	10,700	2,336.00	24,995,200		
メディカルシステムネットワーク	9,300	634.00	5,896,200		
日本精化	5,500	2,793.00	15,361,500	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	8,700	4,170.00	36,279,000		
トリケミカル	10,000	3,610.00	36,100,000		
シンプレクスHD	12,400	2,508.00	31,099,200		
ＨＥＲＯＺ	2,800	1,680.00	4,704,000	貸付株式数	1,100株
ラクスル	19,900	1,206.00	23,999,400	貸付株式数	7,900株
メルカリ	50,200	2,589.50	129,992,900		
ＩＰＳ	2,300	1,989.00	4,574,700	貸付株式数	900株
ＦＩＧ	5,200	339.00	1,762,800	貸付株式数	2,800株
システムサポート	3,200	1,795.00	5,744,000	貸付株式数	1,100株
ＡＤＥＫＡ	28,900	2,736.00	79,070,400		
日油	25,600	6,802.00	174,131,200		
ミヨシ油脂	1,800	1,333.00	2,399,400	貸付株式数	600株
新日本理化	6,200	178.00	1,103,600	貸付株式数	2,800株
ハリマ化成グループ	4,400	783.00	3,445,200	貸付株式数	1,700株
イーソル	6,000	570.00	3,420,000	貸付株式数	2,300株
東海ソフト	700	1,115.00	780,500		
ウイングアーク1ST	8,600	2,940.00	25,284,000		
ヒト・コミュニケーションズHD	2,200	1,200.00	2,640,000	貸付株式数	800株
サーバーワークス	1,700	3,205.00	5,448,500	貸付株式数	600株
東名	400	1,716.00	686,400	貸付株式数	100株
ヴィッツ	500	890.00	445,000	貸付株式数	100株
トビラシステムズ	1,300	880.00	1,144,000	貸付株式数	100株
Ｓａｎｓａｎ	27,100	1,617.00	43,820,700		
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,100	713.00	784,300	貸付株式数	500株
ギフティ	7,200	1,782.00	12,830,400	貸付株式数	3,000株
花 王	187,000	5,820.00	1,088,340,000		
第一工業製薬	3,300	1,780.00	5,874,000		
石原ケミカル	3,700	1,893.00	7,004,100		
日華化学	1,800	924.00	1,663,200	貸付株式数	900株
ニイタカ	800	1,911.00	1,528,800		

三洋化成	5,100	4,245.00	21,649,500	
メドレー	11,100	4,320.00	47,952,000	
ベース	2,800	3,395.00	9,506,000	貸付株式数　1,000株
ＪＭＤＣ	14,100	4,107.00	57,908,700	貸付株式数　700株
武田薬品	732,900	3,929.00	2,879,564,100	
アステラス製薬	726,500	1,632.50	1,186,011,250	
住友ファーマ	61,400	427.00	26,217,800	
塩野義製薬	104,400	6,952.00	725,788,800	
わかもと製薬	4,700	190.00	893,000	貸付株式数　1,800株
日本新薬	21,700	4,925.00	106,872,500	
中外製薬	259,200	5,304.00	1,374,796,800	
科研製薬	14,200	3,189.00	45,283,800	
エーザイ	100,700	7,103.00	715,272,100	
理研ビタミン	7,100	2,181.00	15,485,100	
ロート製薬	80,200	2,721.50	218,264,300	
小野薬品	175,800	2,494.00	438,445,200	
久光製薬	18,400	4,411.00	81,162,400	
有機合成薬品	3,600	279.00	1,004,400	貸付株式数　600株
持田製薬	9,500	3,260.00	30,970,000	
参天製薬	150,900	1,375.00	207,487,500	
扶桑薬品	2,900	1,870.00	5,423,000	貸付株式数　1,100株
日本ケミファ	500	1,614.00	807,000	
ツムラ	26,000	2,625.50	68,263,000	
テ ル モ	230,900	4,672.00	1,078,764,800	
ＨＵグループＨＤ	24,800	2,596.50	64,393,200	
キッセイ薬品工業	13,700	3,050.00	41,785,000	
生化学工業	13,900	736.00	10,230,400	
栄研化学	16,100	1,713.00	27,579,300	
鳥居薬品	4,400	3,460.00	15,224,000	
ＪＣＲファーマ	28,000	1,140.00	31,920,000	貸付株式数　9,900株
東和薬品	12,700	2,286.00	29,032,200	
富士製薬工業	6,000	1,648.00	9,888,000	
ゼリア新薬工業	11,400	1,944.00	22,161,600	
そーせいグループ	26,700	1,417.00	37,833,900	貸付株式数　10,600株
第一三共	721,400	4,005.00	2,889,207,000	
杏林製薬	17,800	1,733.00	30,847,400	
大幸薬品	17,000	286.00	4,862,000	貸付株式数　6,800株
ダイト	6,300	1,861.00	11,724,300	
大塚ホールディングス	172,300	5,184.00	893,203,200	
大正製薬ＨＤ	18,400	8,623.00	158,663,200	

ペプチドリーム	40,100	1,189.50	47,698,950	
大日本塗料	9,200	990.00	9,108,000	貸付株式数　2,300株
日本ペイントHOLD	439,200	1,110.50	487,731,600	
関西ペイント	81,100	2,384.00	193,342,400	
神東塗料	3,800	126.00	478,800	貸付株式数　1,800株
中国塗料	17,000	1,602.00	27,234,000	
日本特殊塗料	3,300	1,162.00	3,834,600	
藤倉化成	10,100	417.00	4,211,700	
太陽ホールディングス	14,400	3,065.00	44,136,000	貸付株式数　2,000株
ＤＩＣ	32,300	2,502.50	80,830,750	
サカタインクス	18,400	1,296.00	23,846,400	貸付株式数　4,700株
東洋インキSCホールディン	18,000	2,687.00	48,366,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7,900	1,430.00	11,297,000	
アルプス技研	8,000	2,683.00	21,464,000	
サニックス	13,600	338.00	4,596,800	
日本空調サービス	8,900	779.00	6,933,100	
オリエンタルランド	449,200	5,283.00	2,373,123,600	
フォーカスシステムズ	5,500	973.00	5,351,500	
ダスキン	18,900	3,338.00	63,088,200	
パーク２４	52,800	1,909.00	100,795,200	
明光ネットワークジャパン	10,300	718.00	7,395,400	貸付株式数　3,700株
ファルコホールディングス	3,800	2,060.00	7,828,000	
クレスコ	6,800	1,802.00	12,253,600	
フジ・メディア・HD	79,500	1,650.00	131,175,000	
秀英予備校	1,000	308.00	308,000	
田谷	800	405.00	324,000	貸付株式数　100株 (100株)
ラウンドワン	79,900	562.00	44,903,800	
リゾートトラスト	36,900	2,394.50	88,357,050	
オービック	27,700	23,090.00	639,593,000	
ジャストシステム	11,900	3,115.00	37,068,500	
ＴＤＣソフト	7,800	2,044.00	15,943,200	
ＬＩＮＥヤフー	1,178,900	475.00	559,977,500	
ビー・エム・エル	10,400	2,954.00	30,721,600	
トレンドマイクロ	39,200	7,793.00	305,485,600	
IDホールディングス	5,600	1,628.00	9,116,800	
リソー教育	43,500	216.00	9,396,000	
日本オラクル	15,800	11,045.00	174,511,000	
早稲田アカデミー	4,700	1,807.00	8,492,900	貸付株式数　1,700株
アルファシステムズ	2,200	2,954.00	6,498,800	

フューチャー	17,700	1,716.00	30,373,200	
CAC HOLDINGS	4,400	1,741.00	7,660,400	
ＳＢテクノロジー	3,500	2,500.00	8,750,000	
トーセ	1,300	689.00	895,700	貸付株式数　100株
ユー・エス・エス	95,200	2,757.50	262,514,000	
オービックビジネスＣ	11,600	6,643.00	77,058,800	
アイティフォー	10,600	1,161.00	12,306,600	
東京個別指導学院	10,100	452.00	4,565,200	貸付株式数　1,500株
東計電算	1,100	7,150.00	7,865,000	貸付株式数　300株
サイバーエージェント	187,600	840.20	157,621,520	
楽天グループ	726,900	581.10	422,401,590	
エックスネット	600	1,079.00	647,400	貸付株式数　300株
クリーク・アンド・リバー社	4,300	2,024.00	8,703,200	
SBIグローバルアセット	16,400	577.00	9,462,800	
テー・オー・ダブリュー	16,900	324.00	5,475,600	
大塚商会	41,100	5,980.00	245,778,000	
サイボウズ	11,400	2,132.00	24,304,800	
山田コンサルティングGP	3,700	1,723.00	6,375,100	
セントラルスポーツ	3,200	2,412.00	7,718,400	貸付株式数　1,100株
パラカ	2,900	1,870.00	5,423,000	
電通国際情報Ｓ	10,100	5,870.00	59,287,000	
ＡＣＣＥＳＳ	8,600	768.00	6,604,800	貸付株式数　3,400株
デジタルガレージ	13,200	3,700.00	48,840,000	
イーエムシステムズ	13,800	685.00	9,453,000	貸付株式数　1,000株
ウェザーニューズ	2,600	5,410.00	14,066,000	貸付株式数　900株
ＣＩＪ	13,700	625.00	8,562,500	
ビジネスエンジニアリング	1,400	4,195.00	5,873,000	貸付株式数　500株
日本エンタープライズ	4,700	117.00	549,900	貸付株式数　2,100株
WOWOW	6,100	1,048.00	6,392,800	貸付株式数　2,300株
スカラ	7,800	758.00	5,912,400	
インテリジェント ウェイブ	2,400	1,051.00	2,522,400	貸付株式数　1,100株
フルキャストホールディングス	8,100	1,769.00	14,328,900	
エン・ジャパン	13,800	2,593.00	35,783,400	
セルソース	2,300	1,361.00	3,130,300	貸付株式数　900株
あすか製薬ＨＤ	8,500	1,730.00	14,705,000	
サワイグループHD	18,900	4,982.00	94,159,800	
富士フイルムHLDGS	153,700	8,388.00	1,289,235,600	
コニカミノルタ	186,200	425.40	79,209,480	

資 生 堂	172,900	3,858.00	667,048,200	
ライオン	108,400	1,306.50	141,624,600	
高砂香料	6,200	3,305.00	20,491,000	
マンダム	17,900	1,259.00	22,536,100	
ミルボン	11,200	3,468.00	38,841,600	
ファンケル	36,200	2,291.50	82,952,300	
コーセー	16,800	10,510.00	176,568,000	
コタ	7,400	1,513.00	11,196,200	
シーボン	600	1,483.00	889,800	
ポーラ・オルビスHD	42,400	1,579.50	66,970,800	
ノエビアホールディングス	7,400	5,040.00	37,296,000	
アジュバンホールディング	1,100	917.00	1,008,700	
新日本製薬	4,700	1,639.00	7,703,300	
アクシージア	4,200	938.00	3,939,600	貸付株式数 1,600株
エステー	6,200	1,497.00	9,281,400	
アグロカネショウ	3,300	1,540.00	5,082,000	
コ ニ シ	13,800	2,489.00	34,348,200	
長谷川香料	15,800	3,130.00	49,454,000	
小林製薬	24,100	6,573.00	158,409,300	
荒川化学工業	6,900	1,012.00	6,982,800	
メック	6,800	4,200.00	28,560,000	貸付株式数 2,500株
日本高純度化学	1,800	2,390.00	4,302,000	
タカラバイオ	22,300	1,198.00	26,715,400	
ＪＣＵ	9,300	3,580.00	33,294,000	
新田ゼラチン	3,300	751.00	2,478,300	貸付株式数 1,500株
ＯＡＴアグリオ	2,400	1,740.00	4,176,000	貸付株式数 900株
デクセリアルズ	20,800	4,053.00	84,302,400	
アース製薬	7,500	4,665.00	34,987,500	貸付株式数 3,000株
北興化学	8,400	965.00	8,106,000	
大成ラミック	2,400	2,780.00	6,672,000	
クミアイ化学	32,900	788.00	25,925,200	貸付株式数 8,000株
日本農薬	15,200	630.00	9,576,000	
富士興産	1,300	1,788.00	2,324,400	
ニチレキ	10,700	2,404.00	25,722,800	
ユシロ化学	4,300	1,576.00	6,776,800	
ビーピー・カストロール	1,700	886.00	1,506,200	
富士石油	24,100	355.00	8,555,500	貸付株式数 6,000株
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,600	1,243.00	1,988,800	
出光興産	92,000	3,811.00	350,612,000	
ENEOSホールディングス	1,311,200	570.40	747,908,480	

コスモエネルギーHLDGS	24,600	5,438.00	133,774,800	
テスホールディングス	17,500	415.00	7,262,500	貸付株式数 6,700株
インフロニアＨＤ	93,300	1,426.00	133,045,800	
横浜ゴム	41,900	3,135.00	131,356,500	
TOYO TIRE	47,600	2,340.00	111,384,000	
ブリヂストン	242,400	5,850.00	1,418,040,000	
住友ゴム	81,200	1,586.00	128,783,200	
藤倉コンポジット	5,600	1,342.00	7,515,200	
オカモト	3,900	4,985.00	19,441,500	
アキレス	5,200	1,532.00	7,966,400	
フ コ ク	4,300	1,322.00	5,684,600	
ニッタ	8,400	3,585.00	30,114,000	
クリエートメディック	1,500	901.00	1,351,500	
住友理工	12,900	1,002.00	12,925,800	
三ツ星ベルト	10,100	4,315.00	43,581,500	貸付株式数 4,000株
バンドー化学	12,300	1,525.00	18,757,500	
ＡＧＣ	77,200	5,312.00	410,086,400	
日本板硝子	39,500	552.00	21,804,000	
石塚硝子	800	3,420.00	2,736,000	貸付株式数 300株
有沢製作所	14,500	1,032.00	14,964,000	
日本山村硝子	1,700	1,384.00	2,352,800	貸付株式数 600株
日本電気硝子	33,800	3,063.00	103,529,400	
オハラ	3,900	1,064.00	4,149,600	貸付株式数 1,400株
住友大阪セメント	13,800	3,622.00	49,983,600	
太平洋セメント	49,000	2,693.50	131,981,500	
リソルホールディングス	400	5,330.00	2,132,000	
日本ヒユーム	7,200	868.00	6,249,600	貸付株式数 100株
日本コンクリート	15,800	314.00	4,961,200	
三谷セキサン	3,500	4,465.00	15,627,500	
アジアパイルＨＤ	11,800	671.00	7,917,800	
東海カーボン	76,400	1,027.00	78,462,800	
日本カーボン	4,400	4,580.00	20,152,000	
東洋炭素	5,800	4,675.00	27,115,000	
ノリタケ	4,600	6,610.00	30,406,000	
ＴＯＴＯ	54,700	3,640.00	199,108,000	
日本碍子	96,300	1,689.00	162,650,700	
日本特殊陶業	69,400	3,311.00	229,783,400	
ダントーホールディングス	3,000	956.00	2,868,000	貸付株式数 2,000株
ＭＡＲＵＷＡ	3,100	26,650.00	82,615,000	
品川リフラクトリーズ	10,200	1,644.00	16,768,800	

黒崎播磨	1,700	10,710.00	18,207,000	
ヨータイ	5,100	1,486.00	7,578,600	
東京窯業	4,800	417.00	2,001,600	
ニッカトー	2,100	546.00	1,146,600	
フジミインコーポレーテッド	22,200	2,710.00	60,162,000	
クニミネ工業	1,300	970.00	1,261,000	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	900	1,259.00	1,133,100	
ニチアス	20,900	3,235.00	67,611,500	
日本製鉄	381,500	3,239.00	1,235,678,500	
神戸製鋼所	171,300	1,658.00	284,015,400	
中山製鋼所	19,500	799.00	15,580,500	
合同製鐵	4,800	4,365.00	20,952,000	
ＪＦＥホールディングス	236,900	2,101.50	497,845,350	
東京製鐵	23,900	1,714.00	40,964,600	
共英製鋼	9,700	1,945.00	18,866,500	
大和工業	16,100	7,203.00	115,968,300	
東京鐵鋼	3,800	3,875.00	14,725,000	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,900	2,202.00	8,587,800	貸付株式数 400株
淀川製鋼所	9,600	3,715.00	35,664,000	貸付株式数 3,700株
中部鋼鈑	5,600	1,997.00	11,183,200	貸付株式数 1,700株
丸一鋼管	25,900	3,659.00	94,768,100	
モリ工業	1,500	4,255.00	6,382,500	
大同特殊鋼	10,700	7,033.00	75,253,100	
日本高周波	1,800	534.00	961,200	貸付株式数 900株
日本冶金工	6,200	4,070.00	25,234,000	
山陽特殊製鋼	8,400	2,863.00	24,049,200	
愛知製鋼	4,900	3,055.00	14,969,500	
日本金属	1,200	868.00	1,041,600	貸付株式数 400株
ミガロホールディングス	700	1,545.00	1,081,500	
大平洋金属	7,300	1,214.00	8,862,200	貸付株式数 2,200株
新日本電工	42,300	274.00	11,590,200	
栗本鉄工所	3,900	3,045.00	11,875,500	
虹 技	600	1,117.00	670,200	
日本鋳鉄管	500	1,077.00	538,500	貸付株式数 200株
日本製鋼所	23,000	2,435.00	56,005,000	
三菱製鋼	6,300	1,421.00	8,952,300	
日亜鋼業	4,700	315.00	1,480,500	
日本精線	1,300	4,765.00	6,194,500	貸付株式数 100株
エンビプロＨＤ	4,500	581.00	2,614,500	貸付株式数 1,800株

大紀アルミニウム	10,700	1,162.00	12,433,400		
日本軽金属ＨＤ	24,800	1,670.00	41,416,000		
三井金属	24,800	4,290.00	106,392,000		
東邦亜鉛	5,400	1,090.00	5,886,000	貸付株式数	2,100株
三菱マテリアル	60,900	2,426.00	147,743,400		
住友鉱山	98,800	4,236.00	418,516,800		
DOWAホールディングス	21,000	4,990.00	104,790,000	貸付株式数	2,200株
古河機金	11,200	1,849.00	20,708,800		
エス・サイエンス	27,700	22.00	609,400	貸付株式数	15,200株
大阪チタニウム	14,800	2,758.00	40,818,400	貸付株式数	5,900株
東邦チタニウム	17,600	1,836.00	32,313,600	貸付株式数	7,000株
ＵＡＣＪ	11,900	3,765.00	44,803,500		
ＣＫサンエツ	2,000	3,715.00	7,430,000	貸付株式数	100株
古河電工	28,400	2,174.00	61,741,600		
住友電工	318,800	1,762.50	561,885,000		
フジクラ	100,500	1,045.50	105,072,750		
ＳＷＣＣ	9,500	2,666.00	25,327,000		
タツタ電線	15,000	680.00	10,200,000	貸付株式数	900株
カナレ電気	800	1,544.00	1,235,200	貸付株式数	100株
平河ヒューテック	5,400	1,223.00	6,604,200	貸付株式数	1,600株
いよぎんホールディンク	96,800	909.10	88,000,880		
しずおかフィナンシャルク	180,800	1,148.50	207,648,800		
ちゅうぎんフィナンシャ	68,500	1,010.00	69,185,000		
楽天銀行	28,400	2,251.00	63,928,400	貸付株式数	10,600株
京都フィナンシャルＧ	25,800	8,461.00	218,293,800		
リョービ	9,100	2,658.00	24,187,800	貸付株式数	3,500株
アーレステイ	5,200	710.00	3,692,000	貸付株式数	2,000株
AREホールディングス	31,800	1,882.00	59,847,600		
東洋製罐グループHD	50,800	2,184.00	110,947,200		
ホッカンホールディングス	4,200	1,624.00	6,820,800		
コロナ	4,600	944.00	4,342,400		
横河ブリッジHLDGS	13,400	2,516.00	33,714,400		
駒井ハルテック	800	2,017.00	1,613,600		
高田機工	300	3,295.00	988,500		
三和ホールディングス	85,600	2,124.50	181,857,200		
文化シヤッター	22,200	1,348.00	29,925,600	貸付株式数	400株
三協立山	9,700	780.00	7,566,000	貸付株式数	3,500株
アルインコ	6,400	979.00	6,265,600	貸付株式数	1,600株
東洋シヤッター	1,100	634.00	697,400	貸付株式数	300株
ＬＩＸＩＬ	133,000	1,723.50	229,225,500		

日本フイルコン	3,000	466.00	1,398,000	貸付株式数	1,200株
ノーリツ	14,100	1,512.00	21,319,200		
長府製作所	8,400	2,018.00	16,951,200		
リンナイ	41,700	3,164.00	131,938,800		
ユニプレス	14,800	948.00	14,030,400		
ダイニチ工業	2,300	697.00	1,603,100		
日東精工	12,300	527.00	6,482,100		
三洋工業	500	2,466.00	1,233,000		
岡 部	15,100	712.00	10,751,200		
ジーテクト	10,800	1,647.00	17,787,600		
東 プ レ	15,000	1,913.00	28,695,000		
高周波熱錬	13,100	960.00	12,576,000	貸付株式数	2,600株
東京製綱	5,500	1,297.00	7,133,500		
サンコール	6,500	446.00	2,899,000	貸付株式数	2,600株
モリテックスチル	4,100	284.00	1,164,400	貸付株式数	1,600株
パイオラックス	10,600	2,173.00	23,033,800		
エイチワン	8,600	759.00	6,527,400		
日本発条	75,400	1,105.50	83,354,700		
中央発條	6,300	692.00	4,359,600		
アドバネクス	600	960.00	576,000	貸付株式数	400株
三浦工業	34,800	2,789.50	97,074,600		
タ ク マ	28,200	1,720.00	48,504,000		
テクノプロ・ホールディング	50,200	3,547.00	178,059,400		
アトラグループ	1,400	195.00	273,000	貸付株式数	600株
アイ・アールジャパンHD	4,400	1,503.00	6,613,200	貸付株式数	1,700株
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,200	6,840.00	35,568,000		
ファーストロジック	1,100	499.00	548,900		
三機サービス	700	1,142.00	799,400	貸付株式数	200株
Ｇｕｎｏｓｙ	6,800	696.00	4,732,800	貸付株式数	1,100株
デザインワン・ジャパン	1,300	132.00	171,600	貸付株式数	500株
イー・ガーディアン	3,200	1,540.00	4,928,000		
リブセンス	2,100	259.00	543,900	貸付株式数	1,000株
ジャパンマテリアル	25,900	2,404.00	62,263,600		
ベクトル	10,400	1,075.00	11,180,000	貸付株式数	4,000株
ウチヤマホールディングス	2,000	345.00	690,000	貸付株式数	200株
チャームケアコーポレーション	7,100	1,172.00	8,321,200		
キャリアリンク	3,100	2,288.00	7,092,800	貸付株式数	1,200株

ＩＢＪ	6,500	673.00	4,374,500	貸付株式数	2,600株
アサンテ	4,100	1,633.00	6,695,300	貸付株式数	1,600株
バリューＨＲ	7,400	1,557.00	11,521,800	貸付株式数	2,900株
M&Aキャピタルパートナー	6,900	2,352.00	16,228,800	貸付株式数	2,700株
ライドオンエクスプレスHD	3,300	1,007.00	3,323,100		
ERIホールディングス	1,200	1,624.00	1,948,800		
アビスト	700	2,964.00	2,074,800		
シグマクシス・ホールディンク	11,400	1,330.00	15,162,000		
ウィルグループ	7,100	1,097.00	7,788,700		
エスクローＡＪ	5,500	137.00	753,500	貸付株式数	2,200株
メドピア	7,400	728.00	5,387,200	貸付株式数	2,900株
レアジョブ	900	884.00	795,600		
リクルートホールディングス	628,400	5,713.00	3,590,049,200		
エラン	11,200	1,120.00	12,544,000		
ツ ガ ミ	18,500	1,212.00	22,422,000		
オークマ	7,300	5,817.00	42,464,100		
芝浦機械	8,300	3,590.00	29,797,000		
アマダ	133,200	1,456.00	193,939,200		
アイダエンジニア	19,300	826.00	15,941,800		
ＦＵＪＩ	39,300	2,414.50	94,889,850		
牧野フライス	9,200	5,860.00	53,912,000		
オーエスジー	36,800	1,944.50	71,557,600	貸付株式数	14,700株 (100株)
ダイジェット	500	846.00	423,000	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	20,000	819.00	16,380,000		
DMG森精機	50,600	2,535.50	128,296,300	貸付株式数	17,500株
ソディツク	20,500	713.00	14,616,500		
ディスコ	40,100	32,560.00	1,305,656,000		
日東工器	4,000	1,819.00	7,276,000		
日進工具	7,700	979.00	7,538,300		
パンチ工業	4,600	402.00	1,849,200	貸付株式数	2,100株
冨士ダイス	4,300	626.00	2,691,800	貸付株式数	1,100株
土木管理総合試験	2,100	322.00	676,200	貸付株式数	100株
日本郵政	995,500	1,278.50	1,272,746,750		
ベルシステム24HLDGS	9,000	1,723.00	15,507,000		
鎌倉新書	7,200	488.00	3,513,600	貸付株式数	3,700株 (1,300株)
ＳＭＮ	900	278.00	250,200		

一蔵	600	569.00	341,400	貸付株式数	200株
グローバルキッズCOMP	900	623.00	560,700		
エアトリ	6,200	1,794.00	11,122,800	貸付株式数	2,400株
アトラエ	5,000	622.00	3,110,000		
ストライク	3,600	4,235.00	15,246,000		
ソラスト	23,400	572.00	13,384,800		
セラク	2,600	1,233.00	3,205,800	貸付株式数	1,000株
インソース	18,400	815.00	14,996,000	貸付株式数	4,800株
豊田自動織機	70,400	11,495.00	809,248,000		
豊和工業	2,500	744.00	1,860,000	貸付株式数	1,100株
石川製作所	1,200	1,014.00	1,216,800	貸付株式数	400株
リケンＮＰＲ	9,100	1,943.00	17,681,300		
東洋機械金属	3,900	652.00	2,542,800		
津田駒工業	800	334.00	267,200	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,100	671.00	738,100	貸付株式数	400株
島精機製作所	13,300	1,495.00	19,883,500		
オプトラン	13,700	1,711.00	23,440,700		
NCホールディングス	1,100	1,725.00	1,897,500		
イワキポンプ	5,600	2,050.00	11,480,000		
フリュー	7,900	1,462.00	11,549,800		
ヤマシンフィルタ	20,000	318.00	6,360,000	貸付株式数	200株
日阪製作所	9,100	921.00	8,381,100		
やまびこ	13,700	1,478.00	20,248,600		
野村マイクロ・サイエンス	2,800	12,030.00	33,684,000	貸付株式数	1,100株
平田機工	4,000	6,000.00	24,000,000		
ＰＥＧＡＳＵＳ	9,200	437.00	4,020,400	貸付株式数	3,600株
マルマエ	3,600	1,837.00	6,613,200	貸付株式数	1,400株
タツモ	5,000	2,665.00	13,325,000	貸付株式数	2,000株
ナブテスコ	52,400	2,761.50	144,702,600		
三井海洋開発	10,600	1,866.00	19,779,600		
レオン自動機	9,700	1,381.00	13,395,700		
ＳＭＣ	25,000	72,920.00	1,823,000,000		
ホソカワミクロン	5,400	4,015.00	21,681,000		
ユニオンツール	3,700	3,190.00	11,803,000		
瑞 光	6,000	1,348.00	8,088,000	貸付株式数	200株
オイレス工業	11,300	1,882.00	21,266,600	貸付株式数	3,600株
日精エーエスビー	3,300	4,460.00	14,718,000		
サト－ホールディングス	11,900	1,980.00	23,562,000		
技研製作所	7,900	1,752.00	13,840,800	貸付株式数	1,300株

日本エアーテック	3,900	1,314.00	5,124,600	
カ ワ タ	1,500	1,039.00	1,558,500	
日精樹脂工業	6,200	1,098.00	6,807,600	
オカダアイヨン	1,600	2,237.00	3,579,200	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,700	2,206.00	5,956,200	貸付株式数 1,000株
小松製作所	391,000	3,609.00	1,411,119,000	
住友重機械	49,400	3,518.00	173,789,200	
日立建機	33,300	3,610.00	120,213,000	
日 工	12,300	657.00	8,081,100	
巴工業	3,300	3,575.00	11,797,500	貸付株式数 1,300株
井関農機	7,900	1,095.00	8,650,500	
ＴＯＷＡ	9,300	6,790.00	63,147,000	貸付株式数 3,700株
丸山製作所	800	2,458.00	1,966,400	
北川鉄工所	3,300	1,226.00	4,045,800	
シンニッタン	5,800	253.00	1,467,400	
ローツェ	4,400	14,180.00	62,392,000	
タカキタ	1,500	493.00	739,500	貸付株式数 600株
クボタ	437,800	2,080.50	910,842,900	
荏原実業	4,400	2,836.00	12,478,400	
東洋エンジニア	12,000	707.00	8,484,000	
三菱化工機	3,000	2,884.00	8,652,000	
月島ホールディングス	11,300	1,260.00	14,238,000	
帝国電機製作所	5,900	2,904.00	17,133,600	
東京機械	1,200	463.00	555,600	
新東工業	16,900	1,072.00	18,116,800	
渋谷工業	7,900	2,392.00	18,896,800	
アイチ コーポレーション	11,600	1,072.00	12,435,200	
小森コーポレーション	21,100	1,112.00	23,463,200	
鶴見製作所	6,400	3,595.00	23,008,000	
日本ギア工業	1,800	533.00	959,400	貸付株式数 700株
酒井重工業	1,200	5,710.00	6,852,000	
荏原製作所	34,200	7,962.00	272,300,400	
石井鉄工所	500	2,725.00	1,362,500	
酉島製作所	7,200	2,134.00	15,364,800	
北越工業	8,400	2,421.00	20,336,400	貸付株式数 900株
ダイキン工業	99,600	22,100.00	2,201,160,000	
オルガノ	10,000	5,510.00	55,100,000	
トーヨーカネツ	3,200	3,710.00	11,872,000	
栗田工業	46,700	5,423.00	253,254,100	

椿本チエイン	11,900	3,900.00	46,410,000	
大同工業	2,000	726.00	1,452,000	
日 機 装	19,200	966.00	18,547,200	
木村化工機	6,400	741.00	4,742,400	
レイズネクスト	11,700	1,426.00	16,684,200	
アネスト岩田	12,900	1,074.00	13,854,600	貸付株式数 5,100株
ダイフク	140,800	2,801.50	394,451,200	
サムコ	2,200	3,945.00	8,679,000	貸付株式数 800株
加藤製作所	2,400	1,246.00	2,990,400	
油研工業	800	2,094.00	1,675,200	
タダノ	48,100	1,094.50	52,645,450	
フジテック	19,500	3,534.00	68,913,000	
ＣＫＤ	23,100	2,433.00	56,202,300	
平和	24,600	2,049.00	50,405,400	
理想科学工業	6,700	2,644.00	17,714,800	
ＳＡＮＫＹＯ	20,500	7,908.00	162,114,000	
日本金銭機械	10,100	1,336.00	13,493,600	貸付株式数 3,300株
マースグループHLDGS	4,200	2,377.00	9,983,400	
フクシマガリレイ	5,400	4,825.00	26,055,000	
オーイズミ	1,700	398.00	676,600	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,100	3,185.00	13,058,500	貸付株式数 1,700株
竹内製作所	15,100	4,085.00	61,683,500	
ア マ ノ	23,700	3,230.00	76,551,000	
ＪＵＫＩ	13,000	484.00	6,292,000	貸付株式数 5,100株
サンデン	6,700	158.00	1,058,600	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	8,400	663.00	5,569,200	
ブラザー工業	111,500	2,387.00	266,150,500	
マックス	11,700	2,942.00	34,421,400	
モリタホールディングス	14,500	1,477.00	21,416,500	
グローリー	20,000	2,820.00	56,400,000	
新晃工業	8,400	2,541.00	21,344,400	
大和冷機工業	12,700	1,424.00	18,084,800	
セガサミーホールディングス	74,500	1,937.00	144,306,500	
ＴＰＲ	10,600	1,553.00	16,461,800	
ツバキ・ナカシマ	16,700	701.00	11,706,700	貸付株式数 6,600株
ホシザキ	49,200	4,837.00	237,980,400	
大豊工業	7,200	812.00	5,846,400	
日本精工	154,500	742.70	114,747,150	
ＮＴＮ	181,000	260.80	47,204,800	

ジェイテクト	74,300	1,184.50	88,008,350	
不 二 越	6,200	3,565.00	22,103,000	
ミネベアミツミ	145,100	2,830.00	410,633,000	
日本トムソン	22,800	579.00	13,201,200	
ＴＨＫ	48,100	2,846.00	136,892,600	
ユーシン精機	6,600	663.00	4,375,800	
前澤給装工業	6,300	1,255.00	7,906,500	貸付株式数 1,000株
イーグル工業	9,200	1,571.00	14,453,200	
前澤工業	2,600	923.00	2,399,800	
日本ピラ－工業	7,700	4,280.00	32,956,000	
キッツ	27,900	1,151.00	32,112,900	
日 立	405,600	9,852.00	3,995,971,200	
三菱電機	928,300	1,992.00	1,849,173,600	
富士電機	50,700	5,891.00	298,673,700	
東洋電機製造	1,500	947.00	1,420,500	
安川電機	90,600	5,652.00	512,071,200	
シンフォニア テクノロジー	9,200	2,129.00	19,586,800	
明 電 舎	15,500	2,363.00	36,626,500	
オリジン	1,000	1,200.00	1,200,000	
山洋電気	3,600	5,930.00	21,348,000	
デンヨー	6,400	2,169.00	13,881,600	
PHCホールディングス	15,500	1,412.00	21,886,000	
KOKUSAI ELECTRIC	32,000	2,961.00	94,752,000	貸付株式数 12,800株
ソシオネクスト	12,100	11,460.00	138,666,000	
ベイカレントコンサルティング	62,400	4,988.00	311,251,200	
ORCHESTRA HLDGS	1,800	997.00	1,794,600	
アイモバイル	11,300	447.00	5,051,100	
キャリアインデックス	1,600	209.00	334,400	貸付株式数 600株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2,700	1,097.00	2,961,900	貸付株式数 400株
船場	1,000	900.00	900,000	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターSHD	27,500	2,319.00	63,772,500	
フルテック	600	1,266.00	759,600	貸付株式数 200株
グリーンズ	1,700	1,741.00	2,959,700	貸付株式数 700株
ツナググループHLDGS	1,300	912.00	1,185,600	貸付株式数 100株
GAMEWITH	1,400	292.00	408,800	貸付株式数 600株
MS&CONSULTING	600	665.00	399,000	貸付株式数 100株
ウェルビー	4,200	797.00	3,347,400	貸付株式数 1,600株
エル・ティー・エス	1,000	2,849.00	2,849,000	貸付株式数 300株

ミダックホールディングス	5,100	1,913.00	9,756,300	貸付株式数	2,000株
キュービーネットHLDGS	4,000	1,435.00	5,740,000		
RPAホールディングス	11,500	264.00	3,036,000		
三桜工業	12,600	760.00	9,576,000		
マキタ	95,100	3,848.00	365,944,800		
東芝テック	10,700	2,826.00	30,238,200		
芝浦メカトロニクス	4,700	6,380.00	29,986,000	貸付株式数	1,800株
マブチモーター	20,700	4,678.00	96,834,600		
ニデック	184,100	5,524.00	1,016,968,400		
ユーエムシーエレクトロニクス	5,200	344.00	1,788,800	貸付株式数	2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,300	1,762.00	7,576,600	貸付株式数	1,700株
東光高岳	5,000	2,011.00	10,055,000		
ダブル・スコープ	23,900	927.00	22,155,300	貸付株式数	9,500株
宮越ホールディングス	3,700	1,243.00	4,599,100	貸付株式数	1,400株
ダイヘン	8,400	6,200.00	52,080,000		
ヤーマン	14,400	958.00	13,795,200	貸付株式数	5,700株 (500株)
ＪＶＣケンウッド	65,800	733.00	48,231,400		
ミマキエンジニアリング	7,900	922.00	7,283,800		
Ｉ－ＰＥＸ	5,700	1,483.00	8,453,100	貸付株式数	900株
大崎電気	18,300	631.00	11,547,300		
オムロン	63,700	6,229.00	396,787,300		
日東工業	11,200	3,440.00	38,528,000		
ＩＤＥＣ	12,300	2,759.00	33,935,700		
正興電機製作所	1,500	1,117.00	1,675,500	貸付株式数	600株
不二電機工業	900	1,146.00	1,031,400	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサ コーポ	27,400	1,933.00	52,964,200	貸付株式数	10,900株
サクサホールディングス	1,100	2,645.00	2,909,500		
メルコホールディングス	2,600	3,385.00	8,801,000		
テクノメディカ	2,000	2,292.00	4,584,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリクHD	3,100	670.00	2,077,000	貸付株式数	1,200株
日本電気	109,500	8,102.00	887,169,000		
富 士 通	76,700	20,865.00	1,600,345,500		
沖 電 気	37,700	889.00	33,515,300		
岩崎通信機	2,100	771.00	1,619,100		
電気興業	3,700	2,254.00	8,339,800		
サンケン電気	7,700	7,867.00	60,575,900		

ナカヨ	700	1,209.00	846,300	貸付株式数 300株
アイホン	4,500	2,618.00	11,781,000	
ルネサスエレクトロニクス	544,300	2,477.00	1,348,231,100	
セイコーエプソン	107,000	2,039.00	218,173,000	
ワコム	63,400	658.00	41,717,200	貸付株式数 22,600株
アルバック	19,800	6,624.00	131,155,200	
アクセル	2,900	2,093.00	6,069,700	貸付株式数 800株
ＥＩＺＯ	6,100	4,795.00	29,249,500	
ジャパンディスプレイ	61,700	20.00	1,234,000	
日本信号	18,900	936.00	17,690,400	
京三製作所	17,500	456.00	7,980,000	
能美防災	11,300	1,962.00	22,170,600	
ホーチキ	6,200	1,579.00	9,789,800	
星和電機	2,000	484.00	968,000	貸付株式数 1,000株
エレコム	19,900	1,796.00	35,740,400	
パナソニック ホールディンク	985,200	1,377.00	1,356,620,400	
シャープ	140,600	997.50	140,248,500	貸付株式数 56,200株
アンリツ	58,700	1,307.00	76,720,900	
富士通ゼネラル	23,600	2,106.50	49,713,400	貸付株式数 9,400株
ソニーグループ	584,000	13,075.00	7,635,800,000	※
ＴＤＫ	132,100	6,611.00	873,313,100	
帝国通信工業	3,600	1,832.00	6,595,200	
タムラ製作所	33,200	531.00	17,629,200	貸付株式数 1,500株
アルプスアルパイン	74,500	1,210.50	90,182,250	貸付株式数 3,800株
池上通信機	1,400	879.00	1,230,600	貸付株式数 700株
日本電波工業	10,000	1,102.00	11,020,000	貸付株式数 3,000株
鈴木	4,500	1,115.00	5,017,500	
メイコー	8,300	4,190.00	34,777,000	
日本トリム	1,900	3,035.00	5,766,500	
ローランド ディー.ジー.	4,600	3,630.00	16,698,000	
フオスター電機	6,200	988.00	6,125,600	
ＳＭＫ	2,200	2,469.00	5,431,800	
ヨコオ	7,400	1,435.00	10,619,000	
ティアック	7,400	95.00	703,000	貸付株式数 2,900株
ホシデン	19,000	1,644.00	31,236,000	
ヒロセ電機	12,300	16,215.00	199,444,500	
日本航空電子	19,900	3,025.00	60,197,500	
ＴＯＡ	9,500	987.00	9,376,500	
マクセル	18,400	1,564.00	28,777,600	

古野電気	10,800	1,659.00	17,917,200	
スミダコーポレーション	11,200	1,152.00	12,902,400	
アイコム	3,200	3,305.00	10,576,000	貸付株式数 1,000株
リオン	3,400	2,209.00	7,510,600	
横河電機	91,200	2,708.50	247,015,200	
新電元工業	3,200	2,978.00	9,529,600	
アズビル	57,700	4,597.00	265,246,900	
東亜ディーケーケー	2,100	888.00	1,864,800	
日本光電工業	35,400	3,687.00	130,519,800	
チ ノ ー	3,400	2,025.00	6,885,000	貸付株式数 1,300株
共和電業	4,200	402.00	1,688,400	
日本電子材料	5,100	1,662.00	8,476,200	
堀場製作所	15,800	10,445.00	165,031,000	
アドバンテスト	236,500	4,760.00	1,125,740,000	
小野測器	1,800	447.00	804,600	
エスペック	6,600	2,236.00	14,757,600	
キーエンス	82,600	61,860.00	5,109,636,000	
日置電機	3,900	6,040.00	23,556,000	
シスメックス	71,200	7,762.00	552,654,400	
日本マイクロニクス	14,800	3,405.00	50,394,000	
メガチップス	6,500	4,505.00	29,282,500	
OBARA GROUP	4,500	3,685.00	16,582,500	
IMAGICA GROUP	8,300	615.00	5,104,500	貸付株式数 1,300株
澤藤電機	500	1,195.00	597,500	貸付株式数 300株
デンソー	681,300	2,130.00	1,451,169,000	
原田工業	2,000	758.00	1,516,000	貸付株式数 500株
コーセル	9,900	1,296.00	12,830,400	
イリソ電子工業	7,600	3,600.00	27,360,000	
オプテックスグループ	15,200	1,699.00	25,824,800	
千代田インテグレ	3,200	2,950.00	9,440,000	
レーザーテック	37,800	33,140.00	1,252,692,000	
スタンレー電気	52,900	2,630.50	139,153,450	
ウシオ電機	42,000	2,088.00	87,696,000	
岡谷電機	3,400	281.00	955,400	貸付株式数 1,600株
ヘリオステクノH	4,600	500.00	2,300,000	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,200	1,521.00	1,825,200	貸付株式数 600株
日本セラミック	6,700	2,814.00	18,853,800	
遠藤照明	2,100	1,157.00	2,429,700	
古河電池	6,100	842.00	5,136,200	貸付株式数 2,400株
双信電機	1,800	306.00	550,800	貸付株式数 900株

山一電機	7,400	1,794.00	13,275,600		
図 研	7,200	3,880.00	27,936,000		
日本電子	20,700	5,966.00	123,496,200		
カ シ オ	59,700	1,197.50	71,490,750		
ファナック	402,600	4,071.00	1,638,984,600		
日本シイエムケイ	17,500	731.00	12,792,500		
エンプラス	2,400	12,000.00	28,800,000	貸付株式数	900株
大真空	12,300	792.00	9,741,600	貸付株式数	2,100株
ロ ー ム	152,700	2,861.00	436,874,700		
浜松ホトニクス	66,300	5,612.00	372,075,600		
三井ハイテック	7,300	7,683.00	56,085,900	貸付株式数	3,000株
新光電気工業	29,200	5,500.00	160,600,000		
京 セ ラ	128,300	8,053.00	1,033,199,900		
協栄産業	500	2,456.00	1,228,000	貸付株式数	200株
太陽誘電	40,200	3,582.00	143,996,400		
村田製作所	751,300	2,820.00	2,118,666,000		
双葉電子工業	15,700	510.00	8,007,000		
日東電工	53,200	9,979.00	530,882,800		
北陸電気工業	1,700	1,315.00	2,235,500		
東海理化電機	23,300	2,189.00	51,003,700		
ニチコン	21,700	1,314.00	28,513,800		
日本ケミコン	8,800	1,288.00	11,334,400		
ＫＯＡ	12,500	1,518.00	18,975,000	貸付株式数	3,800株
三井Ｅ＆Ｓ	21,700	589.00	12,781,300		
日立造船	73,600	915.00	67,344,000		
三菱重工業	145,900	7,595.00	1,108,110,500		
川崎重工業	67,400	2,941.00	198,223,400		
ＩＨＩ	62,100	2,574.50	159,876,450		
名村造船所	18,000	1,001.00	18,018,000	貸付株式数	1,700株
サノヤスホールディングス	7,400	136.00	1,006,400	貸付株式数	1,900株
スプリックス	1,300	774.00	1,006,200		
マネジメントソリューションズ	3,600	3,275.00	11,790,000	貸付株式数	1,400株
プロレド・パートナーズ	2,000	358.00	716,000	貸付株式数	200株
AND FACTORY	1,400	329.00	460,600	貸付株式数	500株
テノ.ホールディングス	600	428.00	256,800	貸付株式数	200株
フロンティア・マネジメント	2,100	1,493.00	3,135,300		
ピアラ	900	296.00	266,400		
コプロ・ホールディングス	1,500	1,477.00	2,215,500	貸付株式数	200株

ギークス	600	487.00	292,200	貸付株式数	200株
アンビスホールディングス	9,100	3,215.00	29,256,500		
カーブスホールディングス	23,100	619.00	14,298,900	貸付株式数	4,500株
フォーラムエンジニアリング	11,600	783.00	9,082,800		
FAST FITNESS JAP	2,900	1,040.00	3,016,000		
日本車輌	2,800	2,073.00	5,804,400	貸付株式数	300株
三菱ロジスネクスト	13,200	1,356.00	17,899,200		
近畿車輌	700	1,754.00	1,227,800	貸付株式数	300株
一家ホールディングス	1,200	663.00	795,600	貸付株式数	600株
フルサト・マルカHD	7,800	2,528.00	19,718,400		
ヤマエグループHD	4,900	3,725.00	18,252,500		
ジャパンクラフトホールディ	2,800	167.00	467,600	貸付株式数	1,800株
ＦＰＧ	27,500	1,640.00	45,100,000		
島根銀行	1,400	538.00	753,200	貸付株式数	800株
じもとホールディングス	4,100	560.00	2,296,000		
全国保証	21,300	5,166.00	110,035,800		
めぶきフィナンシャルG	403,900	436.20	176,181,180		
ジャパンインベストメントA	6,700	1,511.00	10,123,700	貸付株式数	2,500株
東京きらぼしFG	10,400	3,955.00	41,132,000		
九州フィナンシャルG	157,500	776.40	122,283,000		
かんぽ生命保険	80,900	2,499.00	202,169,100		
ゆうちょ銀行	893,800	1,445.00	1,291,541,000		
あんしん保証	2,100	240.00	504,000	貸付株式数	600株
富山第一銀行	25,800	759.00	19,582,200		
コンコルディア・フィナンシャル	436,600	655.30	286,103,980		
ジェイリース	2,100	2,070.00	4,347,000	貸付株式数	800株
西日本フィナンシャルHD	45,900	1,572.00	72,154,800		
イントラスト	1,800	800.00	1,440,000		
日本モーゲージサービス	2,700	499.00	1,347,300	貸付株式数	1,200株
Ｃａｓａ	2,000	863.00	1,726,000	貸付株式数	700株
アルヒ	7,700	817.00	6,290,900		
プレミアグループ	13,700	1,683.00	23,057,100		
日産自動車	1,173,200	558.60	655,349,520		
いすゞ自動車	240,100	1,806.00	433,620,600		
トヨタ自動車	4,533,800	2,619.50	11,876,289,100	※	
日野自動車	124,200	459.70	57,094,740		
三菱自動車工業	322,200	435.40	140,285,880		

エフテック	3,200	630.00	2,016,000	貸付株式数 1,200株
レシップホールディングス	1,900	583.00	1,107,700	
ＧＭＢ	900	1,155.00	1,039,500	貸付株式数 400株
ファルテック	800	529.00	423,200	
武蔵精密工業	20,200	1,400.00	28,280,000	
日産車体	9,700	920.00	8,924,000	貸付株式数 400株
新明和工業	23,800	1,114.00	26,513,200	
極東開発工業	13,700	1,923.00	26,345,100	
トピー工業	6,700	2,485.00	16,649,500	
ティラド	1,800	2,972.00	5,349,600	
タチエス	15,200	1,673.00	25,429,600	
ＮＯＫ	32,100	1,857.00	59,609,700	
フタバ産業	22,100	764.00	16,884,400	
カヤバ	8,000	4,775.00	38,200,000	
市光工業	14,900	541.00	8,060,900	
大同メタル工業	16,000	545.00	8,720,000	
プレス工業	33,000	578.00	19,074,000	
ミクニ	5,800	441.00	2,557,800	
太平洋工業	18,900	1,297.00	24,513,300	
河西工業	7,200	196.00	1,411,200	貸付株式数 2,700株
アイシン	63,700	4,943.00	314,869,100	
マツダ	273,200	1,527.00	417,176,400	
今仙電機製作所	2,800	627.00	1,755,600	
本田技研	2,013,700	1,424.50	2,868,515,650	
スズキ	151,700	5,576.00	845,879,200	
SUBARU	261,300	2,568.00	671,018,400	
安永	2,000	644.00	1,288,000	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	119,000	3,799.00	452,081,000	
小糸製作所	89,400	2,255.00	201,597,000	
ＴＢＫ	4,900	361.00	1,768,900	
エクセディ	13,500	2,436.00	32,886,000	
ミツバ	15,400	920.00	14,168,000	
豊田合成	24,100	2,618.00	63,093,800	
愛三工業	13,600	1,170.00	15,912,000	
盟和産業	600	973.00	583,800	貸付株式数 200株
日本プラスト	3,800	510.00	1,938,000	
ヨロズ	7,700	854.00	6,575,800	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	14,700	1,722.00	25,313,400	
新家工業	1,000	2,827.00	2,827,000	

シマノ	33,500	21,455.00	718,742,500	
テイ・エス テック	29,400	1,672.50	49,171,500	
３３ＦＧ	7,400	1,803.00	13,342,200	
第四北越フィナンシャルG	12,800	3,960.00	50,688,000	
ひろぎんHLDGS	115,800	895.70	103,722,060	
マーキュリアホールディングス	2,400	692.00	1,660,800	貸付株式数 100株
おきなわＦＧ	7,000	2,308.00	16,156,000	
ダイレクトマケティングミクス	8,800	421.00	3,704,800	
ポピンズ	1,300	1,043.00	1,355,900	
LITALICO	6,600	2,032.00	13,411,200	
コンフィデンス・インターワーク	400	1,500.00	600,000	貸付株式数 100株
十六ＦＧ	10,600	3,740.00	39,644,000	
北國ＦＨＤ	8,600	4,620.00	39,732,000	
ネットプロＨＤ	27,000	186.00	5,022,000	
プロクレアホールディングス	9,300	1,835.00	17,065,500	
あいちフィナンシャルグル	12,500	2,292.00	28,650,000	
ジャムコ	3,500	1,475.00	5,162,500	貸付株式数 1,400株
小 野 建	8,500	1,660.00	14,110,000	
はるやまHLDGS	2,200	554.00	1,218,800	貸付株式数 1,100株
南 陽	1,000	2,035.00	2,035,000	
ノ ジ マ	25,300	1,664.00	42,099,200	
佐鳥電機	4,200	1,926.00	8,089,200	
カッパ・クリエイト	13,600	1,618.00	22,004,800	貸付株式数 5,100株
エコートレーディング	900	1,457.00	1,311,300	貸付株式数 400株
伯東	5,000	5,270.00	26,350,000	貸付株式数 1,900株
コンドーテック	6,600	1,140.00	7,524,000	貸付株式数 2,200株
中山福	2,500	358.00	895,000	
ライトオン	3,600	451.00	1,623,600	貸付株式数 1,300株
ナガイレーベン	11,000	2,273.00	25,003,000	
三菱食品	8,100	4,740.00	38,394,000	
良品計画	95,400	2,334.00	222,663,600	
パリミキホールディングス	5,900	458.00	2,702,200	
松田産業	6,600	2,360.00	15,576,000	
第一興商	33,800	2,044.00	69,087,200	
メディパルHD	90,500	2,250.00	203,625,000	
アドヴァングループ	8,200	1,034.00	8,478,800	

ＳＰＫ	3,900	1,814.00	7,074,600		
萩原電気HLDGS	3,700	4,465.00	16,520,500		
アルビス	2,800	2,567.00	7,187,600	貸付株式数	1,100株
アズワン	13,700	5,307.00	72,705,900		
スズデン	3,000	2,274.00	6,822,000		
尾家産業	1,200	1,880.00	2,256,000	貸付株式数	100株
シモジマ	5,900	1,221.00	7,203,900	貸付株式数	200株
ドウシシャ	8,000	2,007.00	16,056,000		
小津産業	1,100	1,567.00	1,723,700	貸付株式数	600株
コナカ	5,200	390.00	2,028,000		
高速	5,100	2,001.00	10,205,100		
ハウス ローゼ	600	1,601.00	960,600		
G-7ホールディングス	9,500	1,141.00	10,839,500		
たけびし	3,300	1,806.00	5,959,800		
イオン北海道	25,800	897.00	23,142,600	貸付株式数	4,600株
コ ジ マ	14,200	752.00	10,678,400	貸付株式数	5,600株
ヒマラヤ	1,500	916.00	1,374,000	貸付株式数	900株
コーナン商事	10,700	3,830.00	40,981,000		
ネットワンシステムズ	33,400	2,380.00	79,492,000		
エコス	3,200	2,299.00	7,356,800		
ワタミ	9,200	1,015.00	9,338,000	貸付株式数	3,900株
マルシェ	1,700	253.00	430,100	貸付株式数	300株
リックス	1,500	3,235.00	4,852,500		
システムソフト	28,000	61.00	1,708,000	貸付株式数	1,500株
パンパシフィックHD	176,400	3,224.00	568,713,600		
丸文	7,800	1,545.00	12,051,000		
西松屋チェーン	17,200	2,193.00	37,719,600	貸付株式数	7,200株
ゼンショーホールディングス	43,000	7,107.00	305,601,000		
ハピネット	7,400	2,629.00	19,454,600		
幸楽苑ホールディングス	6,300	1,188.00	7,484,400	貸付株式数	2,500株
ハークスレイ	1,700	846.00	1,438,200		
橋本総業HLDGS	3,400	1,266.00	4,304,400		
日本ライフライン	25,600	1,200.00	30,720,000		
サイゼリヤ	12,900	4,920.00	63,468,000		
タカショー	7,500	505.00	3,787,500	貸付株式数	2,900株
ＶＴホールディングス	33,000	507.00	16,731,000		
アルゴグラフィックス	7,600	3,535.00	26,866,000		
魚力	3,000	2,227.00	6,681,000	貸付株式数	900株
ＩＤＯＭ	23,100	917.00	21,182,700		

日本エム・ディ・エム	6,500	740.00	4,810,000		
ポプラ	1,200	187.00	224,400	貸付株式数	200株
フジ・コーポレーション	4,300	1,622.00	6,974,600		
ユナイテッドアローズ	10,300	1,936.00	19,940,800	貸付株式数	1,000株
進和	5,400	2,303.00	12,436,200	貸付株式数	2,000株
エスケイジャパン	1,200	787.00	944,400		
ダイトロン	3,400	2,771.00	9,421,400		
ハイデイ日高	12,900	2,675.00	34,507,500	貸付株式数	4,700株
シークス	12,500	1,423.00	17,787,500	貸付株式数	4,900株
YU-WA CREATION H	2,700	150.00	405,000	貸付株式数	1,000株
コロワイド	37,500	2,140.00	80,250,000	貸付株式数	15,000株
田中商事	1,300	701.00	911,300	貸付株式数	100株
オーハシテクニカ	4,600	1,767.00	8,128,200		
壱番屋	6,900	5,180.00	35,742,000	貸付株式数	100株
白銅	2,400	2,186.00	5,246,400	貸付株式数	1,100株
トップカルチャー	1,600	163.00	260,800	貸付株式数	400株
ＰＬＡＮＴ	1,100	1,426.00	1,568,600		
スギホールディングス	17,600	6,086.00	107,113,600		
ダイコー通産	500	1,140.00	570,000	貸付株式数	200株
薬王堂ホールディングス	4,200	2,610.00	10,962,000		
島津製作所	109,700	3,893.00	427,062,100		
ＪＭＳ	7,500	504.00	3,780,000		
クボテック	1,200	270.00	324,000	貸付株式数	400株
長野計器	6,000	1,916.00	11,496,000		
ブイ・テクノロジー	4,400	2,654.00	11,677,600		
スター精密	15,600	1,737.00	27,097,200		
東京計器	6,300	1,617.00	10,187,100	貸付株式数	2,500株
愛知時計	3,600	2,191.00	7,887,600		
インターアクション	4,000	954.00	3,816,000	貸付株式数	1,200株
オーバル	4,000	450.00	1,800,000	貸付株式数	1,600株
東京精密	16,900	8,479.00	143,295,100		
マニー	33,000	2,177.50	71,857,500		
ニコン	119,400	1,377.50	164,473,500		
トプコン	40,100	1,497.50	60,049,750		
オリンパス	508,300	2,082.00	1,058,280,600		
理研計器	5,800	6,750.00	39,150,000		
SCREENホールディングス	28,200	11,335.00	319,647,000		
キヤノン電子	9,100	2,007.00	18,263,700		
タムロン	5,100	4,930.00	25,143,000		
ＨＯＹＡ	164,000	17,110.00	2,806,040,000		

シ ー ド	2,300	780.00	1,794,000	
ノーリツ鋼機	7,800	2,823.00	22,019,400	
A&Dホロンホールディングス	12,000	1,755.00	21,060,000	
朝日インテック	92,200	2,788.00	257,053,600	貸付株式数 22,300株
キヤノン	411,900	3,600.00	1,482,840,000	貸付株式数 159,400株
リ コ ー	207,100	1,069.00	221,389,900	
シチズン時計	76,000	811.00	61,636,000	
リズム	1,000	2,910.00	2,910,000	貸付株式数 400株
大研医器	3,800	494.00	1,877,200	
メニコン	28,400	2,379.50	67,577,800	
シンシア	500	543.00	271,500	貸付株式数 200株
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	6,700	173.00	1,159,100	
中本パックス	1,500	1,621.00	2,431,500	貸付株式数 100株
スノーピーク	11,800	889.00	10,490,200	貸付株式数 4,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	17,100	2,731.00	46,700,100	
トランザクション	5,400	2,048.00	11,059,200	貸付株式数 1,900株
粧美堂	1,200	630.00	756,000	
ニホンフラッシュ	7,700	898.00	6,914,600	
前田工繊	6,900	2,985.00	20,596,500	貸付株式数 2,600株
永大産業	5,300	224.00	1,187,200	
アートネイチャー	7,400	774.00	5,727,600	
バンダイナムコHLDGS	226,200	2,714.00	613,906,800	
アイフィスジャパン	1,400	630.00	882,000	
ＳＨＯＥＩ	18,700	1,824.00	34,108,800	貸付株式数 3,200株
フランスベッドHLDGS	10,600	1,291.00	13,684,600	貸付株式数 3,400株
マーベラス	13,300	686.00	9,123,800	
パイロットコーポレーション	11,600	4,091.00	47,455,600	
萩原工業	5,500	1,418.00	7,799,000	貸付株式数 1,900株 (500株)
エイベックス	14,100	1,336.00	18,837,600	
フジシールインターナショナル	16,700	1,676.00	27,989,200	
タカラトミー	37,600	2,203.50	82,851,600	
広済堂ホールディングス	18,500	724.00	13,394,000	貸付株式数 7,400株
エステールホールディングス	1,000	629.00	629,000	貸付株式数 700株
レック	10,500	1,026.00	10,773,000	
タカノ	1,700	896.00	1,523,200	貸付株式数 800株

三光合成	10,400	500.00	5,200,000	
プロネクサス	8,500	1,250.00	10,625,000	
ホクシン	3,400	110.00	374,000	貸付株式数　2,000株
ウッドワン	1,700	1,005.00	1,708,500	貸付株式数　600株
き も と	7,600	186.00	1,413,600	
TOPPANホールディングス	101,500	3,679.00	373,418,500	
大日本印刷	90,300	4,069.00	367,430,700	
共同印刷	2,300	3,245.00	7,463,500	
ＮＩＳＳＨＡ	14,100	1,458.00	20,557,800	
光村印刷	400	1,315.00	526,000	
藤森工業	6,500	3,700.00	24,050,000	
ヴィア・ホールディングス	7,100	221.00	1,569,100	貸付株式数　2,800株
TAKARA & COMPANY	5,300	2,494.00	13,218,200	
前澤化成工業	5,300	1,526.00	8,087,800	貸付株式数　2,100株
未来工業	2,900	3,050.00	8,845,000	
アシックス	70,400	4,546.00	320,038,400	
ツ ツ ミ	1,900	2,184.00	4,149,600	
ウェーブロックHLDGS	1,700	626.00	1,064,200	貸付株式数　200株
ジェイ エス ピー	5,800	1,751.00	10,155,800	貸付株式数　1,400株
ニ チ ハ	10,400	2,866.00	29,806,400	
ローランド	6,100	4,320.00	26,352,000	
エフピコ	15,700	2,872.00	45,090,400	
小松ウオール工業	3,300	2,787.00	9,197,100	
ヤマハ	52,100	3,224.00	167,970,400	
河合楽器	2,500	3,545.00	8,862,500	
クリナップ	7,900	662.00	5,229,800	
ピジョン	52,600	1,616.00	85,001,600	
天馬	6,000	2,202.00	13,212,000	
キングジム	7,100	865.00	6,141,500	貸付株式数　2,800株
象印マホービン	22,400	1,508.00	33,779,200	
リンテック	16,600	2,649.00	43,973,400	
信越ポリマー	17,800	1,546.00	27,518,800	
東 リ	11,300	322.00	3,638,600	
イトーキ	16,900	1,246.00	21,057,400	
任 天 堂	521,300	6,813.00	3,551,616,900	
三菱鉛筆	11,700	2,022.00	23,657,400	
松 風	3,700	2,704.00	10,004,800	
タカラスタンダード	17,300	1,701.00	29,427,300	
コ ク ヨ	33,800	2,259.00	76,354,200	
ナカバヤシ	8,700	534.00	4,645,800	

ニ フ コ	24,800	3,441.00	85,336,800	
立川ブラインド	3,800	1,433.00	5,445,400	貸付株式数 1,500株
グローブライド	7,400	1,926.00	14,252,400	
オカムラ	24,800	2,036.00	50,492,800	
バルカー	6,900	3,890.00	26,841,000	
MUTOHホールディングス	600	1,891.00	1,134,600	
伊 藤 忠	587,300	5,748.00	3,375,800,400	
丸 紅	728,400	2,209.50	1,609,399,800	
スクロール	13,000	955.00	12,415,000	
高 島	3,300	1,130.00	3,729,000	
ヨンドシーホールディングス	8,300	1,957.00	16,243,100	貸付株式数 100株
三陽商会	2,700	2,686.00	7,252,200	貸付株式数 200株
長瀬産業	40,000	2,250.00	90,000,000	
ナイガイ	1,500	269.00	403,500	貸付株式数 600株 (100株)
蝶 理	5,500	2,653.00	14,591,500	
豊田通商	76,500	8,392.00	641,988,000	
オンワードホールディングス	48,700	497.00	24,203,900	
三共生興	12,100	713.00	8,627,300	
兼 松	36,500	2,020.00	73,730,000	
美 津 濃	8,200	3,880.00	31,816,000	
ツカモトコーポレーション	700	1,165.00	815,500	
ルックホールディングス	2,000	2,474.00	4,948,000	貸付株式数 800株
三井物産	658,200	5,084.00	3,346,288,800	
日本紙パルプ	4,200	4,845.00	20,349,000	
東京エレクトロン	174,800	24,385.00	4,262,498,000	
カメイ	9,300	1,674.00	15,568,200	
東都水産	300	7,200.00	2,160,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	900	2,392.00	2,152,800	
スターゼン	6,200	2,390.00	14,818,000	
セイコーグループ	11,500	2,623.00	30,164,500	
山 善	26,500	1,164.00	30,846,000	
椿本興業	1,800	6,370.00	11,466,000	
住友商事	528,900	3,009.00	1,591,460,100	
ＢＩＰＲＯＧＹ	27,100	4,190.00	113,549,000	
内田洋行	3,500	6,910.00	24,185,000	
三菱商事	577,100	6,615.00	3,817,516,500	
第一実業	8,200	1,850.00	15,170,000	

キヤノンマーケティングJPN	20,200	3,979.00	80,375,800	
西華産業	3,500	2,776.00	9,716,000	
佐藤商事	6,000	1,421.00	8,526,000	
菱洋エレクトロ	8,300	3,490.00	28,967,000	
東京産業	8,100	812.00	6,577,200	
ユアサ商事	6,800	4,610.00	31,348,000	
神鋼商事	2,200	5,660.00	12,452,000	
トルク	2,500	255.00	637,500	貸付株式数 1,000株
阪和興業	15,700	4,715.00	74,025,500	
正栄食品	5,800	4,705.00	27,289,000	貸付株式数 2,300株
カナデン	6,600	1,505.00	9,933,000	
ＲＹＯＤＥＮ	7,000	2,484.00	17,388,000	貸付株式数 2,400株
ニプロ	68,700	1,115.50	76,634,850	
岩谷産業	19,900	6,335.00	126,066,500	
ナイス	2,500	1,550.00	3,875,000	
ニチモウ	800	3,910.00	3,128,000	
極東貿易	5,200	1,886.00	9,807,200	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	16,400	471.00	7,724,400	
三愛オブリ	21,000	1,617.00	33,957,000	
稲畑産業	17,300	3,050.00	52,765,000	
ＧＳＩクレオス	4,700	2,114.00	9,935,800	
明和産業	10,300	630.00	6,489,000	
クワザワホールディングス	1,700	697.00	1,184,900	
ゴールドウイン	14,600	10,865.00	158,629,000	
ユニ・チャーム	172,500	4,878.00	841,455,000	
デサント	14,300	3,785.00	54,125,500	
キ ン グ	1,700	680.00	1,156,000	
ワ キ タ	14,500	1,563.00	22,663,500	
ヤマトインターナシヨナル	3,500	297.00	1,039,500	
東邦ホールディングス	24,100	3,288.00	79,240,800	貸付株式数 9,600株
サンゲツ	20,100	3,015.00	60,601,500	
ミツウロコグループ	11,100	1,451.00	16,106,100	
シナネンホールディングス	2,400	4,090.00	9,816,000	
伊藤忠エネクス	21,600	1,543.00	33,328,800	
サンリオ	24,800	5,314.00	131,787,200	貸付株式数 9,800株 (9,800株)
サンワ テクノス	4,500	2,177.00	9,796,500	
リョーサン	6,200	4,815.00	29,853,000	
新光商事	11,700	1,138.00	13,314,600	
トーホー	3,400	2,533.00	8,612,200	貸付株式数 1,300株

三信電気	3,500	2,139.00	7,486,500		
東陽テクニカ	8,800	1,347.00	11,853,600		
モスフード サービス	12,700	3,230.00	41,021,000		
加賀電子	8,000	6,230.00	49,840,000		
三益半導体	6,600	2,745.00	18,117,000	貸付株式数	1,500株
都築電気	4,300	2,199.00	9,455,700	貸付株式数	1,600株
ソーダニツカ	6,500	1,024.00	6,656,000		
立花エレテック	5,800	2,716.00	15,752,800	貸付株式数	2,000株
木曽路	13,200	2,485.00	32,802,000	貸付株式数	1,500株
SRSホールディングス	14,100	1,052.00	14,833,200	貸付株式数	5,600株
千 趣 会	15,700	393.00	6,170,100	貸付株式数	6,000株
タカキユー	3,300	79.00	260,700	貸付株式数	600株
リテールパートナーズ	12,900	1,534.00	19,788,600	貸付株式数	1,800株
上新電機	8,600	2,368.00	20,364,800		
日本瓦斯	46,300	2,328.00	107,786,400		
ロイヤルホールディングス	15,400	2,497.00	38,453,800	貸付株式数	6,100株
東 天 紅	400	818.00	327,200	貸付株式数	100株
いなげや	3,400	1,240.00	4,216,000		
チヨダ	8,200	848.00	6,953,600	貸付株式数	1,300株
ライフコーポレーション	9,200	3,295.00	30,314,000		
リンガーハット	11,200	2,345.00	26,264,000	貸付株式数	4,400株 (600株)
ＭｒＭａｘＨＤ	10,800	611.00	6,598,800		
テンアライド	6,200	300.00	1,860,000	貸付株式数	600株
AOKIホールディングス	18,700	1,121.00	20,962,700		
オークワ	12,400	803.00	9,957,200	貸付株式数	200株
コメリ	13,400	3,130.00	41,942,000	貸付株式数	5,000株
青山商事	18,700	1,527.00	28,554,900		
しまむら	10,300	16,160.00	166,448,000		
はせがわ	2,200	358.00	787,600		
高 島 屋	60,400	1,906.50	115,152,600		
松 屋	14,800	926.00	13,704,800		
エイチ・ツー・オーリテイリング	38,600	1,497.00	57,784,200		
近鉄百貨店	3,700	2,618.00	9,686,600		
丸井グループ	58,100	2,324.00	135,024,400		
クレディセゾン	51,600	2,418.50	124,794,600		
アクシアル リテイリング	5,900	4,015.00	23,688,500		
井 筒 屋	2,300	349.00	802,700	貸付株式数	1,000株
イオン	296,100	3,036.00	898,959,600		

イ ズ ミ	15,500	3,569.00	55,319,500	
フオーバル	3,400	1,372.00	4,664,800	貸付株式数 1,000株
平 和 堂	14,600	2,169.00	31,667,400	貸付株式数 5,200株
フ ジ	13,400	1,864.00	24,977,600	貸付株式数 5,300株
ヤオコー	9,800	8,063.00	79,017,400	貸付株式数 3,900株
ゼビオホールディングス	11,800	945.00	11,151,000	
ケーズホールディングス	61,700	1,295.50	79,932,350	
ＰＡＬＴＡＣ	11,800	4,496.00	53,052,800	
三谷産業	15,000	324.00	4,860,000	
OLYMPICグループ	2,100	525.00	1,102,500	貸付株式数 800株
日産東京販売ＨＤ	7,100	436.00	3,095,600	
あおぞら銀行	58,500	3,096.00	181,116,000	貸付株式数 23,400株
三菱UFJフィナンシャルG	5,094,300	1,198.50	6,105,518,550	
りそなホールディングス	949,400	718.20	681,859,080	
三井住友トラストHD	146,300	5,232.00	765,441,600	
三井住友フィナンシャルG	578,500	6,635.00	3,838,347,500	※
千葉銀行	226,800	1,051.00	238,366,800	
群馬銀行	157,900	695.20	109,772,080	
武蔵野銀行	11,400	2,691.00	30,677,400	
千葉興業銀行	13,500	778.00	10,503,000	
筑波銀行	35,800	249.00	8,914,200	
七十七銀行	23,700	3,445.00	81,646,500	
秋田銀行	5,500	1,912.00	10,516,000	
山形銀行	9,100	1,084.00	9,864,400	
岩手銀行	5,200	2,381.00	12,381,200	
東邦銀行	64,400	295.00	18,998,000	
東北銀行	2,200	1,167.00	2,567,400	
ふくおかフィナンシャルG	70,900	3,264.00	231,417,600	
スルガ銀行	63,000	784.00	49,392,000	
八十二銀行	174,600	782.00	136,537,200	
山梨中央銀行	9,100	1,710.00	15,561,000	
大垣共立銀行	15,600	1,838.00	28,672,800	
福井銀行	7,300	1,575.00	11,497,500	
清水銀行	3,200	1,486.00	4,755,200	
富山銀行	800	1,683.00	1,346,400	
滋賀銀行	13,500	3,450.00	46,575,000	
南都銀行	12,300	2,433.00	29,925,900	
百五銀行	76,700	539.00	41,341,300	
紀陽銀行	29,200	1,524.00	44,500,800	
ほくほくフィナンシャルG	50,400	1,532.00	77,212,800	

山陰合同銀行	51,000	982.00	50,082,000	
鳥取銀行	1,600	1,349.00	2,158,400	
百十四銀行	8,000	2,375.00	19,000,000	
四国銀行	12,100	956.00	11,567,600	
阿波銀行	11,500	2,348.00	27,002,000	
大分銀行	4,900	2,466.00	12,083,400	
宮崎銀行	4,900	2,501.00	12,254,900	
佐賀銀行	4,800	1,814.00	8,707,200	
琉球銀行	17,400	1,096.00	19,070,400	
セブン銀行	255,400	295.30	75,419,620	
みずほフィナンシャルG	1,098,500	2,359.50	2,591,910,750	
高知銀行	1,600	918.00	1,468,800	
山口フィナンシャルG	79,900	1,268.00	101,313,200	
芙蓉総合リース	7,500	11,685.00	87,637,500	
みずほリース	13,700	4,755.00	65,143,500	
東京センチュリー	15,200	5,947.00	90,394,400	
SBIホールディングス	119,100	3,018.00	359,443,800	
日本証券金融	29,900	1,446.00	43,235,400	
アイフル	120,100	368.00	44,196,800	
日本アジア投資	3,400	231.00	785,400	
名古屋銀行	5,300	5,490.00	29,097,000	
北洋銀行	123,400	354.00	43,683,600	
大光銀行	1,500	1,272.00	1,908,000	貸付株式数　300株
愛媛銀行	11,100	953.00	10,578,300	
トマト銀行	1,700	1,126.00	1,914,200	
京葉銀行	34,100	689.00	23,494,900	
栃木銀行	40,700	307.00	12,494,900	
北日本銀行	2,700	2,051.00	5,537,700	
東和銀行	15,200	597.00	9,074,400	
福島銀行	5,000	231.00	1,155,000	
大東銀行	2,000	765.00	1,530,000	貸付株式数　500株
リコーリース	7,800	4,665.00	36,387,000	
イオンフィナンシャルサービス	47,100	1,226.00	57,744,600	
ア コ ム	146,300	343.20	50,210,160	
ジャックス	8,700	5,040.00	43,848,000	
オ リ コ	26,800	1,055.00	28,274,000	
オリックス	495,600	2,620.00	1,298,472,000	
三菱HCキャピタル	363,100	936.40	340,006,840	
ジャフコ グループ	24,300	1,681.00	40,848,300	貸付株式数　10,400株

九州 リースサービス	1,800	1,037.00	1,866,600	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	66,100	387.00	25,580,700	貸付株式数	26,300株 (26,300株)
大和証券Ｇ本社	630,400	951.10	599,573,440		
野村ホールディングス	1,368,200	628.20	859,503,240		
岡三証券グループ	71,500	702.00	50,193,000	貸付株式数	24,800株
丸三証券	27,100	824.00	22,330,400	貸付株式数	10,400株
東洋証券	21,600	294.00	6,350,400		
東海東京ＨＤ	96,900	518.00	50,194,200		
光世証券	1,100	494.00	543,400	貸付株式数	200株
水戸証券	24,200	417.00	10,091,400		
いちよし証券	15,500	698.00	10,819,000		
松井証券	40,300	717.00	28,895,100	貸付株式数	16,000株
SOMPOホールディングス	128,000	6,668.00	853,504,000		
日本取引所グループ	212,300	2,825.50	599,853,650		
マネックスＧ	79,700	674.00	53,717,800		
極東証券	11,300	964.00	10,893,200		
岩井コスモホールディング	9,400	1,734.00	16,299,600		
アイザワ証券グループ	11,800	1,172.00	13,829,600	貸付株式数	4,700株
フィデアホール	8,500	1,473.00	12,520,500		
池田泉州ＨＤ	113,100	321.00	36,305,100		
アニコム ホールディングス	27,000	518.00	13,986,000		
ＭＳ＆ＡＤ	180,500	5,281.00	953,220,500		
マネーパートナーズGP	4,900	284.00	1,391,600		
スパークス・グループ	9,100	1,529.00	13,913,900		
小林洋行	2,100	236.00	495,600	貸付株式数	100株
第一生命HLDGS	396,200	2,890.00	1,145,018,000		
東京海上ＨＤ	801,900	3,393.00	2,720,846,700		
アドバンテッジリスクマネ	2,300	482.00	1,108,600	貸付株式数	900株
イー・ギャランティ	13,300	1,894.00	25,190,200		
アサックス	2,300	685.00	1,575,500	貸付株式数	1,300株
NECキャピタルソリューション	4,000	3,225.00	12,900,000		
T&Dホールディングス	235,400	2,191.50	515,879,100		
アドバンスクリエイト	4,600	977.00	4,494,200	貸付株式数	1,800株
三井不動産	376,100	3,418.00	1,285,509,800		
三菱地所	531,700	1,965.00	1,044,790,500		
平和不動産	13,200	3,725.00	49,170,000		
東京建物	71,100	2,043.00	145,257,300		
京阪神ビルディング	15,100	1,400.00	21,140,000		

住友不動産	117,700	4,253.00	500,578,100		
太平洋興発	1,800	770.00	1,386,000	貸付株式数	800株
テーオーシー	14,500	689.00	9,990,500		
東京楽天地	1,300	6,770.00	8,801,000	貸付株式数	100株
スターツコーポレーション	11,700	2,760.00	32,292,000		
フジ住宅	10,200	687.00	7,007,400		
空港施設	11,300	578.00	6,531,400		
明和地所	4,000	1,201.00	4,804,000		
ゴールドクレスト	6,600	2,127.00	14,038,200	貸付株式数	2,600株
リログループ	42,600	1,562.50	66,562,500		
エスリード	3,800	3,190.00	12,122,000	貸付株式数	1,200株
日神グループHLDGS	13,000	482.00	6,266,000	貸付株式数	4,400株
日本エスコン	15,200	922.00	14,014,400		
MIRARTHホールディング	37,300	446.00	16,635,800		
ＡＶＡＮＴＩＡ	2,500	851.00	2,127,500	貸付株式数	600株
イオンモール	42,100	1,721.50	72,475,150		
毎日コムネット	1,600	734.00	1,174,400	貸付株式数	100株
ファースト住建	1,900	1,030.00	1,957,000	貸付株式数	900株
ランド	444,700	7.00	3,112,900	貸付株式数	171,300株
カチタス	21,900	2,131.00	46,668,900		
東祥	5,900	770.00	4,543,000	貸付株式数	2,000株
トーセイ	13,500	1,788.00	24,138,000	貸付株式数	5,400株
穴吹興産	900	1,981.00	1,782,900	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	12,000	1,560.00	18,720,000		
インテリックス	1,100	473.00	520,300		
ランドビジネス	1,600	268.00	428,800	貸付株式数	700株
サンネクスタグループ	1,300	942.00	1,224,600	貸付株式数	200株
グランディハウス	5,300	590.00	3,127,000		
東武鉄道	90,600	3,752.00	339,931,200		
相鉄ホールディングス	29,500	2,719.50	80,225,250		
東急	231,500	1,695.00	392,392,500		
京浜急行	102,100	1,282.00	130,892,200		
小田急電鉄	136,500	2,199.50	300,231,750		
京王電鉄	39,700	4,390.00	174,283,000		
京成電鉄	53,200	6,492.00	345,374,400		
富士急行	10,200	4,125.00	42,075,000	貸付株式数	3,700株
東日本旅客鉄道	151,700	8,138.00	1,234,534,600		
西日本旅客鉄道	97,900	5,849.00	572,617,100		
東海旅客鉄道	318,000	3,630.00	1,154,340,000		

西武ホールディングス	99,900	1,909.00	190,709,100	
鴻池運輸	14,000	1,825.00	25,550,000	
西日本鉄道	22,000	2,382.00	52,404,000	
ハマキョウレックス	7,000	3,950.00	27,650,000	
サカイ引越センター	9,100	2,635.00	23,978,500	
近鉄グループHLDGS	82,400	4,361.00	359,346,400	
阪急阪神HLDGS	109,900	4,424.00	486,197,600	
南海電鉄	36,700	2,856.00	104,815,200	貸付株式数 1,300株
京阪ホールディングス	45,400	3,724.00	169,069,600	
神戸電鉄	2,200	2,840.00	6,248,000	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	85,000	2,219.50	188,657,500	
山陽電鉄	6,100	2,109.00	12,864,900	貸付株式数 2,300株
アルプス物流	6,500	1,611.00	10,471,500	貸付株式数 2,200株
トランコム	2,400	7,350.00	17,640,000	
ヤマトホールディングス	105,600	2,593.50	273,873,600	
山 九	21,000	5,058.00	106,218,000	
日 新	6,300	2,420.00	15,246,000	
丸 運	2,600	260.00	676,000	貸付株式数 1,300株
丸全昭和運輸	5,100	3,710.00	18,921,000	
センコーグループHLDGS	43,500	1,061.00	46,153,500	
トナミホールディングス	1,800	4,675.00	8,415,000	
ニッコンホールディングス	26,400	2,987.50	78,870,000	
日石輸送	500	2,877.00	1,438,500	
福山通運	9,400	3,805.00	35,767,000	
セイノーホールディングス	46,300	2,063.00	95,516,900	貸付株式数 18,500株
エスライングループ本社	1,300	866.00	1,125,800	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,300	2,955.00	6,796,500	
AZ-COM丸和ホールディ	19,900	1,467.00	29,193,300	貸付株式数 7,900株
C&Fロジホールディングス	7,900	1,446.00	11,423,400	貸付株式数 800株
日本郵船	236,300	4,155.00	981,826,500	
商船三井	178,900	4,393.00	785,907,700	
川崎汽船	69,700	5,480.00	381,956,000	貸付株式数 27,800株
NSユナイテッド海運	4,400	4,850.00	21,340,000	貸付株式数 1,500株
明海グループ	5,000	706.00	3,530,000	
飯野海運	30,200	1,223.00	36,934,600	
共栄タンカー	800	825.00	660,000	貸付株式数 200株
九州旅客鉄道	58,200	3,113.00	181,176,600	
SGホールディングス	138,400	2,008.00	277,907,200	
NIPPON EXPRESS	28,000	7,888.00	220,864,000	
ID&E ホールディングス	5,100	3,250.00	16,575,000	

日本航空	202,400	2,786.00	563,886,400		
ANAホールディングス	224,300	3,064.00	687,255,200		
ビーウィズ	2,100	2,080.00	4,368,000	貸付株式数	800株
パスコ	900	1,727.00	1,554,300		
TREホールディングス	16,200	1,040.00	16,848,000		
人・夢・技術グループ	3,200	1,700.00	5,440,000		
西本WISMETTAC HD	2,200	5,540.00	12,188,000	貸付株式数	800株
シルバーライフ	1,700	1,025.00	1,742,500	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400	2,117.00	846,800		
GENKY DRUGSTORES	3,800	5,140.00	19,532,000	貸付株式数	1,300株
コーア商事HLDGS	4,800	704.00	3,379,200	貸付株式数	200株
KPPグループホールディン	22,600	684.00	15,458,400		
ナルミヤ・インターナショナル	800	1,138.00	910,400	貸付株式数	100株
ブックオフＧＨＤ	4,400	1,143.00	5,029,200	貸付株式数	1,700株
ギフトホールディングス	3,700	2,270.00	8,399,000		
三菱倉庫	20,300	4,314.00	87,574,200		
三井倉庫HOLD	7,700	4,740.00	36,498,000		
住友倉庫	22,200	2,450.00	54,390,000		
渋沢倉庫	3,700	2,787.00	10,311,900		
ヤマタネ	3,900	2,285.00	8,911,500		
東陽倉庫	1,200	1,510.00	1,812,000		
乾汽船	9,600	1,096.00	10,521,600	貸付株式数	3,800株
日本トランスシティ	16,400	615.00	10,086,000		
ケイヒン	800	1,750.00	1,400,000		
中央倉庫	4,400	1,088.00	4,787,200	貸付株式数	1,500株
川西倉庫	800	1,105.00	884,000	貸付株式数	200株
安田倉庫	5,500	1,111.00	6,110,500		
ファイズホールディングス	700	1,087.00	760,900	貸付株式数	400株
ＮＩＳＳＯＨＤ	7,300	751.00	5,482,300	貸付株式数	2,900株
大栄環境	15,400	2,242.00	34,526,800		
日本管財ホールディンク	8,900	2,512.00	22,356,800		
東洋埠頭	1,300	1,380.00	1,794,000		
上 組	39,500	3,311.00	130,784,500		
サンリツ	1,100	731.00	804,100	貸付株式数	300株
キムラユニティー	2,100	1,326.00	2,784,600		
キユーソー流通システム	3,200	897.00	2,870,400	貸付株式数	1,200株
東海運	2,600	282.00	733,200		
エーアイテイー	5,100	1,665.00	8,491,500		
内外トランスライン	3,300	2,501.00	8,253,300	貸付株式数	1,300株

ショーエイコーポ	1,400	571.00	799,400	貸付株式数	600株
日本コンセプト	3,000	1,664.00	4,992,000		
TBSホールディングス	42,400	2,960.00	125,504,000		
日本テレビHLDS	73,200	1,490.00	109,068,000		
朝日放送グループHD	7,600	646.00	4,909,600	貸付株式数	2,600株
テレビ朝日ＨＤ	19,900	1,626.00	32,357,400		
スカパーJSATHD	64,200	639.00	41,023,800		
テレビ東京ＨＤ	5,900	3,000.00	17,700,000		
日本ＢＳ放送	1,600	890.00	1,424,000		
ビジョン	12,500	1,193.00	14,912,500		
スマートバリュー	1,100	419.00	460,900	貸付株式数	400株
USEN-NEXT HLDGS	9,300	3,715.00	34,549,500	貸付株式数	3,300株
ワイヤレスゲート	2,000	237.00	474,000	貸付株式数	100株
日本通信	81,600	228.00	18,604,800		
クロップス	600	1,010.00	606,000		
日本電信電話	24,635,400	168.90	4,160,919,060		
ＫＤＤＩ	640,000	4,426.00	2,832,640,000		
ソフトバンク	1,332,400	1,735.50	2,312,380,200		
光通信	8,300	22,905.00	190,111,500		
エムティーアイ	5,600	580.00	3,248,000	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	30,600	2,496.50	76,392,900		
ファイバーゲート	4,500	890.00	4,005,000	貸付株式数	1,700株
アイドママーケティングコミュ	1,200	220.00	264,000	貸付株式数	600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	43,800	2,610.50	114,339,900		
学研ホールディングス	13,700	978.00	13,398,600		
ゼンリン	14,000	855.00	11,970,000		
昭文社ホールディングス	1,900	358.00	680,200		
インプレスホールディングス	4,600	178.00	818,800	貸付株式数	1,800株
東京電力ＨＤ	744,300	735.80	547,655,940	貸付株式数	255,600株
中部電力	304,300	1,849.50	562,802,850		
関西電力	318,900	1,913.00	610,055,700		
中国電力	143,500	1,004.50	144,145,750		
北陸電力	84,400	723.80	61,088,720		
東北電力	217,400	963.30	209,421,420		
四国電力	76,900	1,008.00	77,515,200		
九州電力	190,400	1,009.50	192,208,800		
北海道電力	79,700	628.30	50,075,510		
沖縄電力	21,000	1,104.00	23,184,000		

電源開発	67,800	2,264.50	153,533,100	
エフオン	5,300	457.00	2,422,100	
イーレックス	14,600	682.00	9,957,200	貸付株式数 5,800株
レノバ	22,000	1,102.00	24,244,000	貸付株式数 8,800株
東京瓦斯	174,500	3,492.00	609,354,000	
大阪瓦斯	167,200	2,883.50	482,121,200	
東邦瓦斯	35,700	2,690.50	96,050,850	
北海道瓦斯	4,900	2,149.00	10,530,100	貸付株式数 1,000株
広島ガス	17,100	368.00	6,292,800	
西部ガスHLDGS	8,500	1,884.00	16,014,000	
静岡ガス	16,400	1,002.00	16,432,800	貸付株式数 6,500株
メタウォーター	9,900	2,016.00	19,958,400	
アイネット	5,000	1,671.00	8,355,000	
松 竹	4,300	9,117.00	39,203,100	
東 宝	46,100	4,705.00	216,900,500	
エイチ・アイ・エス	24,700	1,955.00	48,288,500	貸付株式数 9,400株
東 映	2,700	20,370.00	54,999,000	
ラックランド	3,800	2,601.00	9,883,800	貸付株式数 1,500株
NTTデータグループ	216,600	1,887.00	408,724,200	
共立メンテナンス	13,300	5,574.00	74,134,200	貸付株式数 5,300株
イチネンホールディングス	8,900	1,506.00	13,403,400	
建設技術研究所	4,400	5,030.00	22,132,000	
スペース	5,500	947.00	5,208,500	
アインホールディングス	12,000	4,455.00	53,460,000	
燦ホールディングス	8,000	1,080.00	8,640,000	
ピー・シー・エー	4,800	1,091.00	5,236,800	
スバル興業	500	13,150.00	6,575,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	1,700	1,090.00	1,853,000	貸付株式数 600株
タナベコンサルティンググル	2,500	992.00	2,480,000	
ビジネスＢ太田昭和	3,200	2,106.00	6,739,200	
ナ ガ ワ	2,600	6,790.00	17,654,000	貸付株式数 1,000株
東京都競馬	7,100	4,390.00	31,169,000	貸付株式数 2,800株
常磐興産	1,800	1,229.00	2,212,200	貸付株式数 700株
カナモト	13,200	2,753.00	36,339,600	
ＤＴＳ	17,600	3,510.00	61,776,000	
スクウェア・エニックス・HD	37,800	4,760.00	179,928,000	
シーイーシー	10,500	1,607.00	16,873,500	
カプコン	74,000	4,550.00	336,700,000	

ニシオホールディングス	7,900	3,815.00	30,138,500		
アイ・エス・ビー	4,200	1,506.00	6,325,200	貸付株式数	1,200株
アゴーラ ホスピタリティーG	29,800	23.00	685,400	貸付株式数	15,600株
日本空港ビルデング	28,800	6,228.00	179,366,400		
トランス・コスモス	10,600	2,956.00	31,333,600	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	37,000	854.00	31,598,000		
ジャステック	5,100	1,407.00	7,175,700	貸付株式数	1,500株
ＳＣＳＫ	58,000	2,727.50	158,195,000		
藤田観光	3,400	4,525.00	15,385,000	貸付株式数	1,300株
KNT-CTホールディングス	5,100	1,289.00	6,573,900	貸付株式数	1,900株
トーカイ	7,500	1,979.00	14,842,500		
白 洋 舎	700	2,585.00	1,809,500	貸付株式数	100株
セコム	86,400	10,040.00	867,456,000		
ＮＳＷ	3,700	2,745.00	10,156,500		
セントラル警備保障	4,600	2,438.00	11,214,800	貸付株式数	100株
アイネス	6,400	1,602.00	10,252,800		
丹青社	16,400	841.00	13,792,400		
メイテックグループホールデ	30,600	2,739.50	83,828,700		
ＴＫＣ	13,100	3,460.00	45,326,000		
富士ソフト	16,600	5,710.00	94,786,000	貸付株式数	6,600株
応用地質	7,900	1,948.00	15,389,200		
船井総研ホールディン	17,600	2,465.00	43,384,000		
ＮＳＤ	29,500	2,722.00	80,299,000		
進学会ホールディングス	1,200	257.00	308,400		
丸紅建材リース	400	2,519.00	1,007,600		
オ オ バ	2,900	890.00	2,581,000	貸付株式数	1,300株
コナミグループ	31,000	7,082.00	219,542,000		
いであ	1,200	1,744.00	2,092,800		
学 究 社	3,400	1,924.00	6,541,600		
ベネッセホールディングス	28,600	2,635.00	75,361,000		
イオンディライト	9,400	3,535.00	33,229,000	貸付株式数	3,200株
ナック	3,600	974.00	3,506,400	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータHLDS	5,100	2,545.00	12,979,500		
ダイセキ	17,300	3,885.00	67,210,500	貸付株式数	5,900株
ステップ	3,100	1,871.00	5,800,100		
泉州電業	4,400	3,435.00	15,114,000	貸付株式数	700株
元気寿司	4,900	3,115.00	15,263,500	貸付株式数	1,900株
トラスコ中山	18,300	2,384.00	43,627,200		

ヤマダホールディングス	268,600	425.30	114,235,580		
オートバックスセブン	30,300	1,549.50	46,949,850		
モリト	6,200	1,242.00	7,700,400		
アークランズ	25,900	1,688.00	43,719,200		
ニトリホールディングス	31,800	18,150.00	577,170,000		
グルメ杵屋	6,900	1,042.00	7,189,800	貸付株式数	2,700株
愛 眼	3,500	177.00	619,500	貸付株式数	1,800株
ケーユーホールディングス	4,000	1,069.00	4,276,000		
吉野家ホールディングス	32,200	3,085.00	99,337,000	貸付株式数	13,200株
加藤産業	10,900	4,360.00	47,524,000		
北恵	1,200	813.00	975,600	貸付株式数	400株
イノテック	5,400	1,566.00	8,456,400		
イエローハット	13,900	1,724.00	23,963,600		
松屋フーズHLDGS	4,000	4,995.00	19,980,000	貸付株式数	200株
JBCCホールディングス	5,500	3,390.00	18,645,000		
JKホールディングス	6,600	1,004.00	6,626,400		
サガミホールディングス	13,000	1,367.00	17,771,000	貸付株式数	500株
日 伝	5,900	2,808.00	16,567,200		
関西フードマーケット	5,900	1,380.00	8,142,000		
ミロク情報サービス	7,500	1,659.00	12,442,500	貸付株式数	2,700株
北沢産業	2,900	269.00	780,100	貸付株式数	1,400株
杉本商事	4,200	2,139.00	8,983,800	貸付株式数	400株
因幡電機産業	22,600	3,340.00	75,484,000		
王将フードサービス	6,500	7,820.00	50,830,000	貸付株式数	1,500株
ミニストップ	6,400	1,497.00	9,580,800	貸付株式数	2,400株
アークス	16,000	2,715.00	43,440,000		
バローホールディングス	16,600	2,309.00	38,329,400		
東 テ ク	2,900	4,680.00	13,572,000		
ミスミグループ本社	131,900	2,104.50	277,583,550		
アルテック	2,500	232.00	580,000	貸付株式数	1,000株
ベ ル ク	4,300	6,130.00	26,359,000		
大 庄	3,600	1,199.00	4,316,400	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	1,200	988.00	1,185,600	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	39,300	35,160.00	1,381,788,000	貸付株式数	15,200株
ソフトバンクグループ	408,500	6,047.00	2,470,199,500		
蔵王産業	800	2,399.00	1,919,200		
スズケン	33,200	4,839.00	160,654,800		
サンドラッグ	29,500	4,315.00	127,292,500		
サックスバーホールディング	7,400	824.00	6,097,600		

ジェコス	5,100	1,021.00	5,207,100	
ヤマザワ	1,000	1,253.00	1,253,000	
や ま や	1,000	3,015.00	3,015,000	貸付株式数　400株
グローセル	8,900	680.00	6,052,000	
ベルーナ	20,900	591.00	12,351,900	
合計			271,694,881,710	

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

ソニーグループ　20,000株
トヨタ自動車　60,000株
三井住友フィナンシャルG　30,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月19日現在 金　額（円）	2023年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	852,713,701	1,877,453,939
コール・ローン	9,706,458,321	10,490,926,784
株式	266,686,770,469	389,010,712,465
投資証券	6,559,293,925	8,581,493,156
派生商品評価勘定	18,399,158	263,383,037
未収入金	2,691,322	3,481,831

未収配当金	267,062,544	438,781,439
差入委託証拠金	5,105,362,859	8,488,313,058
流動資産合計	289,198,752,299	419,154,545,709
資産合計	289,198,752,299	419,154,545,709
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	554,457,124	316,522,472
未払解約金	3,650,800	109,420,000
流動負債合計	558,107,924	425,942,472
負債合計	558,107,924	425,942,472
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	69,638,060,038	79,048,744,098
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	219,002,584,337	339,679,859,139
元本等合計	288,640,644,375	418,728,603,237
純資産合計	288,640,644,375	418,728,603,237
負債純資産合計	289,198,752,299	419,154,545,709

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12月20日 至2023年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

	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12月19日現在	2023年12月18日現在
1. ※1 期首	2021年12月21日	2022年12月20日
期首元本額	61,674,819,062円	69,638,060,038円
期中追加設定元本額	13,672,424,231円	13,935,683,680円
期中一部解約元本額	5,709,183,255円	4,524,999,620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	301,093,386円	252,201,357円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,459,588円	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)	36,734,762円	25,425,788円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	6,474,561円	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)	179,363,294円	130,046,867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）	69,674,877円	101,924,857円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	-円	89,930,302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）	523,783,713円	730,644,158円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	3,060,018,121円	4,665,956,172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）	642,031,802円	560,421,539円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	18,445,438円	20,707,782円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	48,152,485円	53,190,442円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	6,023,455,760円	7,628,470,875円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,382,417,663円	1,483,678,196円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	256,336,275円	322,769,357円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	2,911,681円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	43,954,399,858円	47,632,499,577円
ダイワ・ライフ・バランス３０	525,128,068円	500,377,466円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,008,584,575円	1,067,785,681円
ダイワ・ライフ・バランス７０	832,693,698円	1,025,339,397円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,901,552,608円	2,015,691,298円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,267,820円	12,498,122円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,252,667円	13,060,578円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,405,540,804円	2,142,692,877円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,875,196円	2,057,594円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,214,762円	2,504,278円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	4,705,642円	5,295,411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）	4,349,275円	11,578,719円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	75,082,129円	52,676,509円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	55,630,821円	33,932,785円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,203,874,057円	900,545,333円

	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	62,417,353円	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）	171,714,594円	140,109,625円
	スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	36,916円
	スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	62,672円
	スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	88,640円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	31,336円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	55,374円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	88,833円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	28,073円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	47,882円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	84,991円
	ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,158,534,062円	1,390,103,806円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	428,235,087円	433,076,574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）	1,278,896,305円	2,336,572,680円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,899,354,934円	3,037,904,988円
	ダイワライフスタイル２５	10,503,837円	8,563,694円
	ダイワライフスタイル５０	43,488,340円	38,800,537円
	ダイワライフスタイル７５	33,321,821円	32,426,160円
	ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	89,157,328円
計		69,638,060,038円	79,048,744,098円
2.	期末日における受益権の総数	69,638,060,038口	79,048,744,098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12月20日 至2023年12月18日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
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12月18日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月19日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△7,317,666,326	13,600,937,161
投資証券	△162,880,772	605,967,111
合計	△7,480,547,098	14,206,904,272

（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12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	15,921,824,688	-	15,417,025,282	△504,799,406	21,247,150,443	-	21,504,373,808	257,223,365
合計	15,921,824,688	-	15,417,025,282	△504,799,406	21,247,150,443	-	21,504,373,808	257,223,365

（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12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	9,898,107,170	-	9,866,848,610	△31,258,560	10,824,965,810	-	10,514,603,010	△310,362,800
アメリカ・ドル	6,311,592,350	-	6,287,063,110	△24,529,240	6,537,435,720	-	6,344,549,120	△192,886,600
イギリス・ポンド	628,979,230	-	628,593,720	△385,510	368,829,410	-	359,306,400	△9,523,010
オーストラリア・ドル	388,552,560	-	382,492,740	△6,059,820	660,238,240	-	646,463,080	△13,775,160
カナダ・ドル	599,086,420	-	586,109,540	△12,976,880	996,957,150	-	974,235,840	△22,721,310
スイス・フラン	625,658,000	-	627,512,760	1,854,760	825,467,070	-	799,299,270	△26,167,800
ユーロ	1,344,238,610	-	1,355,076,740	10,838,130	1,436,038,220	-	1,390,749,300	△45,288,920
合計	9,898,107,170	-	9,866,848,610	△31,258,560	10,824,965,810	-	10,514,603,010	△310,362,800

（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12月19日現在	2023年12月18日現在

１口当たり純資産額	4.1449円	5.2971円
（1万口当たり純資産額）	(41,449円)	(52,971円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	6,000	193.750	1,162,500.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	15,600	307.300	4,793,880.000	
	FIRST SOLAR INC	5,200	168.670	877,084.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,000	158.530	1,426,770.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,700	125.020	837,634.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,100	121.500	376,650.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	37.120	783,232.000	
	ABBOTT LABORATORIES	87,466	107.290	9,384,227.140	
	HOWMET AEROSPACE INC	19,783	52.800	1,044,542.400	
	VERISK ANALYTICS INC	7,300	235.000	1,715,500.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	17,400	47.870	832,938.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	30,100	99.280	2,988,328.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,300	633.310	1,456,613.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	29,900	59.410	1,776,359.000	
	QORVO INC	5,020	112.260	563,545.200	
	AFLAC INC	28,500	80.570	2,296,245.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	6,100	162.490	991,189.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	8,200	93.000	762,600.000	
	ADOBE INC	23,020	584.680	13,459,333.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,800	76.240	747,152.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,900	491.460	2,899,614.000	
	GARMIN LTD	7,800	126.130	983,814.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,200	270.860	3,033,632.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	33,500	203.400	6,813,900.000	
	WR BERKLEY CORP	10,442	70.220	733,237.240	
	AUTOZONE INC	920	2,628.050	2,417,806.000	
	DOLLAR TREE INC	10,571	130.810	1,382,792.510	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	58,300	9.980	581,834.000	
	CELANESE CORP	5,250	152.000	798,000.000	

DR HORTON INC	15,416	150.110	2,314,095.760	
AUTODESK INC	10,800	242.290	2,616,732.000	
MOODY'S CORP	8,400	389.060	3,268,104.000	
DEVON ENERGY CORP	32,300	44.870	1,449,301.000	
ALBEMARLE CORP	6,000	147.060	882,360.000	
ATMOS ENERGY CORP	7,500	114.820	861,150.000	
ALLIANT ENERGY CORP	12,800	50.620	647,936.000	
CITIGROUP INC	96,973	49.830	4,832,164.590	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,800	234.140	4,870,112.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,000	82.230	2,137,980.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,830	400.050	732,091.500	
HESS CORP	14,000	144.610	2,024,540.000	
DAVITA INC	2,750	105.690	290,647.500	
DANAHER CORP	35,350	227.230	8,032,580.500	
FORTIVE CORP	17,800	72.080	1,283,024.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	28,900	123.100	3,557,590.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,000	75.750	2,045,250.000	
TE CONNECTIVITY LTD	15,895	141.620	2,251,049.900	
APPLE INC	787,200	197.570	155,527,104.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,600	106.030	1,335,978.000	
BOEING CO/THE	28,900	264.270	7,637,403.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,915	102.480	811,129.200	
BECTON DICKINSON AND CO	14,699	237.010	3,483,809.990	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,600	107.550	709,830.000	
NISOURCE INC	20,900	26.480	553,432.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,900	84.950	501,205.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	39,271	51.630	2,027,561.730	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	211,804	37.370	7,915,115.480	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	65,950	356.500	23,511,175.000	
ANSYS INC	4,400	295.470	1,300,068.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	67,117	36.700	2,463,193.900	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	35,800	129.370	4,631,446.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	105,200	50.890	5,353,628.000	
JPMORGAN CHASE & CO	146,370	165.230	24,184,715.100	
T ROWE PRICE GROUP INC	11,300	106.280	1,200,964.000	
LKQ CORP	13,500	46.600	629,100.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,712	57.330	900,768.960	
CADENCE DESIGN SYS INC	13,700	271.520	3,719,824.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,200	377.850	1,964,820.000	

DOLLAR GENERAL CORP	11,100	129.980	1,442,778.000	
SERVICENOW INC	10,300	698.240	7,191,872.000	
CATERPILLAR INC	25,700	285.740	7,343,518.000	
BROWN & BROWN INC	12,200	69.470	847,534.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,700	36.090	458,343.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,600	230.810	600,106.000	
CMS ENERGY CORP	14,700	57.980	852,306.000	
MOSAIC CO/THE	16,800	36.620	615,216.000	
DELTA AIR LINES INC	8,200	42.340	347,188.000	
CORNING INC	40,900	30.460	1,245,814.000	
CISCO SYSTEMS INC	203,950	49.870	10,170,986.500	
MORGAN STANLEY	62,652	91.580	5,737,670.160	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,400	702.810	983,934.000	
MSCI INC	4,000	531.580	2,126,320.000	
FAIR ISAAC CORP	1,300	1,129.780	1,468,714.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,700	441.510	750,567.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,100	214.190	663,989.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,300	60.150	679,695.000	
BROADCOM INC	22,412	1,129.740	25,319,732.880	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,400	246.450	591,480.000	
CNH INDUSTRIAL NV	52,300	11.480	600,404.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	144.680	448,508.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,300	185.240	1,167,012.000	
DTE ENERGY COMPANY	10,400	109.900	1,142,960.000	
CENTENE CORP	27,307	74.220	2,026,725.540	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,400	175.040	945,216.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,400	33.560	785,304.000	
DARLING INGREDIENTS INC	8,100	48.890	396,009.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,900	222.810	2,428,629.000	
GARTNER INC	4,050	444.420	1,799,901.000	
SPLUNK INC	8,100	152.560	1,235,736.000	
DOMINION ENERGY INC	42,141	48.480	2,042,995.680	
MONSTER BEVERAGE CORP	39,600	55.090	2,181,564.000	
SMITH (A.O.) CORP	6,300	79.200	498,960.000	
DEERE & CO	13,800	386.070	5,327,766.000	
QUANTA SERVICES INC	7,400	215.020	1,591,148.000	
POOL CORP	2,000	392.400	784,800.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,184	128.180	1,689,925.120	
BURLINGTON STORES INC	3,300	183.050	604,065.000	

NASDAQ INC	17,400	54.740	952,476.000	
VAIL RESORTS INC	2,000	226.880	453,760.000	
TARGA RESOURCES CORP	10,700	85.410	913,887.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,700	118.960	440,152.000	
WESTLAKE CORP	2,000	140.100	280,200.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	17,400	89.850	1,563,390.000	
TELEFLEX INC	2,400	254.580	610,992.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,200	202.220	849,324.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,800	358.200	1,361,160.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,100	306.120	336,732.000	
CATALENT INC	9,100	41.480	377,468.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,800	180.670	1,409,226.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,000	362.980	1,088,940.000	
CARLISLE COS INC	2,600	314.410	817,466.000	
IDEX CORP	3,900	211.350	824,265.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	39,600	76.980	3,048,408.000	
ROLLINS INC	14,807	42.150	624,115.050	
AECOM	6,700	92.280	618,276.000	
WATSCO INC	1,700	421.150	715,955.000	
GRACO INC	8,600	85.100	731,860.000	
AMETEK INC	11,700	163.130	1,908,621.000	
TORO CO	5,300	87.400	463,220.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,400	91.500	1,134,600.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	8,150	57.800	471,070.000	
HEICO CORP	2,300	181.850	418,255.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,000	456.960	913,920.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,100	95.020	1,244,762.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,200	410.420	902,924.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,360	658.820	14,731,215.200	
EPAM SYSTEMS INC	3,000	293.070	879,210.000	
RPM INTERNATIONAL INC	6,500	111.920	727,480.000	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	3,000	270.520	811,560.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,400	2,271.470	3,180,058.000	
CUMMINS INC	7,200	241.530	1,739,016.000	
CDW CORP/DE	6,800	223.230	1,517,964.000	
COSTAR GROUP INC	20,600	87.570	1,803,942.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,000	393.050	1,965,250.000	
MERCADOLIBRE INC	2,290	1,606.190	3,678,175.100	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,700	164.360	608,132.000	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,216	177.230	2,342,271.680	
DEXCOM INC	19,600	122.590	2,402,764.000	
NORDSON CORP	2,590	251.960	652,576.400	
COPART INC	43,400	48.910	2,122,694.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,600	153.110	1,316,746.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,700	255.010	943,537.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,900	209.890	818,571.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,790	985.590	2,749,796.100	
BIO-TECHNE CORP	8,020	75.990	609,439.800	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,000	120.220	601,100.000	
KINDER MORGAN INC	100,981	17.490	1,766,157.690	
HCA HEALTHCARE INC	10,300	270.390	2,785,017.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,900	279.200	530,480.000	
COTERRA ENERGY INC	38,100	25.130	957,453.000	
T-MOBILE US INC	26,727	156.150	4,173,421.050	
ZILLOW GROUP INC - C	7,450	55.800	415,710.000	
COCA-COLA CO/THE	206,950	58.600	12,127,270.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,100	64.690	653,369.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	124.450	914,707.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	15,100	29.390	443,789.000	
CSX CORP	101,000	34.000	3,434,000.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,500	219.500	987,750.000	
EXPEDIA GROUP INC	7,025	145.990	1,025,579.750	
AMAZON.COM INC	467,800	149.970	70,155,966.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,700	76.900	2,360,830.000	
EXXON MOBIL CORP	201,705	100.900	20,352,034.500	
AES CORP	33,800	19.350	654,030.000	
EVEREST GROUP LTD	2,200	356.080	783,376.000	
EOG RESOURCES INC	29,400	120.110	3,531,234.000	
EQT CORP	19,800	38.440	761,112.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,700	119.140	917,378.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	600	1,430.730	858,438.000	
CENCORA INC	8,600	200.330	1,722,838.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,800	136.780	2,024,344.000	
FORD MOTOR CO	198,023	12.020	2,380,236.460	
EXACT SCIENCES CORP	9,100	65.900	599,690.000	
ENTEGRIS INC	7,600	118.350	899,460.000	
AERCAP HOLDINGS NV	9,300	73.940	687,642.000	
FORTINET INC	33,700	57.830	1,948,871.000	

MARKEL CORP	610	1,394.900	850,889.000	
NEXTERA ENERGY INC	103,380	61.500	6,357,870.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	72,208	41.500	2,996,632.000	
INSULET CORP	3,600	206.970	745,092.000	
US BANCORP	77,200	45.010	3,474,772.000	
UNITED RENTALS INC	3,500	571.740	2,001,090.000	
F5 NETWORKS INC	3,000	177.620	532,860.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	2,400	300.110	720,264.000	
FASTENAL CO	28,800	64.160	1,847,808.000	
FISERV INC	30,733	133.010	4,087,796.330	
GENERAL ELECTRIC CO	54,906	123.230	6,766,066.380	
AXON ENTERPRISE INC	3,600	255.980	921,528.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,300	165.250	380,075.000	
GENERAL MOTORS CO	69,300	35.730	2,476,089.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,700	252.550	2,954,835.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,650	380.510	6,335,491.500	
ALPHABET INC-CL A	298,800	132.600	39,620,880.000	
ALPHABET INC-CL C	262,840	133.840	35,178,505.600	
OWENS CORNING	4,600	152.430	701,178.000	
GENERAL MILLS INC	29,300	65.220	1,910,946.000	
FIRSTENERGY CORP	27,518	36.980	1,017,615.640	
GENUINE PARTS CO	7,150	138.390	989,488.500	
FIFTH THIRD BANCORP	34,300	35.030	1,201,529.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,550	208.370	1,989,933.500	
HALLIBURTON CO	45,300	35.820	1,622,646.000	
REPLIGEN CORP	2,700	181.215	489,280.500	
HOME DEPOT INC	50,450	354.000	17,859,300.000	
ASSURANT INC	2,750	163.290	449,047.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	73,000	12.860	938,780.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,010	253.550	509,635.500	
HERSHEY CO/THE	7,600	181.710	1,380,996.000	
HUMANA INC	6,300	461.460	2,907,198.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,000	232.930	3,028,090.000	
HENRY SCHEIN INC	6,600	74.150	489,390.000	
HP INC	44,700	30.780	1,375,866.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	64,600	16.720	1,080,112.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,800	73.420	1,380,296.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	43,303	36.590	1,584,456.770	
ENPHASE ENERGY INC	6,900	123.920	855,048.000	

INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,900	162.230	7,446,357.000	
HUBBELL INC	2,800	325.430	911,204.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	16,600	37.430	621,338.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	6,400	79.400	508,160.000	
ZOETIS INC	23,200	196.290	4,553,928.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,599	239.920	2,782,832.080	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	69.650	473,620.000	
CHENIERE ENERGY INC	12,200	170.200	2,076,440.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	130.640	300,472.000	
ALLEGION PLC	4,350	117.520	511,212.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,300	162.510	1,023,813.000	
WASTE CONNECTIONS INC	13,037	145.410	1,895,710.170	
JUNIPER NETWORKS INC	16,200	29.310	474,822.000	
JM SMUCKER CO/THE	5,400	123.590	667,386.000	
JOHNSON & JOHNSON	121,300	155.160	18,820,908.000	
ABBVIE INC	88,972	154.040	13,705,246.880	
HOLOGIC INC	12,400	70.980	880,152.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,100	119.440	2,042,424.000	
KROGER CO	34,500	44.110	1,521,795.000	
KLA CORP	6,900	585.130	4,037,397.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	11,300	441.810	4,992,453.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,600	277.430	998,748.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	41.240	433,020.000	
LOWE'S COS INC	29,100	225.590	6,564,669.000	
ELI LILLY & CO	40,685	572.040	23,273,447.400	
LAM RESEARCH CORP	6,680	773.500	5,166,980.000	
LOEWS CORP	9,700	68.000	659,600.000	
MCDONALD'S CORP	36,750	287.270	10,557,172.500	
3M CO	27,890	106.980	2,983,672.200	
META PLATFORMS INC CLASS A	112,000	334.920	37,511,040.000	
S&P GLOBAL INC	16,439	435.780	7,163,787.420	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,200	489.940	1,567,808.000	
PHILLIPS 66	22,400	129.870	2,909,088.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,900	229.560	1,813,524.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,050	43.100	605,555.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,700	66.880	849,376.000	
METLIFE INC	32,200	66.360	2,136,792.000	

MARVELL TECHNOLOGY INC	43,500	59.590	2,592,165.000	
ARISTA NETWORKS INC	13,300	235.600	3,133,480.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,498	310.500	2,638,629.000	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,100	1,190.610	1,309,671.000	
BAKER HUGHES CO	50,923	33.580	1,709,994.340	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,800	304.370	1,765,346.000	
MERCK & CO. INC.	127,821	105.110	13,435,265.310	
DUPONT DE NEMOURS INC	23,151	73.230	1,695,347.730	
MASCO CORP	11,400	68.640	782,496.000	
M & T BANK CORP	8,399	142.760	1,199,041.240	
MARSH & MCLENNAN COS	24,970	187.120	4,672,386.400	
HEICO CORP-CLASS A	3,820	143.550	548,361.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,802	221.140	2,831,034.280	
WORKDAY INC-CLASS A	10,500	272.700	2,863,350.000	
BLOCK INC CLASS A	27,712	74.210	2,056,507.520	
TRANSUNION	9,800	68.590	672,182.000	
VISTRA CORP	16,600	37.680	625,488.000	
NETAPP INC	10,600	88.920	942,552.000	
NIKE INC -CL B	61,700	121.550	7,499,635.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,500	232.270	2,671,105.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,500	92.200	2,535,500.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,005	110.020	1,100,750.100	
ALLY FINANCIAL INC	13,700	34.880	477,856.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,300	461.050	3,365,665.000	
APTIV PLC	14,300	87.200	1,246,960.000	
NEWMONT CORP	58,811	40.870	2,403,605.570	
MCKESSON CORP	6,800	439.470	2,988,396.000	
XYLEM INC	12,200	110.720	1,350,784.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	78,200	94.460	7,386,772.000	
NUCOR CORP	12,600	172.820	2,177,532.000	
GODADDY INC - CLASS A	7,000	105.080	735,560.000	
EVERGY INC	11,650	51.760	603,004.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	58.560	1,963,165.440	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,350	324.230	437,710.500	
OKTA INC	7,900	83.170	657,043.000	
LIBERTY BROADBAND-C	6,100	77.410	472,201.000	
WIX.COM LTD	2,810	112.350	315,703.500	
EQUITABLE HOLDINGS INC	17,500	34.040	595,700.000	
KKR & CO INC	29,000	83.810	2,430,490.000	

PAYCHEX INC	16,400	126.840	2,080,176.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,100	951.570	2,949,867.000	
ALTRIA GROUP INC	89,400	41.750	3,732,450.000	
P G & E CORP	102,300	17.760	1,816,848.000	
PFIZER INC	284,413	26.630	7,573,918.190	
CIGNA CORP	15,000	290.500	4,357,500.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	12,901	71.620	923,969.620	
XCEL ENERGY INC	27,800	61.580	1,711,924.000	
STERIS PLC	5,000	212.640	1,063,200.000	
SEA LTD-ADR	19,000	35.740	679,060.000	
FOX CORP - CLASS B	7,133	27.650	197,227.450	
FOX CORP - CLASS A	12,599	29.780	375,198.220	
STRYKER CORP	17,280	290.150	5,013,792.000	
DOW INC	35,418	54.240	1,921,072.320	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,500	88.240	485,320.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,100	71.570	865,997.000	
PARKER HANNIFIN CORP	6,500	453.600	2,948,400.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	92,700	61.860	5,734,422.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,800	227.150	2,680,370.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	118,767	143.960	17,097,697.320	
EXELON CORP	50,122	35.490	1,778,829.780	
INGERSOLL-RAND INC	20,408	74.840	1,527,334.720	
NVR INC	160	6,880.730	1,100,916.800	
CONOCOPHILLIPS	60,302	114.540	6,906,991.080	
TWILIO INC - A	8,700	75.960	660,852.000	
DOCUSIGN INC	10,300	63.110	650,033.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,800	202.770	567,756.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	7,500	68.410	513,075.000	
PEPSICO INC	69,300	167.000	11,573,100.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,220	205.930	457,164.600	
DROPBOX INC-CLASS A	13,100	29.620	388,022.000	
MONGODB INC	3,600	420.170	1,512,612.000	
SNAP INC - A	51,700	16.920	874,764.000	
CORTEVA INC	35,768	46.550	1,665,000.400	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,300	103.860	1,900,638.000	
AMCOR PLC	72,800	9.600	698,880.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	11,400	260.080	2,964,912.000	
ROKU INC	6,300	95.930	604,359.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,900	131.750	1,304,325.000	

ACCENTURE PLC-CL A	31,600	344.150	10,875,140.000	
PENTAIR PLC	8,375	70.930	594,038.750	
QUALCOMM INC	56,300	143.130	8,058,219.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,200	78.450	957,090.000	
DATADOG INC - CLASS A	12,900	122.600	1,581,540.000	
PINTEREST INC- CLASS A	29,300	37.370	1,094,941.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,400	859.140	4,639,356.000	
REPUBLIC SERVICES INC	11,200	162.080	1,815,296.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,800	3,479.120	6,262,416.000	
ROSS STORES INC	17,100	133.940	2,290,374.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,530	164.760	746,362.800	
RESMED INC	7,500	169.050	1,267,875.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,730	135.030	773,721.900	
ROBERT HALF INTL INC	5,400	87.010	469,854.000	
MODERNA INC	16,300	86.010	1,401,963.000	
HUBSPOT INC	2,480	557.720	1,383,145.600	
REVVITY INC	6,300	101.160	637,308.000	
CARRIER GLOBAL CORP	42,187	57.330	2,418,580.710	
OTIS WORLDWIDE CORP	20,738	90.190	1,870,360.220	
BILL HOLDINGS INC	4,900	75.960	372,204.000	
AVANTOR INC	34,100	23.010	784,641.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,900	41.840	456,056.000	
DYNATRACE INC	12,600	54.620	688,212.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	22,500	74.890	1,685,025.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	47,285	19.530	923,476.050	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	19,300	27.370	528,241.000	
MATCH GROUP INC	14,100	34.300	483,630.000	
CHEVRON CORP	91,418	149.350	13,653,278.300	
ZSCALER INC	4,500	221.660	997,470.000	
EDISON INTERNATIONAL	19,400	70.050	1,358,970.000	
ETSY INC	6,200	80.680	500,216.000	
TESLA INC	143,950	253.500	36,491,325.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,200	199.010	2,825,942.000	
GEN DIGITAL INC	29,000	23.180	672,220.000	
UNITY SOFTWARE INC	12,600	39.360	495,936.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,802	98.630	769,511.260	
SYNOPSYS INC	7,700	556.270	4,283,279.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,100	85.050	1,199,205.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	379.930	1,863,556.650	

VIATRIS INC	60,421	10.270	620,523.670	
DOORDASH INC - A	12,950	101.570	1,315,331.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	21,500	43.920	944,280.000	
AIRBNB INC-CLASS A	21,500	146.600	3,151,900.000	
CBRE GROUP INC - A	15,700	91.120	1,430,584.000	
SOUTHERN CO/THE	55,000	70.860	3,897,300.000	
SYSCO CORP	25,400	73.540	1,867,916.000	
TRAVELERS COS INC/THE	11,603	182.810	2,121,144.430	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	54.950	159,355.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,700	62.000	353,400.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,950	124.520	989,934.000	
SCHLUMBERGER LTD	71,652	52.190	3,739,517.880	
AT&T INC	360,091	16.520	5,948,703.320	
APA CORP	15,500	35.350	547,925.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,550	29.010	219,025.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	21,800	85.650	1,867,170.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,900	47.950	522,655.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,300	309.770	3,810,171.000	
SEMPRA ENERGY	31,700	75.220	2,384,474.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	50.250	527,625.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	93,100	18.200	1,694,420.000	
UIPATH INC - CLASS A	19,600	25.680	503,328.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	10,050	84.280	847,014.000	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,700	147.900	1,286,730.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	45,800	168.640	7,723,712.000	
SALESFORCE.COM INC	49,066	261.600	12,835,665.600	
WESTROCK CO	13,000	42.540	553,020.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	20,009	94.480	1,890,450.320	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	34,334	52.440	1,800,474.960	
TERADYNE INC	7,800	105.160	820,248.000	
UNION PACIFIC CORP	30,780	241.980	7,448,144.400	
MARATHON OIL CORP	30,500	24.320	741,760.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	20,088	148.380	2,980,657.440	
RTX CORP	73,379	80.280	5,890,866.120	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,500	162.940	5,947,310.000	
IQVIA HOLDINGS INC	9,304	226.720	2,109,402.880	
AMEREN CORPORATION	13,300	71.730	954,009.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	46,666	531.120	24,785,245.920	

TOAST INC CLASS A	16,700	16.840	281,228.000	
VERISIGN INC	4,700	206.650	971,255.000	
LUCID GROUP INC	44,900	4.770	214,173.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	33,200	22.830	757,956.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	22,200	11.690	259,518.000	
VALERO ENERGY CORP	17,842	128.570	2,293,945.940	
ULTA BEAUTY INC	2,500	490.630	1,226,575.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,088	48.570	635,684.160	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,130	148.830	465,837.900	
ELEVANCE HEALTH INC	11,900	468.460	5,574,674.000	
WALT DISNEY CO/THE	92,162	93.460	8,613,460.520	
WELLS FARGO & CO	184,322	50.310	9,273,239.820	
WASTE MANAGEMENT INC	20,400	174.550	3,560,820.000	
WILLIAMS COS INC	61,300	34.620	2,122,206.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,500	217.300	1,195,150.000	
WALMART INC	74,600	152.740	11,394,404.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,600	118.690	1,258,114.000	
WYNN RESORTS LTD	5,200	88.760	461,552.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	97,400	3.150	306,810.000	
CELSIUS HOLDINGS INC	2,700	49.680	134,136.000	
WABTEC CORP	9,111	122.080	1,112,270.880	
TJX COMPANIES INC	57,700	89.290	5,152,033.000	
WATERS CORP	3,000	320.140	960,420.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,600	270.180	702,468.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,000	25.200	932,400.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,363	236.730	1,269,582.990	
WESTERN DIGITAL CORP	16,400	50.680	831,152.000	
WEC ENERGY GROUP INC	15,900	82.460	1,311,114.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	25,200	61.540	1,550,808.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	80,950	258.030	20,887,528.500	
PPL CORP	37,200	26.900	1,000,680.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	16,224	118.750	1,926,600.000	
PULTEGROUP INC	11,050	102.490	1,132,514.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	116,653	12.260	1,430,165.780	
PPG INDUSTRIES INC	11,900	148.680	1,769,292.000	

NORTHERN TRUST CORP	10,500	85.450	897,225.000	
FERGUSON PLC	10,300	188.910	1,945,773.000	
NVIDIA CORP	124,480	488.900	60,858,272.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,113	152.330	3,063,813.290	
DRAFTKINGS INC CLASS A	21,000	35.350	742,350.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,500	207.650	311,475.000	
TYSON FOODS INC-CL A	14,400	51.810	746,064.000	
NETFLIX INC	22,390	472.060	10,569,423.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,500	518.030	10,101,585.000	
NRG ENERGY INC	11,550	48.760	563,178.000	
GLOBE LIFE INC	4,855	121.940	592,018.700	
TEXTRON INC	10,000	79.340	793,400.000	
NEWS CORP - CLASS A	19,287	23.400	451,315.800	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,597.230	559,030.500	
OMNICOM GROUP	10,000	86.800	868,000.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	6,420	126.790	813,991.800	
ORACLE CORP	82,833	103.320	8,558,305.560	
MASTERCARD INC - A	42,400	418.570	17,747,368.000	
ONEOK INC	29,600	67.930	2,010,728.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,400	541.550	2,924,370.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	4,900	62.750	307,475.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	8,300	116.650	968,195.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,700	75.770	431,889.000	
HF SINCLAIR CORP	7,300	55.970	408,581.000	
OVINTIV INC	13,100	43.260	566,706.000	
YUM! BRANDS INC	14,200	128.640	1,826,688.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,600	160.200	1,377,720.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,600	61.800	593,280.000	
BANK OF AMERICA CORP	360,201	33.600	12,102,753.600	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,400	425.920	1,022,208.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,500	97.160	923,020.000	
AMERICAN EXPRESS CO	31,600	180.510	5,704,116.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	20,635	75.010	1,547,831.350	
LINDE PLC	24,646	407.380	10,040,287.480	
ANALOG DEVICES INC	25,091	200.880	5,040,280.080	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	17,500	22.660	396,550.000	
MONDAYCOM LTD	1,400	189.070	264,698.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	81,427	139.150	11,330,567.050	

LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	8,028	27.840	223,499.520	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	10,000	64.390	643,900.000	
CONFLUENT INC CLASS A	9,200	24.970	229,724.000	
KENVUE INC	87,200	20.990	1,830,328.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	4,700	39.290	184,663.000	
VERALTO CORP	11,816	78.850	931,691.600	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	35,872	66.010	2,367,910.720	
BUNGE GLOBAL LTD	7,600	104.780	796,328.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	17,900	47.730	854,367.000	
LIBERTY GLOBAL LTD CLASS C	12,973	16.800	217,946.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,100	112.590	911,979.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,300	122.520	1,506,996.000	
AVERY DENNISON CORP	4,130	197.780	816,831.400	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	25,500	76.170	1,942,335.000	
EMERSON ELECTRIC CO	28,800	95.650	2,754,720.000	
AON PLC-CLASS A	10,300	310.430	3,197,429.000	
AMGEN INC	27,000	275.450	7,437,150.000	
EATON CORP PLC	20,136	237.410	4,780,487.760	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,400	236.460	1,986,264.000	
APPLIED MATERIALS INC	42,200	161.950	6,834,290.000	
CME GROUP INC	18,200	206.730	3,762,486.000	
ECOLAB INC	13,000	196.780	2,558,140.000	
EQUIFAX INC	6,200	244.600	1,516,520.000	
GILEAD SCIENCES INC	62,800	80.330	5,044,724.000	
KEURIG DR PEPPER INC	53,100	31.970	1,697,607.000	
HORMEL FOODS CORP	15,200	31.080	472,416.000	
STATE STREET CORP	16,013	77.630	1,243,089.190	
SCHWAB (CHARLES) CORP	75,840	70.980	5,383,123.200	
BAXTER INTERNATIONAL INC	25,600	38.700	990,720.000	
CAMPBELL SOUP CO	9,800	43.880	430,024.000	
CROWN HOLDINGS INC	6,080	90.060	547,564.800	
CARDINAL HEALTH INC	12,300	100.490	1,236,027.000	
FEDEX CORP	12,100	281.290	3,403,609.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	19,254	129.680	2,496,858.720	
FMC CORP	6,350	59.510	377,888.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,913	79.620	1,028,133.060	
INTEL CORP	211,000	46.160	9,739,760.000	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,400	32.850	637,290.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,450	79.840	1,233,528.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	15,300	258.340	3,952,602.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	5.400	208,440.000	
ILLUMINA INC	8,000	127.100	1,016,800.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	17,700	324.350	5,740,995.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,950	146.020	722,799.000	
SNAP-ON INC	2,700	286.280	772,956.000	
CARMAX INC	8,000	74.740	597,920.000	
DUKE ENERGY CORP	38,828	96.630	3,751,949.640	
TARGET CORP	23,300	138.370	3,224,021.000	
DOVER CORP	7,100	152.200	1,080,620.000	
WW GRAINGER INC	2,300	823.540	1,894,142.000	
JABIL INC	6,600	132.910	877,206.000	
CINTAS CORP	4,700	558.710	2,625,937.000	
CONAGRA BRANDS INC	24,100	29.330	706,853.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,300	104.330	761,609.000	
CLOROX COMPANY	6,300	141.910	894,033.000	
ENTERGY CORP	10,700	100.880	1,079,416.000	
MICROSOFT CORP	355,500	370.730	131,794,515.000	
INCYTE CORP	9,600	62.300	598,080.000	
CVS HEALTH CORP	64,769	74.430	4,820,756.670	
MEDTRONIC PLC	67,098	82.610	5,542,965.780	
MICRON TECHNOLOGY INC	55,300	81.410	4,501,973.000	
BLACKROCK INC	7,600	819.000	6,224,400.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,800	28.860	917,748.000	
HASBRO INC	6,700	50.380	337,546.000	
KELLOGG CO	13,800	53.770	742,026.000	
KEYCORP	47,200	14.320	675,904.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	68,511	70.700	4,843,727.700	
COOPER COS INC/THE	2,500	363.200	908,000.000	
CHUBB LTD	20,699	220.070	4,555,228.930	
ALLSTATE CORP	13,200	139.060	1,835,592.000	
EBAY INC	26,800	41.750	1,118,900.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	52,550	61.260	3,219,213.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	6,000	88.470	530,820.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,700	143.640	1,680,588.000	
TRIMBLE INC	12,600	51.770	652,302.000	
LENNAR CORP-A	12,600	149.280	1,880,928.000	

	LEAR CORP	2,900	137.370	398,373.000	
	PROGRESSIVE CORP	29,500	153.410	4,525,595.000	
	PACCAR INC	26,355	96.250	2,536,668.750	
	BIOGEN INC	7,300	248.130	1,811,349.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	4,200	541.070	2,272,494.000	
	STARBUCKS CORP	57,700	96.750	5,582,475.000	
	PTC INC	6,000	171.070	1,026,420.000	
	EVERSOURCE ENERGY	17,600	61.820	1,088,032.000	
	INTUIT INC	14,180	608.510	8,628,671.800	
	BORGWARNER INC	11,900	34.860	414,834.000	
	BEST BUY CO INC	9,950	77.320	769,334.000	
	BALL CORP	15,904	58.430	929,270.720	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	73,797	55.810	4,118,610.570	
	ELECTRONIC ARTS INC	13,000	138.830	1,804,790.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,700	224.350	1,503,145.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,000	410.680	5,338,840.000	
	VF CORP	16,000	19.910	318,560.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	24,525	16.270	399,021.750	
	CARNIVAL CORP	50,800	18.610	945,388.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	25,000	18.700	467,500.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	207,190	44.480	9,215,811.200	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	40.000	348,000.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	57,600	3.380	194,688.000	
アメリカ・ドル 小計				2,056,759,571.320 (292,471,211,041)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	332,734	25.030	8,328,332.020	
	HALEON PLC	278,682	3.176	885,233.370	
	WISE PLC CLASS A	30,273	8.036	243,273.820	
	BP PLC	858,283	4.578	3,929,648.710	
	UNILEVER PLC	125,731	37.555	4,721,827.700	
	BARCLAYS PLC	759,215	1.466	1,113,312.870	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	423,438	2.901	1,228,393.630	
	PRUDENTIAL PLC	138,455	8.760	1,212,865.800	
	NATWEST GROUP PLC	289,693	2.212	640,800.910	
	BAE SYSTEMS PLC	152,909	10.580	1,617,777.220	
	AVIVA PLC	137,814	4.301	592,738.010	
	GSK	205,976	14.192	2,923,211.390	
	INFORMA PLC	69,543	7.648	531,864.860	

MELROSE INDUSTRIES PLC	67,566	5.502	371,748.130	
AUTO TRADER GROUP PLC	45,978	6.972	320,558.610	
DCC PLC	4,696	56.800	266,732.800	
OCADO GROUP PLC	27,677	7.230	200,104.710	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,702	103.000	381,306.000	
HALMA PLC	19,019	22.610	430,019.590	
ENTAIN PLC	32,069	9.386	300,999.630	
JD SPORTS FASHION PLC	123,236	1.731	213,383.130	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	35,703	5.190	185,298.570	
M&G PLC	112,904	2.194	247,711.370	
ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	17.800	162,709.800	
RELX PLC	95,022	30.240	2,873,465.280	
DIAGEO PLC	113,061	28.335	3,203,583.430	
RIO TINTO PLC	56,607	56.980	3,225,466.860	
STANDARD CHARTERED PLC	115,154	6.426	739,979.600	
TESCO PLC	357,402	2.827	1,010,375.450	
SMITH & NEPHEW PLC	43,944	10.445	458,995.080	
GLENCORE PLC	526,595	4.608	2,426,813.050	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,956	7.206	122,184.930	
SMITHS GROUP PLC	17,414	17.315	301,523.410	
PEARSON PLC	32,119	9.382	301,340.450	
SAINSBURY (J) PLC	83,374	2.935	244,702.690	
NEXT PLC	6,020	81.540	490,870.800	
TAYLOR WIMPEY PLC	177,729	1.436	255,218.840	
WHITBREAD PLC	9,718	34.810	338,283.580	
BUNZL PLC	16,999	31.130	529,178.870	
VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.647	741,427.140	
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,927	50.600	350,506.200	
KINGFISHER PLC	95,279	2.442	232,671.310	
WPP PLC	53,989	7.506	405,241.430	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,280	10.920	374,337.600	
SEVERN TRENT PLC	13,546	26.190	354,769.740	
RENTOKIL INITIAL PLC	126,917	4.270	541,935.590	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,078	54.420	1,963,364.760	
ST JAMES'S PLACE PLC	26,055	6.776	176,548.680	
SCHRODERS PLC	39,815	4.380	174,389.700	
SSE PLC	54,922	18.730	1,028,689.060	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	48,960	5.660	277,113.600	
ASTRAZENECA PLC	77,982	101.860	7,943,246.520	

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	300,752	2.465	741,353.680	
	3I GROUP PLC	48,884	23.490	1,148,285.160	
	ASHTEAD GROUP PLC	21,946	54.320	1,192,106.720	
	SAGE GROUP PLC/THE	51,636	11.690	603,624.840	
	NATIONAL GRID PLC	185,549	10.660	1,977,952.340	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,197,079	0.470	1,503,106.690	
	IMPERIAL BRANDS PLC	42,812	18.080	774,040.960	
	CRH PLC	35,542	53.040	1,885,147.680	
	CENTRICA PLC	279,988	1.418	397,022.980	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	5,318	48.690	258,933.420	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	106,893	23.115	2,470,831.690	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	17,269	23.700	409,275.300	
	HSBC HOLDINGS PLC	979,951	6.090	5,967,901.590	
	ANGLO AMERICAN PLC	63,864	18.240	1,164,879.360	
	MONDI PLC	24,386	15.345	374,203.170	
	COMPASS GROUP PLC	86,131	20.930	1,802,721.830	
	PERSIMMON PLC	15,188	13.610	206,708.680	
	BT GROUP PLC	323,700	1.250	404,625.000	
	COCA-COLA HBC AG-DI	11,036	22.770	251,289.720	
	BURBERRY GROUP PLC	17,870	15.235	272,249.450	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,305	70.740	587,495.700	
	INTERTEK GROUP PLC	8,060	40.890	329,573.400	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,986	92.000	1,930,712.000	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,866	17.295	136,042.470	
	ADMIRAL GROUP PLC	13,179	26.550	349,902.450	
	ANTOFAGASTA PLC	19,817	16.160	320,242.720	
	ABRDN PLC	90,862	1.833	166,595.470	
	EXPERIAN PLC	46,265	31.990	1,480,017.350	
イギリス・ポンド 小計				91,242,918.120 (16,455,660,284)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,314	17.700	1,138,357.800	
	AZRIELI GROUP LTD	2,207	228.500	504,299.500	
	ICL GROUP LTD	38,890	18.490	719,076.100	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,383	758.000	1,048,314.000	
	BANK HAPOALIM BM	66,050	31.300	2,067,365.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	79,801	27.740	2,213,679.740	
	NICE LTD	3,590	732.500	2,629,675.000	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,529	132.800	1,132,651.200	
イスラエル・シュケル 小計				11,453,418.340 (442,715,850)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	100,640	4.800	483,072.000	
	TELSTRA GROUP LTD	188,947	3.920	740,672.240	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	140,460	25.540	3,587,348.400	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	124,781	3.580	446,715.980	
	BHP GROUP LTD	236,901	49.410	11,705,278.410	
	SOUTH32 LTD	205,649	3.240	666,302.760	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	88,746	30.580	2,713,852.680	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	79,085	27.850	2,202,517.250	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	146,129	30.180	4,410,173.220	
	WESTPAC BANKING CORP	163,975	22.490	3,687,797.750	
	SANTOS LTD	151,925	7.750	1,177,418.750	
	RIO TINTO LTD	17,344	132.860	2,304,323.840	
	ORIGIN ENERGY LTD	80,781	7.980	644,632.380	
	AURIZON HOLDINGS LTD	83,843	3.740	313,572.820	
	PILBARA MINERALS LTD	134,421	3.920	526,930.320	
	XERO LTD	6,482	110.490	716,196.180	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	33.100	343,842.800	
	COLES GROUP LTD	62,547	16.050	1,003,879.350	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,781	73.480	571,747.880	
	IDP EDUCATION LTD	12,369	20.150	249,235.350	
	IGO LTD	30,405	8.880	269,996.400	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	51,949	13.190	685,207.310	
	REECE LTD	10,500	21.620	227,010.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	64,915	5.090	330,417.350	
	SEEK LTD	16,268	25.120	408,652.160	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	33,876	10.610	359,424.360	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	78,326	110.070	8,621,342.820	
	AMPOL LTD	11,154	35.540	396,413.160	
	ORICA LTD	21,399	16.470	352,441.530	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	69,799	14.200	991,145.800	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	57,070	36.660	2,092,186.200	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	5.410	211,433.620	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	20,514	52.000	1,066,728.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	17,161	179.400	3,078,683.400	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,226	40.900	1,113,543.400	

	CSL LTD	22,558	278.740	6,287,816.920	
	WESFARMERS LTD	52,974	55.090	2,918,337.660	
	COCHLEAR LTD	2,968	299.770	889,717.360	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,666	22.350	461,885.100	
	SUNCORP GROUP LTD	59,284	13.710	812,783.640	
	ASX LTD	8,754	61.680	539,946.720	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	23.460	590,464.740	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	110,468	5.640	623,039.520	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,099	31.630	667,361.370	
	BRAMBLES LTD	64,938	13.190	856,532.220	
	CARSALES.COM LTD	18,700	30.440	569,228.000	
	MINERAL RESOURCES LTD	8,202	66.780	547,729.560	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,291	50.470	418,446.770	
	REA GROUP LTD	2,395	169.050	404,874.750	
オーストラリア・ドル 小計				75,288,300.200 (7,180,245,191)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	36,600	74.280	2,718,648.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	16,181	50.820	822,318.420	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	73.980	702,810.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,000	3,317.120	3,317,120.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,587	98.600	1,339,678.200	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	21,500	65.290	1,403,735.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	8,450	200.240	1,692,028.000	
	BCE INC	3,330	51.780	172,427.400	
	FRANCO-NEVADA CORP	9,100	148.630	1,352,533.000	
	SUNCOR ENERGY INC	61,430	41.380	2,541,973.400	
	METRO INC/CN	10,700	65.530	701,171.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	16,000	98.600	1,577,600.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	57,100	61.990	3,539,629.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	43,800	60.890	2,666,982.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	85,900	83.520	7,174,368.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	13,300	43.000	571,900.000	
	MEG ENERGY CORP	15,000	23.370	350,550.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	66,050	131.390	8,678,309.500	
	TOURMALINE OIL CORP	15,300	58.580	896,274.000	
	TC ENERGY CORP	48,750	52.000	2,535,000.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,029	44.320	1,153,605.280	

BARRICK GOLD CORP	83,000	23.410	1,943,030.000	
CAE INC	15,100	27.830	420,233.000	
THOMSON REUTERS CORP	7,641	185.900	1,420,461.900	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	34.270	243,317.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,600	102.860	267,436.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,950	58.730	408,173.500	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	18,500	22.150	409,775.000	
HYDRO ONE LTD	15,200	39.100	594,320.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,360	118.580	872,748.800	
STANTEC INC	5,200	101.950	530,140.000	
NORTHLAND POWER INC	12,100	24.390	295,119.000	
WSP GLOBAL INC	5,900	185.390	1,093,801.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,900	113.550	442,845.000	
PARKLAND CORP	6,600	42.810	282,546.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,800	30.490	207,332.000	
EMERA INC	13,000	49.560	644,280.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,900	158.870	619,593.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,100	31.700	193,370.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,800	60.060	1,009,008.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	87.280	139,648.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	29,000	12.860	372,940.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	23,417	72.210	1,690,941.570	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	8.670	254,031.000	
AIR CANADA	7,600	18.180	138,168.000	
KINROSS GOLD CORP	56,100	8.060	452,166.000	
BANK OF MONTREAL	34,200	123.740	4,231,908.000	
POWER CORP OF CANADA	27,300	37.990	1,037,127.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	56,900	103.030	5,862,407.000	
NUTRIEN LTD	23,419	73.530	1,721,999.070	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,300	38.460	242,298.000	
CAMECO CORP	20,500	60.140	1,232,870.000	
FIRSTSERVICE CORP	2,000	213.460	426,920.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,800	43.920	474,336.000	
TELUS CORP	10,800	23.960	258,768.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,900	55.600	1,217,640.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	141.560	339,744.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	51,500	83.450	4,297,675.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,100	1,180.690	1,298,759.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,900	75.780	977,562.000	

	WESTON (GEORGE) LTD	2,937	156.660	460,110.420	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	20.830	354,110.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,100	112.720	462,152.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,800	68.430	1,902,354.000	
	ENBRIDGE INC	101,000	47.360	4,783,360.000	
	BROOKFIELD CORP	65,825	51.500	3,389,987.500	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	85,900	28.260	2,427,534.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	44,120	101.600	4,482,592.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,700	92.120	432,964.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	46.150	383,045.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	26,350	161.010	4,242,613.500	
	CGI INC - CLASS A	9,900	142.940	1,415,106.000	
	ONEX CORPORATION	3,200	90.630	290,016.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	35.280	127,008.000	
	TMX GROUP LTD	13,200	30.880	407,616.000	
	OPEN TEXT CORP	12,900	55.000	709,500.000	
	SAPUTO INC	11,700	26.820	313,794.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	27,100	10.310	279,401.000	
	FORTIS INC	23,100	54.890	1,267,959.000	
	RB GLOBAL INC	8,700	85.290	742,023.000	
	LUNDIN MINING CORP	30,400	10.730	326,192.000	
	CENOVUS ENERGY INC	67,200	21.750	1,461,600.000	
	DOLLARAMA INC	13,400	90.000	1,206,000.000	
	ALTAGAS LTD	13,000	27.080	352,040.000	
	KEYERA CORP	10,900	31.990	348,691.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	19.170	548,262.000	
カナダ・ドル 小計				117,590,127.460 (12,498,654,647)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	135,300	3.030	409,959.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	65,700	27.820	1,827,774.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	31.060	2,925,852.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,375	6.470	500,616.250	
	KEPPEL CORP LTD	75,700	6.850	518,545.000	
	UOL GROUP LTD	25,900	6.300	163,170.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	27,600	6.760	186,576.000	
	SEATRIUM	2,306,022	0.107	246,744.350	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,800	28.750	166,750.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	176,100	12.370	2,178,357.000	

	GENTING SINGAPORE LTD	314,400	0.990	311,256.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,350	2.400	1,030,440.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	81,200	3.790	307,748.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	46,500	5.160	239,940.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	44,600	9.520	424,592.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	99,900	3.460	345,654.000	
シンガポール・ドル 小計				11,783,973.600 (1,258,057,021)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	19,540	27.950	546,143.000	
	AVOLTA AG	4,854	32.580	158,143.320	
	UBS GROUP AG-REG	157,327	25.650	4,035,437.550	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	260.000	376,220.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	326	691.500	225,429.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,458	41.940	312,788.520	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	33,581	244.350	8,205,517.350	
	SIKA AG-REG	7,289	274.200	1,998,643.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	108,200.000	541,000.000	
	ABB LTD-REG	76,442	37.770	2,887,214.340	
	SWISS RE AG	14,388	95.640	1,376,068.320	
	NESTLE SA-REG	127,771	98.110	12,535,612.810	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,052	1,211.000	1,273,972.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,893	208.000	393,744.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,836	47.420	466,423.120	
	SGS SA-REG	7,125	73.280	522,120.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,091	196.400	214,272.400	
	TEMENOS AG - REG	2,973	77.620	230,764.260	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	116.400	212,779.200	
	VAT GROUP AG	1,255	422.700	530,488.500	
	BKW AG	942	158.800	149,589.600	
	ALCON INC	23,873	66.000	1,575,618.000	
	SIG GROUP N AG	14,178	20.260	287,246.280	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,342	234.900	315,235.800	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,977	444.500	3,101,276.500	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,134	132.100	281,901.400	
	CLARIANT AG-REG	9,678	13.320	128,910.960	
	NOVARTIS AG-REG	98,001	84.790	8,309,504.790	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,413.000	224,667.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,575	69.250	109,068.750	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	24,907	121.900	3,036,163.300	

	SWISSCOM AG-REG	1,201	505.800	607,465.800	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	106.500	143,136.000	
	GEBERIT AG-REG	1,559	547.800	854,020.200	
	GIVAUDAN-REG	428	3,472.000	1,486,016.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,276	137.600	725,977.600	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,415	273.900	661,468.500	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,819	82.360	643,972.840	
	LONZA GROUP AG-REG	3,553	341.300	1,212,638.900	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	45.000	102,105.000	
	HOLCIM LTD	24,869	67.400	1,676,170.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	586.200	804,266.400	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,519	292.100	735,799.900	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,575	90.250	322,643.750	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	10,910.000	480,040.000	
スイス・フラン 小計				65,017,685.360 (10,621,939,257)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	10,255	277.100	2,841,660.500	
	VOLVO CAR CLASS B	32,514	33.030	1,073,937.420	
	ERICSSON LM-B SHS	152,246	61.620	9,381,398.520	
	VOLVO AB-B SHS	78,458	261.000	20,477,538.000	
	SKF AB-B SHARES	17,719	206.900	3,666,061.100	
	TELE2 AB-B SHS	28,333	85.100	2,411,138.300	
	GETINGE AB-B SHS	11,892	230.600	2,742,295.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	82,504	136.000	11,220,544.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,834	107.500	8,152,155.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,333	203.700	9,234,332.100	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	177.560	6,205,011.760	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	31,500	153.400	4,832,100.000	
	SKANSKA AB-B SHS	17,689	181.200	3,205,246.800	
	SANDVIK AB	55,435	221.100	12,256,678.500	
	INVESTOR AB-B SHS	89,989	231.300	20,814,455.700	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	139,653	172.000	24,020,316.000	
	VOLVO AB-A SHS	11,011	266.400	2,933,330.400	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,877	432.200	2,107,839.400	
	SECURITAS AB-B SHS	25,570	97.560	2,494,609.200	
	TELIA CO AB	122,866	25.730	3,161,342.180	
	ALFA LAVAL AB	15,043	396.100	5,958,532.300	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	81,153	146.450	11,884,856.850	

	ASSA ABLOY AB-B	52,111	286.100	14,908,957.100	
	SAAB AB-B	4,243	572.600	2,429,541.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,768	329.700	2,231,409.600	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	35,192	70.120	2,467,663.040	
	INDUTRADE AB	15,454	265.600	4,104,582.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	10,125	259.400	2,626,425.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,951	560.600	2,214,930.600	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	7,843	261.600	2,051,728.800	
	LIFCO AB-B SHS	12,120	253.300	3,069,996.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	78,793	75.000	5,909,475.000	
	BEIJER REF AB	20,012	135.200	2,705,622.400	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,669	251.900	7,977,421.100	
	BOLIDEN AB	14,220	314.100	4,466,502.000	
	EPIROC AB-A	34,263	203.200	6,962,241.600	
	EPIROC AB-B	20,302	175.600	3,565,031.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	85.140	1,651,290.300	
	EQT AB	18,489	280.300	5,182,466.700	
	EVOLUTION AB	9,528	1,188.000	11,319,264.000	
	HEXAGON AB-B SHS	107,944	121.950	13,163,770.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,028	330.200	2,981,045.600	
スウェーデン・クローナ 小計				273,064,744.270 (3,779,216,060)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	170,516	663.800	113,188,520.800	
	DANSKE BANK A/S	36,861	179.700	6,623,921.700	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	11,730.000	1,794,690.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	54,505	193.720	10,558,708.600	
	CARLSBERG AS-B	8,120	833.000	6,763,960.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,634	356.400	3,789,957.600	
	COLOPLAST-B	7,177	786.600	5,645,428.200	
	DSV PANALPINA A/S	9,678	1,122.000	10,858,716.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,971.000	839,646.000	
	DEMANT A/S	5,239	302.300	1,583,749.700	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	252	11,820.000	2,978,640.000	
	TRYG A/S	17,729	151.300	2,682,397.700	
	PANDORA A/S	4,341	918.400	3,986,774.400	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,684	543.200	3,087,548.800	
	GENMAB A/S	3,433	2,097.000	7,199,001.000	
	ORSTED A/S	10,135	375.600	3,806,706.000	

デンマーク・クローネ 小計				185,388,366.500 (3,854,224,139)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	67,152	5.410	363,292.320	
	MERCURY NZ LTD	38,143	6.360	242,589.480	
	EBOS GROUP LTD	7,660	34.820	266,721.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	96,147	5.170	497,079.990	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	69,188	8.420	582,562.960	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,125	23.990	722,698.750	
ニュージーランド・ドル 小計				2,674,944.700 (236,759,355)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	49,122	210.900	10,359,829.800	
	NORSK HYDRO ASA	68,982	66.520	4,588,682.640	
	ORKLA ASA	39,050	78.140	3,051,367.000	
	TELENOR ASA	36,380	120.150	4,371,057.000	
	EQUINOR ASA	46,908	322.900	15,146,593.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,608	364.300	3,500,194.400	
	MOWI ASA	24,853	182.100	4,525,731.300	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,398	187.700	2,139,404.600	
	AKER BP ASA	17,430	294.300	5,129,649.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,573	457.400	2,091,690.200	
	SALMAR ASA	4,573	565.800	2,587,403.400	
	ADEVINTA ASA	17,944	112.100	2,011,522.400	
ノルウェー・クローネ 小計				59,503,124.940 (806,862,374)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	40,260	26.020	1,047,565.200	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	26,424	34.160	902,643.840	
	EXOR NV	4,595	93.680	430,459.600	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,538	81.000	448,578.000	
	CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	28.680	84,261.840	
	DSM FIRMENICH AG	9,074	87.700	795,789.800	
	FERROVIAL	25,140	32.840	825,597.600	
	LOTUS BAKERIES NV	21	8,350.000	175,350.000	
	SYENSQO SA	3,489	94.500	329,710.500	
	BAYER AG-REG	48,256	32.105	1,549,258.880	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,486	18.025	207,035.150	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	95,346	12.100	1,153,686.600	

COMMERZBANK AG	51,795	10.435	540,480.820	
VOLKSWAGEN AG	1,304	124.600	162,478.400	
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,057	115.960	1,166,209.720	
SIEMENS AG-REG	37,331	166.780	6,226,064.180	
E.ON SE	110,452	12.520	1,382,859.040	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,609	103.060	1,608,663.540	
GEA GROUP AG	7,218	34.970	252,413.460	
CONTINENTAL AG	5,368	76.140	408,719.520	
BASF SE	43,885	48.175	2,114,159.870	
ALLIANZ SE-REG	19,807	240.200	4,757,641.400	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	8,326	72.520	603,801.520	
RHEINMETALL AG	2,142	285.600	611,755.200	
RWE AG	31,064	41.430	1,286,981.520	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	29,429	8.137	239,463.770	
BRENNTAG SE	6,969	81.040	564,767.760	
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,700	28.090	581,463.000	
SAP SE	51,354	141.480	7,265,563.920	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,679	376.100	2,511,971.900	
ZALANDO SE	10,553	22.900	241,663.700	
HEIDELBERG MATERIALS AG	6,804	81.780	556,431.120	
COVESTRO AG	9,478	52.260	495,320.280	
RATIONAL AG	242	682.000	165,044.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	342.100	413,941.000	
TALANX AG	3,119	66.600	207,725.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	7,494	48.270	361,735.380	
DELIVERY HERO SE	8,646	30.525	263,919.150	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,894	97.280	184,248.320	
BECHTLE AG	4,026	45.700	183,988.200	
NEMETSCHEK SE	2,757	79.180	218,299.260	
SCOUT24 AG	3,600	61.740	222,264.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,818	53.300	736,499.400	
KNORR-BREMSE AG	3,413	57.860	197,476.180	
HELLOFRESH SE	7,177	14.850	106,578.450	
SIEMENS ENERGY AG	25,542	11.375	290,540.250	
BEIERSDORF AG	4,925	133.050	655,271.250	
MERCK KGAA	6,359	139.850	889,306.150	
ADIDAS AG	7,975	192.520	1,535,347.000	
PUMA SE	4,969	52.860	262,661.340	
HENKEL AG & CO KGAA	5,083	64.440	327,548.520	

DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	159,448	21.590	3,442,482.320	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	10,050	38.340	385,317.000	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	39,364	64.370	2,533,860.680	
QIAGEN N.V.	11,190	39.000	436,410.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	64,222	38.915	2,499,199.130	
HANNOVER RUECK SE	2,926	214.300	627,041.800	
DHL GROUP	48,785	46.170	2,252,403.450	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,307	177.700	1,653,853.900	
MTU AERO ENGINES AG	2,624	189.350	496,854.400	
WACKER CHEMIE AG	899	114.950	103,340.050	
SYMRISE AG	6,524	98.020	639,482.480	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,886	92.100	265,800.600	
VONOVIA SE	36,042	28.210	1,016,744.820	
LEG IMMOBILIEN SE	3,501	77.660	271,887.660	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	38,515	20.185	777,425.270	
NN GROUP NV	13,286	35.670	473,911.620	
ARCELORMITTAL	25,100	24.960	626,496.000	
HEINEKEN NV	14,149	90.560	1,281,333.440	
AEGON LTD	77,429	5.270	408,050.830	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	47,215	26.185	1,236,324.770	
AKZO NOBEL N.V.	8,341	74.540	621,738.140	
WOLTERS KLUWER	12,173	129.700	1,578,838.100	
ING GROEP NV	178,086	13.740	2,446,901.640	
KONINKLIJKE KPN NV	165,471	3.111	514,780.280	
ASML HOLDING NV	19,799	694.700	13,754,365.300	
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,575	13.615	320,973.620	
IMCD NV	2,778	154.400	428,923.200	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,808	140.850	536,356.800	
ASR NEDERLAND NV	7,811	43.560	340,247.160	
ADYEN NV	1,018	1,196.000	1,217,528.000	
PROSUS NV	71,372	30.410	2,170,422.520	
JDE PEET'S NV	4,785	24.700	118,189.500	
ASM INTERNATIONAL NV	2,301	491.600	1,131,171.600	
RANDSTAD NV	5,275	57.160	301,519.000	
HEINEKEN HOLDING NV	6,343	75.500	478,896.500	
OCI NV	4,987	20.120	100,338.440	
TOTALENERGIES SE	112,587	61.630	6,938,736.810	
MICHELIN (CGDE)	33,304	32.260	1,074,387.040	
AIR LIQUIDE SA	25,754	175.980	4,532,188.920	

KERING	3,590	417.850	1,500,081.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,720	181.140	4,840,060.800	
BOUYGUES SA	9,572	35.500	339,806.000	
BNP PARIBAS	51,623	63.090	3,256,895.070	
THALES SA	5,127	134.900	691,632.300	
DANONE	31,595	57.980	1,831,878.100	
CARREFOUR SA	28,025	16.285	456,387.120	
VIVENDI	32,866	9.600	315,513.600	
L'OREAL	11,809	446.550	5,273,308.950	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,386	66.610	1,491,131.460	
LEGRAND SA	13,008	96.900	1,260,475.200	
PERNOD RICARD SA	9,978	163.050	1,626,912.900	
EURAZEO SE	1,981	70.400	139,462.400	
SOCIETE GENERALE SA	36,228	24.425	884,868.900	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	13,545	748.400	10,137,078.000	
ACCOR SA	9,755	34.650	338,010.750	
CAPGEMINI SE	7,730	195.900	1,514,307.000	
PUBLICIS GROUPE	11,230	83.400	936,582.000	
BUREAU VERITAS SA	14,462	22.280	322,213.360	
EIFFAGE	3,675	96.720	355,446.000	
SODEXO SA	4,157	98.800	410,711.600	
IPSEN	1,706	104.700	178,618.200	
AMUNDI SA	2,888	62.250	179,778.000	
TELEPERFORMANCE	2,871	122.650	352,128.150	
EURONEXT NV	4,176	77.900	325,310.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,642	58.000	385,236.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,302	231.100	300,892.200	
SEB SA	1,182	111.300	131,556.600	
ESSILORLUXOTTICA	14,442	185.240	2,675,236.080	
DASSAULT AVIATION SA	1,008	176.600	178,012.800	
WORLDLINE SA	11,265	15.475	174,325.870	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,944	33.420	165,228.480	
AXA SA	88,616	29.170	2,584,928.720	
EDENRED	12,199	53.900	657,526.100	
RENAULT SA	9,448	39.275	371,070.200	
HERMES INTERNATIONAL	1,485	2,023.500	3,004,897.500	
STMICROELECTRONICS NV	33,541	46.815	1,570,221.910	
REMY COINTREAU	1,009	114.500	115,530.500	
DASSAULT SYSTEMES SE	32,820	44.290	1,453,597.800	

ORANGE	91,588	10.560	967,169.280	
ALSTOM	14,107	12.050	169,989.350	
SANOFI	55,973	87.700	4,908,832.100	
VINCI SA	24,919	115.580	2,880,138.020	
AIRBUS SE	29,090	139.520	4,058,636.800	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,358	29.730	991,733.340	
CREDIT AGRICOLE SA	52,233	12.932	675,477.150	
BIOMERIEUX	1,852	99.560	184,385.120	
ENGIE	89,825	16.214	1,456,422.550	
SAFRAN SA	16,724	160.160	2,678,515.840	
ARKEMA	2,829	99.580	281,711.820	
ADP	1,643	117.100	192,395.300	
GETLINK SE	17,511	17.040	298,387.440	
BOLLORE	36,041	5.530	199,306.730	
UCB SA	6,140	72.560	445,518.400	
KBC GROUP NV	12,234	58.540	716,178.360	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	72.700	318,644.100	
UMICORE	9,840	24.500	241,080.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,720	57.530	2,457,681.600	
AGEAS	7,499	39.620	297,110.380	
D'IETEREN GROUP	1,036	170.300	176,430.800	
ELIA GROUP SA/NV	1,462	114.400	167,252.800	
SOFINA	670	223.600	149,812.000	
ARGENX SE	2,824	423.900	1,197,093.600	
PRYSMIAN SPA	12,878	39.490	508,552.220	
ASSICURAZIONI GENERALI	49,778	19.095	950,510.910	
MEDIOBANCA SPA	26,230	11.125	291,808.750	
TENARIS SA	23,187	15.640	362,644.680	
UNICREDIT SPA	78,365	23.685	1,856,075.020	
TELECOM ITALIA SPA	492,474	0.268	132,377.010	
INTESA SANPAOLO	765,238	2.635	2,016,402.130	
POSTE ITALIANE SPA	24,593	10.225	251,463.420	
MONCLER SPA	10,054	55.920	562,219.680	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,912	47.880	235,186.560	
ENI SPA	116,308	14.814	1,722,986.710	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	24,606	10.010	246,306.060	
BANCO BPM SPA	63,300	4.734	299,662.200	
DIASORIN SPA	1,144	91.900	105,133.600	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,810	11.260	178,020.600	

NEXI SPA	27,866	7.484	208,549.140	
AMPLIFON SPA	6,132	31.680	194,261.760	
LEONARDO SPA	21,100	14.780	311,858.000	
ENEL SPA	400,294	6.670	2,669,960.980	
SNAM SPA	99,144	4.669	462,903.330	
TERNA SPA	69,248	7.652	529,885.690	
FINECOBANK SPA	29,993	13.765	412,853.640	
STELLANTIS NV	108,831	21.545	2,344,763.890	
FERRARI NV	6,109	327.500	2,000,697.500	
TELEFONICA SA	242,511	3.625	879,102.370	
ENDESA SA	15,667	19.525	305,898.170	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	293,558	8.284	2,431,834.470	
IBERDROLA SA	296,648	11.760	3,488,580.480	
REPSOL SA	62,800	13.345	838,066.000	
GRIFOLS SA	14,039	13.975	196,195.020	
BANCO SANTANDER SA	796,556	3.799	3,026,514.520	
AMADEUS IT GROUP SA	22,119	65.300	1,444,370.700	
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,000	27.760	166,560.000	
CAIXABANK SA	202,884	3.716	753,916.940	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,306	39.780	409,972.680	
AENA SME SA	3,615	164.050	593,040.750	
CELLNEX TELECOM SA	27,797	36.300	1,009,031.100	
ACCIONA SA	1,217	135.150	164,477.550	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	53,638	38.410	2,060,235.580	
ENAGAS SA	11,714	16.730	195,975.220	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,967	15.310	305,694.770	
UPM-KYMMENE OYJ	26,222	33.380	875,290.360	
NOKIA OYJ	266,261	3.010	801,445.610	
WARTSILA OYJ ABP	23,236	13.090	304,159.240	
STORA ENSO OYJ-R SHS	28,620	12.495	357,606.900	
ELISA OYJ	7,014	40.490	283,996.860	
SAMPO OYJ-A SHS	22,114	39.470	872,839.580	
FORTUM OYJ	22,078	13.200	291,429.600	
KESKO OYJ-B SHS	13,455	17.485	235,260.670	
KONE OYJ-B	16,631	41.960	697,836.760	
NESTE OYJ	20,734	33.010	684,429.340	
ORION OYJ-CLASS B	5,246	36.500	191,479.000	
METSO CORPORATION	31,351	9.078	284,604.370	
NORDEA BANK ABP	167,300	11.168	1,868,406.400	

	VERBUND AG	3,205	86.550	277,392.750	
	OMV AG	6,920	39.640	274,308.800	
	ERSTE GROUP BANK AG	16,916	35.920	607,622.720	
	VOESTALPINE AG	5,480	28.440	155,851.200	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,788	36.420	465,738.960	
	AIB GROUP PLC	77,631	3.702	287,389.960	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	51,916	8.294	430,591.300	
	KINGSPAN GROUP PLC	7,549	80.660	608,902.340	
	JERONIMO MARTINS	13,930	23.000	320,390.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	154,383	4.584	707,691.670	
	GALP ENERGIA SGPS SA	23,118	13.280	307,007.040	
	EDP RENOVAVEIS SA	14,554	18.050	262,699.700	
	KERRY GROUP PLC-A	7,771	74.140	576,141.940	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,675	155.300	1,347,227.500	
ユーロ 小計				239,124,978.460 (37,064,371,661)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	72,000	44.350	3,193,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	42.500	4,972,500.000	
	MTR CORP	81,000	29.800	2,413,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	75,500	83.750	6,323,125.000	
	SINO LAND CO	194,000	8.010	1,553,940.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,669	41.300	5,768,329.700	
	WHARF HOLDINGS LTD	56,000	24.100	1,349,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	61.700	1,480,800.000	
	CLP HOLDINGS LTD	85,500	63.600	5,437,800.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	75,507	23.600	1,781,965.200	
	HONG KONG & CHINA GAS	582,475	5.820	3,390,004.500	
	HANG SENG BANK LTD	39,800	89.650	3,568,070.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	87,500	11.880	1,039,500.000	
	WH GROUP LTD	433,500	5.040	2,184,840.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	63,100	259.800	16,393,380.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	10.840	1,051,480.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	8.320	723,840.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	60,800	15.540	944,832.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,669	38.500	3,952,756.500	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	36,000	43.250	1,557,000.000	
	AIA GROUP LTD	600,600	67.900	40,780,740.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	72,000	11.800	849,600.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	24.500	2,229,500.000	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,500	13.840	1,238,680.000	
	ESR CAYMAN LTD	113,800	10.000	1,138,000.000	
	SANDS CHINA LTD	126,400	21.450	2,711,280.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	71,500	88.700	6,342,050.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	192,500	20.950	4,032,875.000	
香港・ドル 小計				128,403,487.900 (2,340,795,585)	
合計				389,010,712,465 [389,010,712,465]	

(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	7,237	1,359,759.930	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	16,507	2,382,785.450	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,600	542,792.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,500	1,366,695.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,200	1,115,842.000	
		EQUINIX INC	4,808	3,864,333.840	
		AMERICAN TOWER CORP	23,500	4,985,525.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	35,843	686,393.450	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	16,400	583,020.000	
		KIMCO REALTY CORP	31,300	698,929.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	13,300	634,942.000	
		INVITATION HOMES INC	30,900	1,057,089.000	
		VICI PROPERTIES INC	51,100	1,601,474.000	
		VENTAS INC	20,300	1,001,805.000	
		WEYERHAEUSER CO	36,814	1,227,378.760	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,900	2,471,196.000	
		IRON MOUNTAIN INC	14,700	998,424.000	
		SUN COMMUNITIES INC	6,300	844,830.000	
		PROLOGIS INC	46,554	6,250,340.040	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,300	1,080,162.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,400	534,330.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,300	808,335.000	
		WELLTOWER INC	26,200	2,378,698.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	27,600	539,580.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,900	793,668.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,000	647,100.000	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	24,900	496,755.000	
	REALTY INCOME CORP	35,795	2,050,695.550	
	PUBLIC STORAGE	8,000	2,320,480.000	
	REGENCY CENTERS CORP	8,400	562,044.000	
	UDR INC	15,800	594,712.000	
	WP CAREY INC	10,800	699,408.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	2,022,201.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,700	1,644,911.000	
アメリカ・ドル 小計			50,846,634.020 (7,230,391,358)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,582	253,557.330	
	SEGRO PLC	58,682	510,181.300	
イギリス・ポンド 小計			763,738.630 (137,740,262)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	48,731	375,228.700	
	TRANSURBAN GROUP	144,348	1,986,228.480	
	APA GROUP	60,450	535,587.000	
	SCENTRE GROUP	235,284	696,440.640	
	GPT GROUP	86,791	401,842.330	
	MIRVAC GROUP	184,980	388,458.000	
	STOCKLAND	111,877	504,565.270	
	GOODMAN GROUP	79,896	1,927,091.520	
	VICINITY CENTRES	175,417	363,113.190	
オーストラリア・ドル 小計			7,178,555.130 (684,618,803)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,800	191,786.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,900	127,098.000	
カナダ・ドル 小計			318,884.000 (33,894,180)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	194,000	576,180.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	276,670	556,106.700	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	181,500	308,550.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	132,700	201,704.000	

	シンガポール・ドル 小計			1,642,540.700 (175,357,645)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,554	369,341.000	
		GECINA SA	2,164	237,174.400	
		KLEPIERRE	10,126	247,074.400	
		COVIVIO	2,399	115,631.800	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	8,089	226,492.000	
	ユーロ 小計			1,195,713.600 (185,335,608)	
	香港・ドル	LINK REIT	131,500	5,523,000.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000	1,836,040.000	
	香港・ドル 小計			7,359,040.000 (134,155,300)	
投資証券 合計				8,581,493,156 [8,581,493,156]	
合計				8,581,493,156 [8,581,493,156]	

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 588銘柄 投資証券 34銘柄	97.6%	2.4%	75.1%
イギリス・ポンド	株式 80銘柄 投資証券 2銘柄	99.2%	0.8%	4.2%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄 投資証券 9銘柄	91.3%	8.7%	2.0%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄 株式 86銘柄	99.7%	0.3%	3.2%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 4銘柄	87.8%	12.2%	0.4%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	2.7%

スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	100%	-%	1.0%
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 投資証券	221銘柄 5銘柄	99.5%	0.5%	9.4%
香港・ドル	投資証券 株式	2銘柄 28銘柄	94.6%	5.4%	0.6%

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12月19日現在 金　額（円）	2023年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,226,900,795	3,170,100,784
コール・ローン	1,310,485,939	1,716,112,297
国債証券	236,458,977,725	274,040,930,032
派生商品評価勘定	2,654,404	251,140
未収入金	193,503	-
未収利息	1,461,653,232	1,877,679,010
前払費用	64,484,887	93,256,788
流動資産合計	240,525,350,485	280,898,330,051
資産合計	240,525,350,485	280,898,330,051
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,219,744	45,266,097
未払金	390,580,231	220,125
未払解約金	37,084,509	57,540,544
流動負債合計	442,884,484	103,026,766

負債合計		442,884,484	103,026,766
純資産の部			
元本等			
元本	※1	76,482,606,084	82,652,055,717
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		163,599,859,917	198,143,247,568
元本等合計		240,082,466,001	280,795,303,285
純資産合計		240,082,466,001	280,795,303,285
負債純資産合計		240,525,350,485	280,898,330,051

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12月20日 至2023年12月18日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
1. ※1 期首	2021年12月21日	2022年12月20日
期首元本額	74,672,925,593円	76,482,606,084円
期中追加設定元本額	9,112,372,426円	11,616,498,414円
期中一部解約元本額	7,302,691,935円	5,447,048,781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	444,538,723円	378,265,789円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,071,985円	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)	50,091,127円	39,693,753円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	19,793,735円	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)	244,218,374円	202,530,565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）	357,104,321円	575,818,396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）	597,663,829円	800,186,267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）	2,724,660,501円	3,784,307,962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）	613,268,261円	844,233,964円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,270,054円	2,560,063円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	13,099,307円	19,940,223円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,023,525,041円	2,147,340,748円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,882,858,890円	2,287,197,948円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	349,171,161円	501,734,675円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	297,564円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,572,540,564円	51,328,969,323円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,069,355,051円	1,157,832,760円
ダイワ・ライフ・バランス５０	684,799,685円	818,375,038円
ダイワ・ライフ・バランス７０	453,688,230円	625,354,205円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	642,739,139円	696,882,920円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	505,372,368円	550,480,847円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	193,737,548円	219,646,890円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	32,191,219円	37,370,856円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	14,065,842円	18,942,184円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,391,446,743円	1,961,861,578円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,873,500円	4,614,349円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,503,887円	1,938,861円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,563,794円	3,291,159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）	185,919,347円	1,152,992,870円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	119,575,140円	94,521,436円

	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	37,971,006円	26,095,640円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,276,156,835円	2,806,836,890円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	199,538,920円	174,580,938円
	スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	19,262円
	スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	48,912円
	スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	50,401円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	9,170円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	17,475円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	8,872円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	8,872円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	19,559円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	13,635円
	ダイワ・インデックスセレクト外国債券	150,870,402円	156,788,408円
	ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	49,160,892円	67,315,692円
	ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	1,744,667,921円	3,217,888,980円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,718,090,934円	5,820,063,374円
	ダイワライフスタイル２５	28,515,260円	26,705,094円
	ダイワライフスタイル５０	58,847,063円	59,474,710円
	ダイワライフスタイル７５	15,079,485円	16,603,675円
計		76,482,606,084円	82,652,055,717円
2.	期末日における受益権の総数	76,482,606,084口	82,652,055,717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12月20日 至2023年12月18日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月18日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月19日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	196,650,391	6,832,474,204
合計	196,650,391	6,832,474,204

（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12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,538,661,456	-	1,526,096,116	△12,565,340	1,730,758,000	-	1,685,743,043	△45,014,957
アメリカ・ドル	521,851,632	-	517,168,624	△4,683,008	315,181,225	-	312,748,847	△2,432,378
イギリス・ポンド	40,192,377	-	39,771,407	△420,970	21,051,745	-	20,843,146	△208,599
オーストラリア・ドル	15,676,295	-	15,514,421	△161,874	-	-	-	-
オフショア・人民元	95,757,698	-	94,927,509	△830,189	1,046,331,594	-	1,008,761,922	△37,569,672
カナダ・ドル	105,772,518	-	102,875,476	△2,897,042	10,070,572	-	10,167,513	96,941
シンガポール・ドル	55,212,696	-	54,592,813	△619,883	19,520,002	-	18,838,729	△681,273
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	25,779,248	-	25,037,809	△741,439
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	27,875,525	-	26,970,398	△905,127
メキシコ・ペソ	67,791,720	-	65,102,918	△2,688,802	46,764,863	-	45,544,678	△1,220,185
ユーロ	636,406,520	-	636,142,948	△263,572	218,183,226	-	216,830,001	△1,353,225

合計	1,538,661,456	-	1,526,096,116	△12,565,340	1,730,758,000	-	1,685,743,043	△45,014,957

（注）　1．　時価の算定方法

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

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12月19日現在	2023年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.1390円	3.3973円
（1万口当たり純資産額）	(31,390円)	(33,973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	883,787.850	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	762,472.780	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	780,405.480	

		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	806,398.740	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,615,801.820	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,251,428.640	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	944,735.330	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	574,090.280	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	549,641.760	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	988,923.770	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,149,809.700	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,116,911.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,255,108.800	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,077,457.900	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,735,018.440	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,059,644.660	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,491,607.910	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,350,783.720	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,404,721.500	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,440,694.900	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,258,469.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,404,576.660	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,144,435.050	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,242,079.450	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,317,496.400	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,246,490.480	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,887,186.540	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,954,983.740	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,946,775.500	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,033,775.660	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,935,877.880	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,635,001.110	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,275,637.660	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,558,764.560	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,944,061.130	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,586,172.440	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,516,627.500	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,510,121.350	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,512,690.990	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,605,816.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	543,029.180	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,593,795.960	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,365,722.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,266,419.350	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,117,250.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,034,636.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,981,000.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,990,798.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	802,420.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,443,403.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,922,008.900	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,058,368.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,638,040.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,545,410.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,914,185.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,152,235.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,952,875.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,115,616.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,726,416.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,047,740.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,534,636.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,636,280.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,453,310.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,823,179.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,177,788.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,208,215.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,853,678.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,461,427.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,918,250.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,389,053.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,631,190.800	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,434,275.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,494,808.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,436,025.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,434,850.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,562,693.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,642,077.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,913,630.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,448,775.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,189,678.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,412,575.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,840,276.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,404,275.000	

		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,389,725.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,712,095.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,602,547.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,681,532.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,853,900.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,645,104.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,356,275.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,164,247.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,227,636.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,600,696.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,335,250.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,796,210.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,533,764.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,243,915.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,861,480.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,904,030.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,333,375.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,421,300.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,636,607.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,339,450.000	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,009,705.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,574,098.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	273,708.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,980,508.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,367,625.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,431,616.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,533,228.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,546,208.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,133,360.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,036,992.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,205,650.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,103,345.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,815,050.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	6,082,310.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,094,070.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,171,826.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,461,520.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,388,150.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,756,556.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,177,300.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,078,600.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,710,520.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,493,320.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,255,315.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,019,830.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,700,120.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,501,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,076,260.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,368,754.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,716,174.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,388,750.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,378,100.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,613,750.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,145,090.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,766,855.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,893,305.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,599,000.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,452,600.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,368,537.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,760,690.000	

		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,572,160.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,695,920.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,436,064.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,145,940.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,348,040.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,597,120.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,888,418.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,337,180.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,044,612.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,439,450.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,604,850.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,495,440.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,537,509.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,956,769.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,472,840.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,379,100.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,396,050.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,565,000.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,413,850.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,201,590.000	

		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,277,900.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,204,728.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,888,560.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,319,120.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,433,000.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,682,000.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,986,464.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,117,412.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,532,880.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,678,320.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	961,460.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,917,168.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,561,953.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,864,926.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,724,267.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,915,525.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,515,000.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,669,500.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,818,900.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,775,270.000	

		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,761,900.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,919,120.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,597,385.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,920,770.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,008,850.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,314,720.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,843,880.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,876,460.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,646,540.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,907,960.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,897,800.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,860,120.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,922,510.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,927,040.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,894,135.300	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,397,490.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,677,015.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,279,288.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,781,740.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,136,056.000	

		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,422,000.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,351,635.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,260,233.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,488,375.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,512,915.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,385,312.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,010,590.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,837,449.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,501,245.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,672,509.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,005,490.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,986,770.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,488,475.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,984,880.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,430,450.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,471,545.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,484,760.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,976,950.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,493,160.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,981,160.000	

		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	992,670.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,875,750.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,474,275.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,738,080.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,384,700.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	4,180,230.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,629,959.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,490,820.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	1,002,300.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,000,810.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,515,425.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,966,820.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,766,880.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,647,719.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,976,120.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,923,650.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,962,060.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	985,580.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,467,252.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	4,400,000.000	4,093,364.000	

		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,384,175.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,954,520.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,578,256.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,649,902.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,482,645.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,991,600.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,499,600.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,964,990.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,506,125.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	2,000,000.000	2,013,580.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	4,009,520.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,525,410.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	7,000,000.000	6,973,750.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,024,480.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	3,500,000.000	3,558,765.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,300,000.000	1,327,105.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	3,008,370.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,927,690.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,131,093.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,055,170.000	

		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,033,840.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	1,008,000.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,560,225.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,323,522.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,012,030.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	1,000,000.000	1,009,020.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	2,000,000.000	2,082,020.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	3,500,000.000	3,667,055.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,848,374.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	1,300,000.000	1,397,292.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,272,422.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,800,000.000	3,157,420.000	
	アメリカ・ドル 小計			919,038,697.970 (130,687,302,851)	
	イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	887,365.080	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	887,733.720	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,380,059.300	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,058,323.200	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,110,729.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,043,465.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,294,309.500	

		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,369,995.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	532,781.600	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	758,549.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	480,505.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,289,100.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,801,295.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	763,623.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,049,750.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	566,780.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,384,140.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,386,512.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	480,392.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,188,810.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,944,025.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	1,058,000.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,174,395.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	948,600.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,048,476.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,409,520.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,308,230.000	

		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,773,553.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	716,170.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,934,000.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	335,929.400	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,008,800.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	970,900.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,100,000.000	2,027,424.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	394,500.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,278,500.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	800,000.000	784,960.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	700,000.000	721,798.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,070,470.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,000,000.000	1,076,200.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,049,413.690	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,341,494.400	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,480,096.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,410,936.660	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,466,387.770	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,734,952.240	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,378,157.400	

	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,256,208.800	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,213,970.800	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,713,216.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,356,094.250	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,476,713.040	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,655,503.200	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,152,104.900	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,606,016.800	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,443,872.160	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,632,171.540	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,234,787.400	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,378,244.640	
イギリス・ポンド 小計			78,679,009.490 (14,189,759,362)	
イスラエル・シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,929,708.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,818,144.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,226,722.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,711,998.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,168,784.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,128,720.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,038,896.000	

		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,530,032.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,242,428.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	186,914.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	246,585.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	435,246.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	3,021,270.000	
イスラエル・シュケル 小計				19,685,447.000 (760,913,395)	
	オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,048,908.680	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,314,855.860	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,779,966.060	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,323,707.800	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,764,920.640	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,055,613.720	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,136,318.870	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	694,132.560	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,609,433.760	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,104,280.760	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	982,031.240	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,428,540.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,785,943.000	

		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,639,022.400	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,109,372.900	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,380,459.600	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,159,298.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,638,400.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	797,160.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,493,488.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,987,600.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,097,796.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,320,096.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,180,543.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,159,644.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,035,573.000	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	941,076.000	
オーストラリア・ドル 小計				39,968,181.850 (3,811,765,503)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,303,480.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,190,300.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,212,550.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,118,900.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,267,480.000	

		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,271,200.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,175,240.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,548,875.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,232,560.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,311,490.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,082,375.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,107,730.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,409,089.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,160,230.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,979,180.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,256,462.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,532,355.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,040,900.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,773,955.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,299,200.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,393,040.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,745,520.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,358,060.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,274,925.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,259,380.000	

		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,899,520.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,606,260.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,692,895.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,110,040.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,973,140.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,255,512.000	
		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,984,500.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,197,100.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,853,595.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,043,050.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,039,440.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	4,009,920.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,904,750.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,875,840.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,525,745.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,183,660.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,406,700.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,570,345.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	17,955,540.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,223,060.000	

		2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	4,996,300.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,126,600.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,017,100.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,303,900.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	22,993,560.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,163,650.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,175,500.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	24,184,500.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	6,988,170.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	40,062,800.000	
		2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	8,951,580.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	33,037,290.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	34,881,350.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	39,653,600.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	29,837,100.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	24,997,500.000	
		2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	29,940,600.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,007,800.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	11,000,000.000	11,240,460.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,073,200.000	

	2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,010,800.000	
	2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	10,000,000.000	10,049,900.000	
オフショア・人民元 小計			990,308,348.000 (19,750,907,754)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	585,972.750	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,109,590.740	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,354,652.920	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,218,994.480	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,035,268.960	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,042,435.140	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,293,052.810	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,126,059.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	920,782.560	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,147,000.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	617,974.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,051,029.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,166,442.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,068,119.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	675,451.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,726,454.900	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,670,840.000	

		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,947,330.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	280,305.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,032,392.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	2,036,657.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,055,262.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,859,676.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	193,064.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,374,450.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,325.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	391,336.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	983,140.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,158,951.600	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	201,556.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	297,735.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	590,106.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	582,102.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	298,155.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	385,348.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,200,492.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	495,290.000	

	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,011,600.000	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,019,800.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	300,000.000	311,400.000	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,027,820.000	
カナダ・ドル 小計			49,639,414.760 (5,276,173,395)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	785,741.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	814,663.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	394,460.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	598,035.840	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	629,062.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	516,595.880	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	670,112.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	439,650.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	709,500.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	547,635.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	331,786.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	437,400.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	712,455.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	553,800.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	406,860.000	

	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	190,540.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	237,480.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	646,350.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,430.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	403,016.000	
シンガポール・ドル 小計			10,125,572.820 (1,081,006,154)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,244,953.550	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,546,847.700	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,908,452.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,764,523.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,338,016.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,945,344.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,351,400.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,946,440.000	
スウェーデン・クローナ 小計			39,045,977.150 (540,396,324)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,511,268.500	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,922,203.700	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,787,115.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,730,407.200	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,010,190.000	

	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	422,800.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,999,660.000	
デンマーク・クローネ 小計			36,383,644.400 (756,415,967)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	600,384.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,379,280.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	393,376.900	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	559,896.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	430,264.600	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	223,366.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	917,697.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	453,870.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	362,586.400	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	261,303.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	621,696.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	194,094.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	500,945.000	
ニュージーランド・ドル 小計			6,898,759.600 (610,609,211)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,260,502.650	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,159,456.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,244,677.000	

	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,336,445.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,567,410.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,289,952.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,045,770.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,566,975.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,722,495.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,473,135.000	
ノルウェー・クローネ 小計			34,666,817.650 (470,082,048)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,136,615.160	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,943,598.600	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,380,103.200	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,891,300.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,400,630.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,942,182.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,415,376.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	484,720.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,552,650.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,378,050.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,149,760.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	863,586.480	

	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,371,541.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,470,669.890	
ポーランド・ズロチ 小計			37,380,782.830 (1,336,407,843)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,362,368.960	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,228,159.240	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,542,326.940	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,327,131.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	736,628.700	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,419,351.280	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,888,998.740	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,417,468.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,749,593.250	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,245,766.400	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	991,910.100	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,563,624.500	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,200,507.700	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,094,885.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,207,248.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,287,696.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,201,700.000	

		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,747.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,323,051.500	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,311,816.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,283,477.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,669,535.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,585,340.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,653,102.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,364,258.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,050,024.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	517,405.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	725,900.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	998,120.000	
	マレーシア・リンギット 小計			42,604,139.310 (1,297,496,281)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,467,147.000	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,980,217.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,280,190.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	945,750.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	12,390,560.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,020,400.000	
		7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,821,590.000	
		8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,638,500.000	
		8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,754,700.000	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,770,702.200	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,517,859.200	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,532,450.800	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,923,871.440	

	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,986,521.180	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	41,417,646.300	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	26,025,536.560	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,240,797.120	
メキシコ・ペソ 小計			280,714,438.800 (2,317,550,335)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	323,366.680	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	270,655.110	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	774,683.420	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	275,644.800	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	747,896.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	407,781.400	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	458,545.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	450,560.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	226,535.600	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	265,108.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	425,860.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	199,872.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	501,906.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	187,044.000	
	0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	295,834.500	

		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	737,128.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	261,411.300	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	397,388.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	311,208.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,025,410.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,338,647.540	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,074,530.540	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	607,364.800	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	153,436.800	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,203,686.400	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	430,277.400	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,123,728.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,164,134.400	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	845,299.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	737,580.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	251,528.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	168,500.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,006,212.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	462,398.400	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,792.000	

		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	146,322.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	267,810.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,321,755.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	247,122.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	296,742.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	308,109.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	316,881.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,028,610.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	848,216.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,649,610.070	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,599,101.340	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	936,721.460	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,412,307.050	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	943,225.680	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	596,536.200	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,043,702.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	482,821.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	507,990.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,396,353.500	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	581,353.500	

		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,391,880.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	526,897.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,054,604.600	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	575,580.800	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,099,188.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,320,960.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	245,172.700	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,168,636.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	542,888.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	392,032.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,550,025.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	618,690.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	742,343.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,339,937.730	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,460,485.720	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,063,078.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,426,029.480	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,752,910.960	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,887,450.450	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,945,512.910	

		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,672,627.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,335,824.800	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,265,954.600	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,917,006.560	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,798,831.670	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,133,248.140	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,078,131.880	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,004,572.720	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,282,955.400	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,963,246.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,122,163.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,842,624.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,788,071.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,792,172.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,314,412.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,692,710.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,604,550.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,556,852.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,654,359.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,848,720.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,586,124.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,058,520.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	785,250.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,074,556.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,818,700.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	622,622.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,109,716.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	604,884.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,245,656.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,363,504.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,642,301.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,700,000.000	1,547,051.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,224,256.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,600,000.000	1,640,784.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,744,404.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	912,000.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	900,000.000	945,333.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,541,580.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,132,530.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,486,305.000	

		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,492,230.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	1,000,040.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	100,800.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	303,423.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,313,528.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,198,616.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	95,815.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,086,854.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,633,428.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	93,339.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,919,930.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	419,430.600	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	100,695.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,803.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,206,802.500	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,845,043.300	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,059,049.680	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,205,876.530	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,104,293.240	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,720,888.880	

4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,868,179.840	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	2,077,226.600	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,728,727.740	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,988,605.810	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,239,312.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,140,057.410	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,378,824.280	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,948,480.100	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,822,016.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,185,987.660	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,530,726.100	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,007,156.180	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,806,635.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,239,369.500	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,250,638.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,125,119.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,049,864.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,472,168.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,596,966.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,087,625.000	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,862,187.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,171,651.900	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,667,860.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,604,328.600	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,841,960.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,526,030.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,256,150.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	634,772.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	944,205.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,810,824.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,878,040.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,476,956.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,940,588.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	2,027,445.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	2,200,000.000	1,794,936.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,034,862.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,622,352.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	934,310.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	2,082,864.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	2,200,000.000	2,203,234.000	

		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	2,200,000.000	2,289,958.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	1,600,000.000	1,632,464.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	700,000.000	757,736.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,281,853.380	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,052,542.700	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,044,646.240	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,492,603.680	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,031,564.930	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,724,983.740	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,849,452.780	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,089,428.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,265,382.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,079,172.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	667,908.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,213,562.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	746,536.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	648,112.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,100,424.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	636,966.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	805,851.000	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	94,969.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	518,136.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	900,000.000	817,263.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	913,248.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,320,514.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	671,022.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,240,991.100	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,697,984.640	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,799,669.400	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,315,682.010	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,429,823.870	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,801,216.900	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,837,661.050	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,276,810.500	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,311,986.280	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,948,023.280	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,018,412.760	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	715,613.360	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,359,600.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,474,409.300	

		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,483,696.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,618,163.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,152,476.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,020,389.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,270,555.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,519,349.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,536,530.500	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,218,565.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	650,000.000	618,735.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,875,843.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,057,748.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,109,175.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,695,066.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,258,777.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,208,060.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,140,955.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,151,415.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,471,695.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,721,200.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,880,151.000	

		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,045,450.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,614,014.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,084,710.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,600,066.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	743,604.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	489,888.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,693,831.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,464,948.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,400,432.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,028,687.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	284,206.400	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	714,096.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,574,492.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,873,545.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,388,118.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	786,096.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	290,580.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	538,048.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	282,993.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	485,025.000	

		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	784,616.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,474,320.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,115,057.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	197,570.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	510,215.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,334,782.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,980,824.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	309,681.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,521,750.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	103,758.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	520,145.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	400,716.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	509,455.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	935,334.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,226,496.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,221,632.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	721,315.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	409,352.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	302,700.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	400,000.000	417,132.000	

		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,558,650.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	626,532.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,611,907.460	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,344,099.220	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,106,525.250	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,551,997.940	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,775,291.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,261,461.160	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,160,571.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,487,868.310	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,136,633.300	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,585,327.500	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,960,995.190	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,352,468.660	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,926,517.560	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,321,337.760	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,883,096.000	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,044,593.550	

4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	867,219.600	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	714,951.700	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	769,492.170	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,061,981.550	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	969,456.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	809,011.070	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,037,666.110	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	492,481.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	756,048.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	682,605.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	704,145.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	895,014.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	456,906.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	278,099.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	466,800.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	695,400.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	670,120.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	281,416.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	84,358.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	208,694.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	933,025.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,578,840.160	

		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	917,997.500	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	409,321.380	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	758,239.020	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	756,119.700	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	679,279.470	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	396,348.210	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	396,694.760	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,077,964.240	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,006,901.650	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,958,162.040	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,168,633.280	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,685,937.740	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,768,160.640	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,460,797.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,534,110.200	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,832,265.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,662,255.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,964,289.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,282,592.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,899,150.000	

		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,750,853.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,506,816.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,974,217.500	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,490,068.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,235,366.400	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,415,175.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	794,584.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,251,584.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,178,432.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	932,867.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	472,030.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,813,152.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	330,460.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,249,250.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,398,077.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,593,815.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	401,112.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	829,746.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,768,221.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,115,776.000	

		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	95,833.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	994,158.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,654,933.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	992,660.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,524,150.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,304,393.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	848,232.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,569,765.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	625,296.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,658,750.430	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,939,187.320	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,204,294.040	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,309,061.090	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,865,390.710	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,121,099.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,973,957.100	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,619,476.290	
	ユーロ 小計			588,091,249.090 (91,154,143,609)	
国債証券 合計				274,040,930,032 [274,040,930,032]	
合計				274,040,930,032 [274,040,930,032]	

（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	275銘柄	100%	47.6%
イギリス・ポンド	国債証券	59銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	100%	1.4%
オフショア・人民元	国債証券	67銘柄	100%	7.2%
カナダ・ドル	国債証券	41銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券	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	10銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	372銘柄	100%	33.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月19日現在 金　額（円）	2023年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		

流動資産			
コール・ローン		9,223,851,917	3,490,491,252
投資証券	※2	479,641,458,200	396,524,083,100
派生商品評価勘定		48,944,000	-
未収入金		213,366,356	3,845,463,875
未収配当金		2,161,912,970	2,183,738,409
前払金		-	28,280,000
差入委託証拠金		-	522,937,908
流動資産合計		491,289,533,443	406,594,994,544
資産合計		491,289,533,443	406,594,994,544
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	115,696,000
前受金		253,960,000	-
未払金		233,215,145	-
未払解約金		428,260,000	55,330,000
流動負債合計		915,435,145	171,026,000
負債合計		915,435,145	171,026,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	147,074,195,757	126,407,264,091
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		343,299,902,541	280,016,704,453
元本等合計		490,374,098,298	406,423,968,544
純資産合計		490,374,098,298	406,423,968,544
負債純資産合計		491,289,533,443	406,594,994,544

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12月20日 至2023年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
1．　※1 期首	2021年12月21日	2022年12月20日
期首元本額	133,202,288,962円	147,074,195,757円
期中追加設定元本額	36,700,219,266円	15,840,714,197円
期中一部解約元本額	22,828,312,471円	36,507,645,863円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	4,480,203,081円	4,182,047,912円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	130,146,228,171円	108,317,971,329円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	367,869,269円	435,013,976円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	14,451,855円	20,894,901円
ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	622,837,560円	676,381,336円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	1,777,811,911円	2,387,649,719円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	-円	2,514,869円

	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	50,619円
	ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,512,669,093円	5,432,509,358円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	6,605,564円	8,504,119円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	6,178,591円	8,667,097円
	ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	931,559円	3,390,101円
	ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド	96,504,584円	98,969,094円
	ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	2,251,400,882円	2,960,929,609円
	ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	366,001,320円	531,516,611円
	ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	498,776,889円	483,088,653円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	12,261円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	26,062円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	19,007円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	10,721円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	23,012円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	7,948円
	ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ	925,725,428円	857,065,777円
計		147,074,195,757円	126,407,264,091円
2.	期末日における受益権の総数	147,074,195,757口	126,407,264,091口
3.	※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　5,134,300,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,652,550,000円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年12月20日 至2023年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△17,040,737,891	△17,958,716,272
合計	△17,040,737,891	△17,958,716,272

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2022年12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	10,682,840,000	-	10,732,400,000	49,560,000	10,018,680,000	-	9,903,600,000	△115,080,000
合計	10,682,840,000	-	10,732,400,000	49,560,000	10,018,680,000	-	9,903,600,000	△115,080,000

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
１口当たり純資産額	3.3342円	3.2152円

（1万口当たり純資産額）	(33,342円)	(32,152円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	7,882	901,700,800	
	サンケイリアルエステート	12,421	1,127,826,800	
	SOSILA物流リート投	19,346	2,311,847,000	
	東海道リート投資法	5,770	716,057,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	13,388	8,072,964,000	
	森ヒルズリート	45,595	6,337,705,000	
	産業ファンド	59,161	8,022,231,600	
	アドバンス・レジデンス	38,042	11,907,146,000	
	ＡＰＩ投資法人	20,342	7,892,696,000	
	ＧＬＰ投資法人	130,975	18,074,550,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	19,066	6,148,785,000	
	日本プロロジスリート	67,546	17,879,426,200	
	星野リゾート・リート	7,153	4,291,800,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	6,763	1,765,819,300	
	イオンリート投資	47,562	6,606,361,800	
	ヒューリックリート投資法	36,277	5,390,762,200	
	日本リート投資法人	12,594	4,288,257,000	
	積水ハウス・リート投資	116,513	9,437,553,000	
	トーセイ・リート投資法人	8,165	1,090,844,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	9,560	1,334,576,000	
	サムティ・レジデンシャル	10,565	1,154,754,500	
	野村不動産マスターＦ	125,387	20,688,855,000	※
	いちごホテルリート投資	6,423	698,822,400	
	ラサールロジポート投資	49,564	7,503,989,600	
	スターアジア不動産投	59,757	3,430,051,800	
	マリモ地方創生リート	5,976	749,390,400	
	三井不ロジパーク	16,127	7,265,213,500	

	大江戸温泉リート	5,929	426,295,100	
	投資法人みらい	53,210	2,274,727,500	
	三菱地所物流REIT	13,389	4,967,319,000	
	CREロジスティクスファンド	16,692	2,620,644,000	
	ザイマックス・リート	6,289	737,699,700	
	タカラレーベン不動産投	18,384	1,829,208,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	16,990	2,164,526,000	
	日本ビルファンド	45,233	27,727,829,000	※
	ジャパンリアルエステイト	39,828	22,861,272,000	
	日本都市ファンド投資法人	185,854	18,622,570,800	
	オリックス不動産投資	77,257	12,855,564,800	
	日本プライムリアルティ	26,517	9,652,188,000	
	NTT都市開発リート投資法人	39,311	4,894,219,500	
	東急リアル・エステート	25,996	4,419,320,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	28,631	3,132,231,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	86,735	12,359,737,500	
	森トラストリート投資法人	74,738	5,396,083,600	
	インヴィンシブル投資法人	187,734	10,700,838,000	
	フロンティア不動産投資	14,386	6,229,138,000	
	平和不動産リート	28,970	3,887,774,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	24,837	6,946,908,900	
	福岡リート投資法人	20,053	3,330,803,300	
	KDX不動産投資法人	111,583	17,496,214,400	
	いちごオフィスリート投資法人	31,771	2,656,055,600	
	大和証券オフィス投資法人	8,032	5,357,344,000	
	阪急阪神リート投資法人	18,487	2,554,903,400	
	スターツプロシード投資法人	6,721	1,336,806,900	
	大和ハウスリート投資法人	58,447	14,974,121,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	129,797	8,657,459,900	
	大和証券リビング投資法人	57,098	6,040,968,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	33,697	4,323,325,100	
投資証券　合計			396,524,083,100	
合計			396,524,083,100	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターＦ　5,000口

日本ビルファンド　　1,350口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2022年12月19日現在 金　額（円）	2023年12月18日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		127,175,029	530,744,114
コール・ローン		420,501,713	201,790,101
株式		6,907,662	-
投資信託受益証券		1,361,968,562	1,190,063,836
投資証券		25,349,124,046	34,096,995,311
派生商品評価勘定		1,041,012	53,139,370
未収入金		72,539,746	162,779,094
未収配当金		80,146,993	120,067,844
差入委託証拠金		193,896,290	286,867,758
流動資産合計		27,613,301,053	36,642,447,428
資産合計		27,613,301,053	36,642,447,428
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		27,041,488	6,624,652
未払金		98,336,823	251,754,199
未払解約金		17,352,000	16,411,000
流動負債合計		142,730,311	274,789,851
負債合計		142,730,311	274,789,851
純資産の部			
元本等			
元本	※1	9,133,427,619	10,445,718,817

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,337,143,123	25,921,938,760
元本等合計	27,470,570,742	36,367,657,577
純資産合計	27,470,570,742	36,367,657,577
負債純資産合計	27,613,301,053	36,642,447,428

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12月20日 至2023年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
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12月19日現在	2023年12月18日現在
1. ※1 期首	2021年12月21日	2022年12月20日
期首元本額	15,690,434,259円	9,133,427,619円
期中追加設定元本額	2,653,731,706円	2,187,181,975円
期中一部解約元本額	9,210,738,346円	874,890,777円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	-円	92,408,770円

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	1,258,414,610円	1,721,650,522円
ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	256,019,682円	271,581,866円
Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,857,810円	1,522,467円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	13,283,048円	17,406,934円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	754,901,479円	708,540,551円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,906,089,257円	2,396,093,659円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	334,906,115円	369,788,330円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	183,911,672円	254,293,639円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	556,964円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	3,935,780,669円	4,036,311,343円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,070,511円	8,311,324円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	6,626,997円	8,548,978円
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	835,597円	3,261,395円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	148,041,885円	143,999,267円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	9,610円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	20,459円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	22,574円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	8,401円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	18,041円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	9,006円

	ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ	250,341,989円	239,359,246円
	ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	71,408,491円	66,749,561円
	ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	3,937,807円	13,065,384円
	ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	92,180,526円
	計	9,133,427,619円	10,445,718,817円
2.	期末日における受益権の総数	9,133,427,619口	10,445,718,817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12月20日 至2023年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月18日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月19日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年12月18日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△36,787	-
投資信託受益証券	△32,198,689	85,687,359
投資証券	△622,040,103	2,838,757,054
合計	△654,275,579	2,924,444,413

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．不動産投信関連

種類	2022年12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引 不動産投信指数先物取引 買建	790,150,708	-	764,752,654	△25,398,054	1,029,127,460	-	1,082,266,830	53,139,370
合計	790,150,708	-	764,752,654	△25,398,054	1,029,127,460	-	1,082,266,830	53,139,370

（注）　1．時価の算定方法

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2022年12月19日現在				2023年12月18日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	406,481,533	-	405,879,111	△602,422	191,748,233	-	185,123,581	△6,624,652
アメリカ・ドル	246,253,254	-	244,828,829	△1,424,425	107,228,605	-	103,382,162	△3,846,443
イギリス・ポンド	8,655,177	-	8,654,895	△282	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	22,880,160	-	22,879,207	△953	-	-	-	-
シンガポール・ドル	13,478,779	-	13,477,397	△1,382	-	-	-	-
ユーロ	112,770,922	-	113,595,794	824,872	75,405,578	-	72,628,019	△2,777,559
香港・ドル	2,443,241	-	2,442,989	△252	9,114,050	-	9,113,400	△650

合計	406,481,533	-	405,879,111	△602,422	191,748,233	-	185,123,581	△6,624,652

（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12月19日現在	2023年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.0077円	3.4816円
（1万口当たり純資産額）	(30,077円)	(34,816円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	94,800	8,368,944.000	
	アメリカ・ドル 小計			8,368,944.000 (1,190,063,836)	
投資信託受益証券 合計				1,190,063,836 [1,190,063,836]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,004	303,507.800	

URBAN EDGE PROPERTIES	20,635	381,953.850	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	18,788	245,559.160	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,712	4,643,137.680	
SIMON PROPERTY GROUP INC	56,853	8,206,730.550	
BOSTON PROPERTIES INC	25,135	1,795,141.700	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,000	180,000.000	
VORNADO REALTY TRUST	28,031	866,998.830	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	16,336	227,397.120	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,525	541,541.000	
UNITI GROUP INC	41,900	232,545.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,872	137,184.960	
EQUITY RESIDENTIAL	60,145	3,687,489.950	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	37,314	639,561.960	
EPR PROPERTIES	13,165	623,494.400	
CITY OFFICE REIT INC	6,000	37,740.000	
GLOBAL NET LEASE INC	34,054	313,977.880	
EQUINIX INC	16,346	13,137,770.580	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,857	396,107.860	
CHATHAM LODGING TRUST	8,284	87,727.560	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,478	1,145,559.740	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,070	311,628.400	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,348	114,004.560	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	18,642.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	122,771	2,351,064.650	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	55,372	1,968,474.600	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,862	188,450.440	
RLJ LODGING TRUST	26,986	311,958.160	
FARMLAND PARTNERS INC	7,936	102,850.560	
PHYSICIANS REALTY TRUST	41,824	548,730.880	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	11,520	149,760.000	
KIMCO REALTY CORP	107,895	2,409,295.350	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	10,445	115,521.700	

		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	66,273	1,137,244.680	
		WHITESTONE REIT	8,217	101,315.610	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,385	2,214,419.900	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20,966	153,471.120	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	36,563	598,170.680	
		INVITATION HOMES INC	100,119	3,425,070.990	
		JBG SMITH PROPERTIES	15,240	274,015.200	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,709	232,447.610	
		CLIPPER REALTY INC	1,890	9,355.500	
		GLADSTONE LAND CORP	5,632	81,945.600	
		AMERICOLD REALTY TRUST	46,365	1,379,822.400	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	49,187.600	
		VICI PROPERTIES INC	179,928	5,638,943.520	
		BRT APARTMENTS CORP	2,049	39,156.390	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,854	477,148.200	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	27,338	703,133.360	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,340	159,387.600	
		BROADSTONE NET LEASE INC	32,843	564,571.170	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18,223	120,271.800	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,454	194,442.000	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	39,336	615,608.400	
		PARAMOUNT GROUP INC	28,939	161,479.620	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	22,164	212,774.400	
		NETSTREIT CORP	11,720	201,349.600	
		APARTMENT INCOME REIT CO	25,599	872,157.930	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,211	55,357.640	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	36,663	2,073,659.280	
		STAG INDUSTRIAL INC	31,516	1,218,408.560	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	35,803.780	
		POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,325	47,880.000	

		PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	20,790	770,893.200	
		ORION OFFICE REIT INC	9,048	54,016.560	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	126,600	79,125.000	
		VENTAS INC	70,011	3,455,042.850	
		CARETRUST REIT INC	20,668	463,583.240	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,847	310,628.340	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52,363	1,233,148.650	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	51,907.710	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	40,603	580,622.900	
		UMH PROPERTIES INC	10,775	162,702.500	
		CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	4,316	102,807.120	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	5,611	45,729.650	
		PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,300	123,543.000	
		NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,504	44,596.240	
		IRON MOUNTAIN INC	50,823	3,451,898.160	
		TERRENO REALTY CORP	14,665	915,389.300	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	24,659	1,082,530.100	
		SUN COMMUNITIES INC	21,712	2,911,579.200	
		ACADIA REALTY TRUST	16,645	281,966.300	
		ALEXANDER'S INC	343	68,771.500	
		PROLOGIS INC	160,756	21,583,100.560	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,245	3,545,664.300	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	29,151	156,249.360	
		SAUL CENTERS INC	2,261	89,626.040	
		VERIS RESIDENTIAL INC	14,025	213,600.750	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,604	1,840,865.800	
		COUSINS PROPERTIES INC	26,622	643,453.740	
		SITE CENTERS CORP	31,570	445,768.400	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	7,972	1,466,927.720	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,243	2,753,972.850	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	23,024	1,229,711.840	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,840	1,349,740.800	
		GETTY REALTY CORP	8,337	240,439.080	
		WELLTOWER INC	96,347	8,747,344.130	

		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	95,266	1,862,450.300	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	18,482	439,501.960	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	29,054	245,796.840	
		EQUITY COMMONWEALTH	18,602	359,204.620	
		KILROY REALTY CORP	18,674	765,447.260	
		LTC PROPERTIES INC	7,219	240,970.220	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	51,312	494,134.560	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,391	2,742,997.320	
		MACERICH CO/THE	37,773	604,368.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,445	2,332,795.500	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	7,557	424,778.970	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	31,776	1,338,405.120	
		REALTY INCOME CORP	125,888	7,212,123.520	
		COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	19,679	501,814.500	
		PUBLIC STORAGE	27,579	7,999,564.740	
		REGENCY CENTERS CORP	28,643	1,916,503.130	
		RPT REALTY	14,099	190,054.520	
		SAFEHOLD INC	7,831	178,625.110	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18,435	504,197.250	
		SL GREEN REALTY CORP	11,216	525,918.240	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37,967	112,761.990	
		UDR INC	52,658	1,982,047.120	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,229	100,260.420	
		WP CAREY INC	37,970	2,458,937.200	
		ELME	15,375	222,783.750	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	9,494.000	
		AGREE REALTY CORP	17,403	1,065,585.690	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	42,638	1,314,103.160	
		CUBESMART	39,209	1,773,815.160	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	36,317	387,139.220	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	52,776	6,975,403.920	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	36,812	5,659,108.760	
		CENTERSPACE	2,537	147,069.890	
		KITE REALTY GROUP TRUST	38,190	877,224.300	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,592	59,123.520	

	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,928	94,428.640	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36,773	337,943.870	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	105,051	530,507.550	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	39,852.450	
	DOUGLAS EMMETT INC	28,794	440,260.260	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	22,074.840	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	45,325.500	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	92,200	18,440.000	
アメリカ・ドル 小計			185,519,798.800 (26,380,915,390)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	70,605	61,567.560	
	HELICAL PLC	18,206	39,051.870	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	38,565.270	
	ASSURA PLC	540,393	241,879.900	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	109,969	101,941.260	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	67,467	33,800.960	
	CLS HOLDINGS PLC	22,950	22,032.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	145,486	86,564.170	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	95,251	65,342.180	
	REGIONAL REIT LTD	71,837	23,921.720	
	NEWRIVER REIT PLC	51,721	43,238.750	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	355,942	471,979.090	
	CUSTODIAN REIT PLC	76,682	65,179.700	
	PRS REIT PLC/THE	95,537	77,862.650	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	69,968	62,061.610	
	LXI REIT PLC	312,442	310,879.790	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	38,703.790	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	108,136	90,293.560	
	AEW UK REIT PLC	27,617	27,396.060	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	122,313	87,698.420	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	227,112	192,136.750	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	86,012	106,826.900	
	HOME REIT PLC	117,587	44,741.850	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	136,029	969,342.650	
	SEGRO PLC	222,169	1,931,537.280	
	HAMMERSON PLC	701,936	197,524.790	
	UNITE GROUP PLC/THE	72,259	753,661.370	
	BRITISH LAND CO PLC	171,033	700,038.060	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	46,264	193,846.160	
	DERWENT LONDON PLC	20,463	484,154.580	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	243,560	242,585.760	
	WORKSPACE GROUP PLC	24,000	134,760.000	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	39,729	338,888.370	
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,506	428,202.360	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	197,192	389,257.000	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	43,335.130	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	346,934	571,400.290	
イギリス・ポンド 小計			9,712,199.610 (1,751,595,199)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	125,212	206,850.220	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	37,152	320,547.450	
	REIT 1 LTD	35,212	618,674.840	
イスラエル・シュケル 小計			1,146,072.510 (44,299,828)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	201,692	1,553,028.400	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	133,422.760	
	HMC CAPITAL LTD	45,031	273,338.170	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	97,773	110,483.490	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	62,229	186,687.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	247,199	103,823.580	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	97,570	323,932.400	
	RURAL FUNDS GROUP	67,167	139,707.360	
	WAYPOINT REIT	124,327	314,547.310	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	124,724	475,198.440	
	CENTURIA OFFICE REIT	77,754	106,134.210	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	145,140	240,932.400	

		HOMECO DAILY NEEDS REIT	334,531	419,836.400	
		REGION GROUP	215,443	506,291.050	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50,422	125,550.780	
		NATIONAL STORAGE REIT	235,152	552,607.200	
		DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	39,338	112,900.060	
		GDI PROPERTY GROUP	87,347	56,338.810	
		SCENTRE GROUP	967,634	2,864,196.640	
		ARENA REIT	63,870	233,764.200	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	35,127	100,814.490	
		BWP TRUST	87,430	318,245.200	
		GPT GROUP	359,213	1,663,156.190	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	93,874	352,966.240	
		MIRVAC GROUP	739,937	1,553,867.700	
		STOCKLAND	445,037	2,007,116.870	
		ABACUS GROUP UNIT	79,969	93,963.570	
		GOODMAN GROUP	322,195	7,771,343.400	
		VICINITY CENTRES	725,605	1,502,002.350	
		CHARTER HALL GROUP	87,533	1,071,403.920	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	69,393	297,002.040	
オーストラリア・ドル 小計				25,564,602.630 (2,438,096,153)	
	カナダ・ドル	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	14,892.000	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5,600	44,576.000	
		PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	8,541	114,791.040	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	20,856.000	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,758	42,749.000	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	62,916.000	
		SLATE GROCERY REIT	4,700	53,063.000	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,400	189,592.000	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,400	54,706.000	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	21,500	102,770.000	

		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE	1,060	9,900.400	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,800	446,832.000	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	24,800	336,784.000	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	12,600	164,430.000	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,800	279,368.000	
		CHOICE PROPERTIES REIT	29,900	405,743.000	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	47,091.000	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,800	142,688.000	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,200	324,324.000	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	15,300	772,191.000	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,566	229,061.520	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,300	502,866.000	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	33,066.000	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,100	285,811.000	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,700	133,084.000	
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	11,300	228,373.000	
カナダ・ドル 小計				5,042,523.960 (535,969,871)	
シンガポール・ドル		KEPPEL DC REIT	251,683	475,680.870	
		AIMS APAC REIT	124,800	165,984.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	545,390	627,198.500	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	87,900	60,211.500	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	327,840	214,735.200	
		EC WORLD REIT	36,500	10,220.000	

		CAPITALAND ASCENDAS REIT	663,077	1,969,338.690	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	942,922	1,895,273.220	
		SUNTEC REIT	417,700	509,594.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	622,700	1,058,590.000	
		KEPPEL REIT	416,000	395,200.000	
		CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	462,956	449,067.320	
		ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,124,102	354,092.130	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	122,000	131,760.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	201,776	451,978.240	
		STARHILL GLOBAL REIT	247,600	129,990.000	
		CAPITALAND CHINA TRUST	211,842	187,480.170	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	70,000	252,700.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	387,869	954,157.740	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	432,784	657,831.680	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	185,700	125,347.500	
		PARAGON REIT	226,000	195,490.000	
	シンガポール・ドル 小計			11,271,920.760 (1,203,390,260)	
	ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	157,936	170,570.880	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	296,788	255,237.680	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	190,268	411,930.220	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	243,698	292,437.600	
	ニュージーランド・ドル 小計			1,130,176.380 (100,031,911)	
	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,806	151,501.560	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	4,976	220,362.160	
		HAMBORNER REIT AG	10,717	72,875.600	
		WERELDHAVE NV	6,098	88,847.860	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,056	1,067,724.000	
		NSI NV	2,733	50,669.820	
		VASTNED RETAIL NV	2,739	56,560.350	
		ICADE	4,849	168,066.340	
		CARMILA	8,705	135,275.700	
		ALTAREA	710	52,611.000	

		GECINA SA	8,121	890,061.600	
		KLEPIERRE	30,857	752,910.800	
		COVIVIO	7,669	369,645.800	
		MERCIALYS	14,392	133,197.960	
		AEDIFICA	7,521	477,207.450	
		COFINIMMO	5,815	411,702.000	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,486	92,860.200	
		RETAIL ESTATES	1,873	120,808.500	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	25,580	716,240.000	
		CARE PROPERTY INVEST	5,601	79,310.160	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	4,313	128,096.100	
		MONTEA NV	2,330	196,186.000	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	16,008.300	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,570	46,328.400	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,944	294,383.200	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	52,762	521,816.180	
		CROMWELL REIT EUR	48,320	67,648.000	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	64,959	67,687.270	
ユーロ 小計				7,446,592.310 (1,154,221,808)	
韓国・ウォン		SK REITS LTD	22,834	91,564,340.000	
		D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	25,320,000.000	
		NH ALL ONE REIT LTD	6,454	22,395,380.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,632	89,425,920.000	
		LOTTE REIT CO LTD	20,132	64,623,720.000	
		JR REIT XXVII	29,728	127,979,040.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	9,157	47,524,830.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT COL	29,794	110,982,650.000	
韓国・ウォン 小計				579,815,880.000 (63,489,839)	
香港・ドル		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	395,000	481,900.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	385,530.000	
		FORTUNE REIT	268,000	1,326,600.000	

		PROSPERITY REIT	205,000	274,700.000	
		LINK REIT	477,600	20,059,200.000	
		CHAMPION REIT	331,000	784,470.000	
	香港・ドル 小計			23,312,400.000 (424,985,052)	
投資証券 合計				34,096,995,311 [34,096,995,311]	
合計				35,287,059,147 [35,287,059,147]	

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 141銘柄	4.3%	95.7%	78.1%
イギリス・ポンド	投資証券 37銘柄	-%	100%	5.0%
イスラエル・シュケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	3.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	-%	100%	0.3%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	100%	3.3%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.2%

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。

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月19日現在 金　額（円）	2023年12月18日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,588,647	5,124,512
国債証券	357,729,980	451,939,790
未収利息	330,109	101,590
前払費用	18,035	12,583
流動資産合計	362,666,771	457,178,475
資産合計	362,666,771	457,178,475
負債の部		
流動負債		
未払解約金	129,000	1,000
流動負債合計	129,000	1,000
負債合計	129,000	1,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	347,622,118	438,719,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,915,653	18,458,169
元本等合計	362,537,771	457,177,475
純資産合計	362,537,771	457,177,475
負債純資産合計	362,666,771	457,178,475

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12月20日 至2023年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
1. ※1 期首	2021年12月21日	2022年12月20日
期首元本額	314,356,530円	347,622,118円
期中追加設定元本額	89,833,929円	126,667,022円
期中一部解約元本額	56,568,341円	35,569,834円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	39,658,917円	65,190,584円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	985,533円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	93,976,772円	89,325,506円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	157,189,025円	201,611,475円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	56,797,404円	81,606,208円
計	347,622,118円	438,719,306円
2. 期末日における受益権の総数	347,622,118口	438,719,306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12月20日 至2023年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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12月18日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,474,210	△626,450
合計	△1,474,210	△626,450

（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12月19日現在	2023年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2022年12月19日現在	2023年12月18日現在
１口当たり純資産額	1.0429円	1.0421円
（1万口当たり純資産額）	(10,429円)	(10,421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	143 5年国債	38,000,000	38,047,120	
	144 5年国債	126,000,000	126,132,300	
	145 5年国債	45,000,000	45,043,200	
	146 5年国債	42,000,000	42,037,800	
	147 5年国債	9,000,000	8,987,850	
	148 5年国債	56,000,000	55,902,000	
	149 5年国債	53,000,000	52,875,980	
	150 5年国債	40,000,000	39,880,000	
	342 10年国債	43,000,000	43,033,540	
国債証券 合計			451,939,790	
合計			451,939,790	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	984,328,497円
Ⅱ	負債総額	1,278,417円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	983,050,080円
Ⅳ	発行済数量	470,242,848口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0905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) 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) ダイワＪ－ＲＥＩＴ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	404,430,588,623円
Ⅱ	負債総額	1,362,956,000円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	403,067,632,623円
Ⅳ	発行済数量	123,981,161,320口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2510円

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	37,119,039,581円
Ⅱ	負債総額	128,296,638円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	36,990,742,943円
Ⅳ	発行済数量	10,409,695,029口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5535円

(参考) ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日

Ⅰ	資産総額	459,404,545円
Ⅱ	負債総額	6,936,000円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	452,468,545円
Ⅳ	発行済数量	433,872,438口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0429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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

第二部【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	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

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

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）	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	（注1）	
	第一生命保険株式会社	60,000百万円	（注9）	
	株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	（注3）	

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

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2023年3月10日	有価証券報告書、有価証券届出書
2023年9月12日	半期報告書、有価証券届出書

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

2024年2月16日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050の2022年12月20日から2023年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050の2023年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

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。