【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2025年2月21日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	佐竹　優子 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワつみたてインデックス外国株式
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワつみたてインデックス外国株式

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2025年2月22日から2025年8月26日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、外国の株式に投資し、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います。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

外国の株式に投資し、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コクサイ指数について

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。

●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。

(注)「株式」…DR（預託証券）を含みます。

※DR：Depositary Receiptの略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。また、通常は、預託された株式の通貨とは異なる通貨で取引されます。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

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

- 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」の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

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

（注）第1計算期間は、2018年11月30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

●マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
●株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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〕

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する為替レートと基準価額の算出に使用する為替レートの不一致
- 株価指数先物と指数の動きの不一致（先物を利用した場合）
- 株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物の流動性低下時における売買対応の影響
- 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響

(2)【ファンドの沿革】

2018年8月16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	外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

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

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

＜委託会社の概況（2024年12月末日現在）＞

・資本金の額　414億2,454万1,896円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。

1995年 9月14日　「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日　「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
2020年 4月 1日　大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
2024年10月 1日　株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

外国株式インデックスマザーファンド（以下「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。

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（ＤＲ（預託証券）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います。

ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

14．投資証券、新投資口予約権証券、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．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

17．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。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

20．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。）

21．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.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.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前12.および前17.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（新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

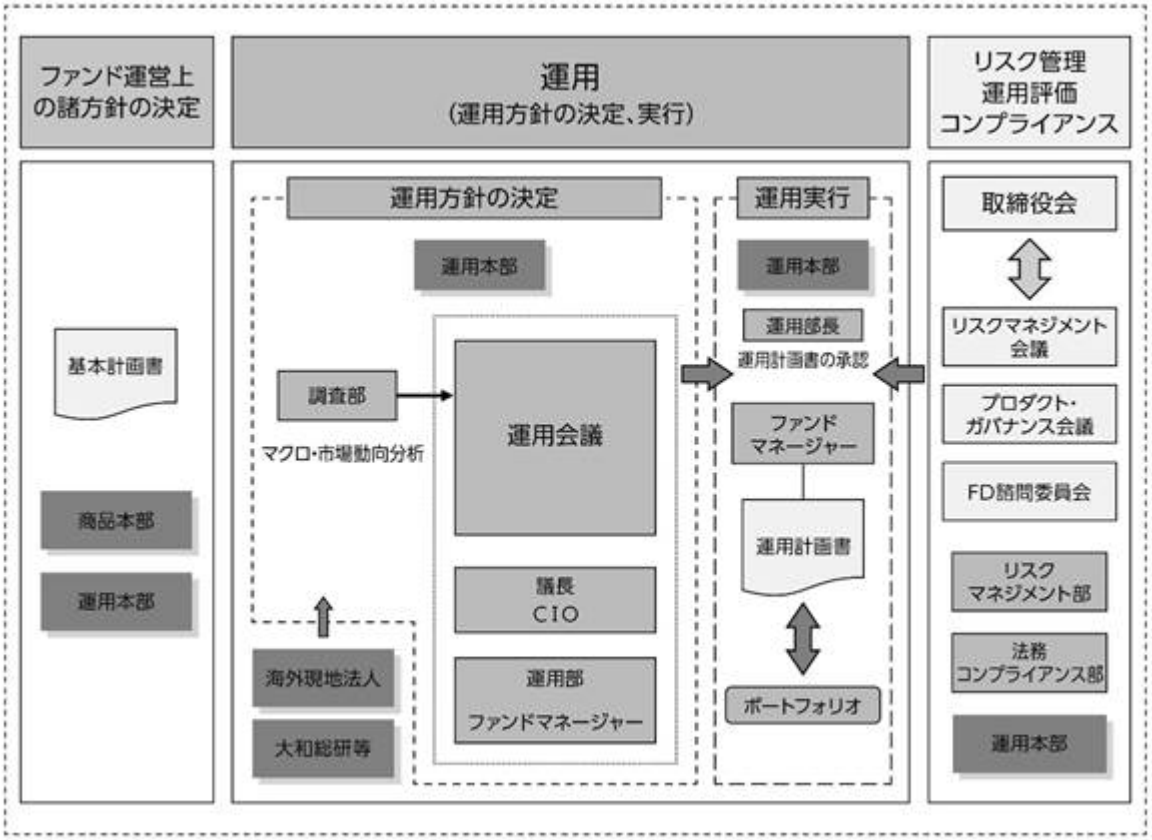
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は10～20名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

⑤　受託会社に対する管理体制

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

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

(4)【分配方針】

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　マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③　新株引受権証券等（信託約款）

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

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

④　投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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

⑤　投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑥　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑦　先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品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、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨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。

ハ．委託会社は、わが国の金融商品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金融商品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。

⑧　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（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。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合

計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

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

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

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

3．投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

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

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

⑫　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。

⑬　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。

⑭　外国為替予約取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ．前ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑮　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。

⑯　資金の借入れ（信託約款）

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

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

くは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞ マザーファンド（外国株式インデックスマザーファンド）の概要

(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【投資リスク】

(1)価額変動リスク

当ファンドは、株式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 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。

なお、当ファンドにおいては、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。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

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

③ 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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「●基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

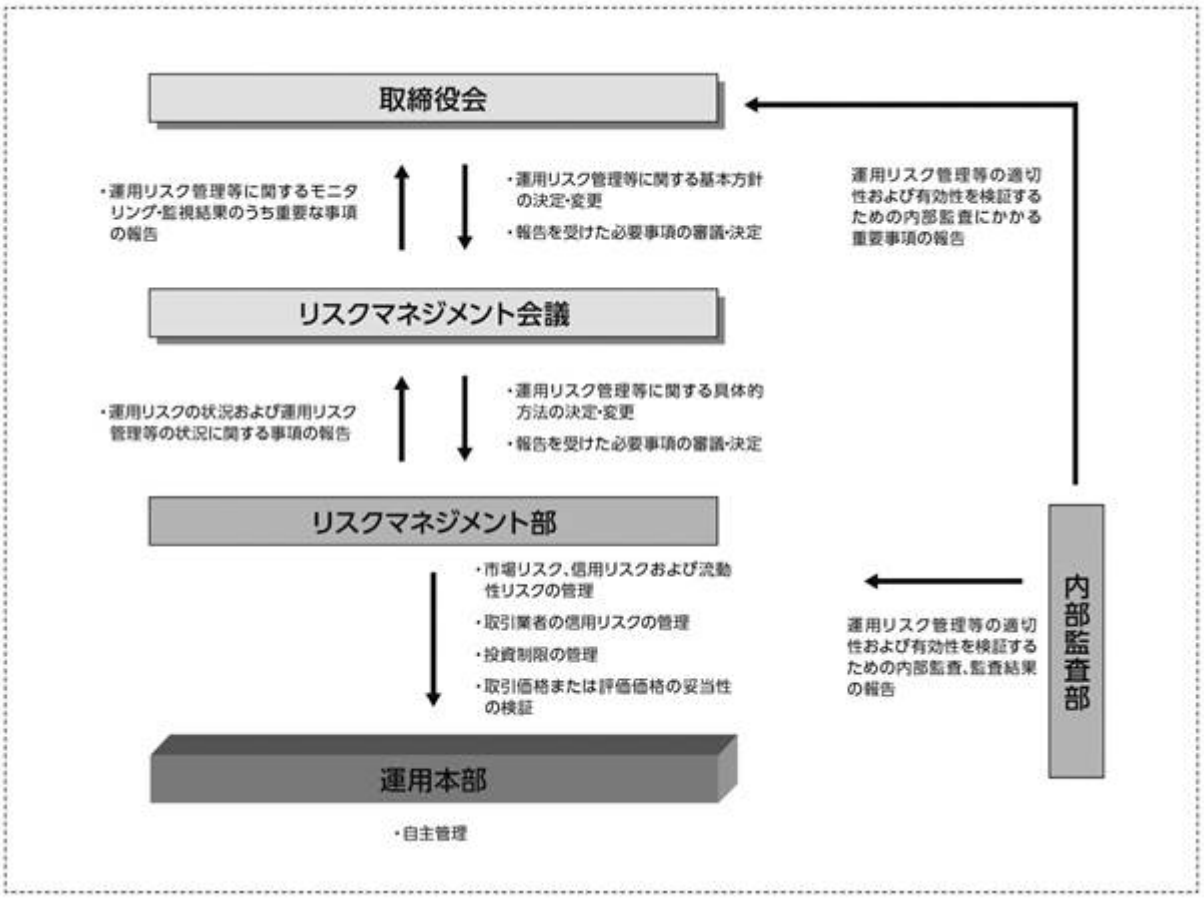
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

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

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

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜0.140%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.0625%（税抜）	年率0.0625%（税抜）	年率0.015%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息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、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」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。

②　法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率

で源泉徴収（※）され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2024年12月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】(2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		20,949,027,469	99.99
	内 日本	20,949,027,469	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,110,177	0.01
純資産総額		20,951,137,646	100.00

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

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

(2)【投資資産】(2024年12月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	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	2,894,311,615	6.9754 20,189,116,054	7.2380 20,949,027,469	99.99

(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
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

(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 (2018年11月30日)	11,289,240	11,289,240	0.9755	0.9755
第2計算期間末 (2019年12月2日)	374,669,796	374,669,796	1.0889	1.0889
第3計算期間末 (2020年11月30日)	1,358,212,376	1,358,212,376	1.1910	1.1910
第4計算期間末 (2021年11月30日)	3,335,132,811	3,335,132,811	1.6280	1.6280
第5計算期間末 (2022年11月30日)	5,964,619,572	5,964,619,572	1.7070	1.7070
第6計算期間末 (2023年11月30日)	11,223,114,968	11,223,114,968	2.0838	2.0838
2023年12月末日	11,741,140,571	－	2.1207	－
2024年1月末日	12,838,256,194	－	2.2501	－
2月末日	13,725,496,614	－	2.3585	－
3月末日	14,617,899,693	－	2.4563	－
4月末日	15,034,994,559	－	2.4888	－
5月末日	15,907,470,167	－	2.5474	－
6月末日	17,384,188,532	－	2.7022	－
7月末日	16,926,642,541	－	2.5517	－
8月末日	16,965,266,641	－	2.5071	－
9月末日	17,463,725,147	－	2.5360	－
10月末日	19,286,270,207	－	2.7281	－
11月末日	19,729,793,082	－	2.7442	－
第7計算期間末 (2024年12月2日)	19,759,010,976	19,759,010,976	2.7482	2.7482
12月末日	20,951,137,646	－	2.8531	－

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

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△2.5
第2計算期間	11.6
第3計算期間	9.4
第4計算期間	36.7
第5計算期間	4.9
第6計算期間	22.1
第7計算期間	31.9

(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	11,572,625	1,000,138
第2計算期間	351,353,787	18,853,316
第3計算期間	963,940,738	167,582,012
第4計算期間	1,122,706,894	214,486,499
第5計算期間	1,841,438,700	395,884,161
第6計算期間	2,298,603,181	406,940,368
第7計算期間	2,349,462,846	545,568,585

(注)　当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		664,948,937,471	93.92
	内 香港	3,278,069,956	0.46
	内 シンガポール	2,736,380,178	0.39
	内 イスラエル	1,649,747,543	0.23
	内 ノルウェー	1,001,666,836	0.14

	内 スウェーデン	6,198,717,354	0.88
	内 デンマーク	5,046,887,127	0.71
	内 イギリス	23,304,665,468	3.29
	内 アイルランド	449,777,616	0.06
	内 オランダ	7,450,885,512	1.05
	内 ベルギー	1,577,865,510	0.22
	内 フランス	17,623,980,655	2.49
	内 ドイツ	14,974,676,166	2.12
	内 スイス	14,493,342,974	2.05
	内 ポルトガル	264,776,302	0.04
	内 スペイン	4,398,985,152	0.62
	内 イタリア	4,514,558,654	0.64
	内 フィンランド	1,574,034,058	0.22
	内 オーストリア	310,533,061	0.04
	内 カナダ	19,423,534,158	2.74
	内 アメリカ	523,827,958,210	73.99
	内 オーストラリア	10,487,651,986	1.48
	内 ニュージーランド	360,242,995	0.05
投資証券		12,479,592,243	1.76
	内 香港	167,156,352	0.02
	内 シンガポール	165,248,323	0.02
	内 イギリス	160,464,025	0.02
	内 ベルギー	35,680,693	0.01
	内 フランス	219,838,528	0.03
	内 カナダ	22,314,046	0.00
	内 アメリカ	10,696,623,768	1.51
	内 オーストラリア	1,012,266,508	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		30,569,023,036	4.32
純資産総額		707,997,552,750	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		30,745,648,148	4.34
	内 イギリス	1,931,379,639	0.27
	内 ドイツ	5,022,395,228	0.71
	内 カナダ	2,714,868,962	0.38
	内 アメリカ	19,877,365,431	2.81
	内 オーストラリア	1,199,638,888	0.17

為替予約取引(買建)		19,217,157,600	2.71
	内 日本	19,217,157,600	2.71

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

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

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

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

(2) 投資資産（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	980,500	37,540.85 36,808,812,642	40,429.22 39,640,856,289	5.60
2	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,580,200	21,868.38 34,556,421,977	21,672.24 34,246,476,492	4.84
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	454,400	66,982.90 30,437,031,032	68,101.23 30,945,201,366	4.37
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	608,200	32,884.04 20,000,073,250	35,392.77 21,525,885,755	3.04
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	140,700	90,845.93 12,782,023,420	94,877.94 13,349,326,974	1.89
6	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	185,050	54,597.40 10,103,250,498	68,279.97 12,635,210,077	1.78
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	377,000	26,724.51 10,075,140,647	30,490.77 11,495,022,854	1.62
8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	285,620	25,637.81 7,322,672,549	38,240.01 10,922,113,084	1.54

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

26	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	213,987	16,743.90 3,582,977,571	14,059.74 3,008,603,509	0.42
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,033	29,237.99 3,129,429,912	26,726.09 2,860,573,891	0.40
28	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	25,150	108,583.32 2,730,870,699	112,953.70 2,840,785,756	0.40
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	263,550	10,136.17 2,671,388,763	9,878.34 2,603,436,771	0.37
30	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	65,778	37,090.50 2,439,739,435	39,498.34 2,598,121,809	0.37

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.92%
投資証券	1.76%
合計	95.68%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 25	買建	417	20,261,868,299	19,877,365,431	2.81%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 25	買建	119	1,952,918,031	1,931,379,639	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 25	買建	59	1,210,854,639	1,199,638,888	0.17%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 25	買建	83	2,759,761,983	2,714,868,962	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 25	買建	91	1,861,448,572	1,846,207,545	0.26%
		EURO STOXX 50 MAR 25	買建	392	3,219,887,690	3,176,187,683	0.45%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2025年1月	買建	7,500,000	728,422,240	737,712,000	0.10%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	8,500,000	1,348,394,820	1,400,522,900	0.20%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	78,900,000	11,904,185,770	12,463,044,000	1.76%
		スイス・フラン買/円売 2025年1月	買建	8,100,000	1,378,866,950	1,420,162,470	0.20%
		カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	17,000,000	1,815,234,350	1,864,279,500	0.26%
		英ポンド買/円売 2025年1月	買建	6,700,000	1,274,462,810	1,331,436,730	0.19%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワつみたてインデックス外国株式

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	28,531円
純資産総額	209億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.0%
3カ月間	12.5%
6カ月間	5.6%
1年間	34.5%
3年間	68.4%
5年間	153.6%
設定来	185.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第1期 18年11月	第2期 19年12月	第3期 20年11月	第4期 21年11月	第5期 22年11月	第6期 23年11月	第7期 24年12月				
分配金	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
外国株式・先物	1,156	98.3%
外国リート	51	1.7%
外国投資証券	3	0.1%
コール・ローン、その他		4.3%
合計	1,210	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	78.3%
イギリス	3.6%
その他	18.1%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
米ドル	78.6%
ユーロ	8.0%
英ポンド	3.6%
カナダ・ドル	3.1%
スイス・フラン	2.3%
豪ドル	1.8%
スウェーデン・クローネ	0.8%
デンマーク・クローネ	0.7%
香港ドル	0.5%
その他	0.7%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
情報技術	26.1%
金融	15.2%
一般消費財・サービス	10.4%
ヘルスケア	10.0%
資本財・サービス	9.4%
コミュニケーション・サービス	7.9%
生活必需品	5.8%
エネルギー	3.6%
素材	3.0%
公益事業、他	2.7%
合計	93.9%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	5.6%
NVIDIA CORP	アメリカ	4.8%
MICROSOFT CORP	アメリカ	4.4%
AMAZON.COM INC	アメリカ	3.0%
S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	2.8%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.9%
TESLA INC	アメリカ	1.8%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%
BROADCOM INC	アメリカ	1.5%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
合計		28.9%

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準（GICS）によるものです。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2018年※は設定日（8月16日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①+②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワつみたてインデックス外国株式	0.18%	0.15%	0.02%

※対象期間は2023年12月1日～2024年12月2日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けを行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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】

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわ

れる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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

＜一部解約＞

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

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せ下さい。。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・外国の株式：原則として金融商品取引所または店頭市場における計算時において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。

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は、2018年8月16日から2018年11月30日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日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、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース）が改廃された場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1. の事項について、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。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該

収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワつみたてインデックス外国株式

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2023年11月30日現在	第7期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,989,872	20,232,838
親投資信託受益証券	11,221,993,864	19,757,035,932
未収入金	-	248,000
流動資産合計	11,233,983,736	19,777,516,770
資産合計	11,233,983,736	19,777,516,770
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,118,837	4,317,097
未払受託者報酬	801,692	1,467,769
未払委託者報酬	6,681,079	12,231,749
その他未払費用	267,160	489,179
流動負債合計	10,868,768	18,505,794
負債合計	10,868,768	18,505,794
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,385,869,431	※1 7,189,763,692
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,837,245,537	12,569,247,284
（分配準備積立金）	2,483,637,787	6,120,511,210
元本等合計	11,223,114,968	19,759,010,976
純資産合計	11,223,114,968	19,759,010,976
負債純資産合計	11,233,983,736	19,777,516,770

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　2022年12月1日 至　2023年11月30日	第7期 自　2023年12月1日 至　2024年12月2日
営業収益		
受取利息	1	20,665
有価証券売買等損益	1,762,678,111	4,041,812,130
営業収益合計	1,762,678,112	4,041,832,795
営業費用		
支払利息	2,744	251
受託者報酬	1,351,418	2,577,728
委託者報酬	11,262,380	21,481,785
その他費用	450,327	859,093
営業費用合計	13,066,869	24,918,857
営業利益又は営業損失（△）	1,749,611,243	4,016,913,938
経常利益又は経常損失（△）	1,749,611,243	4,016,913,938
当期純利益又は当期純損失（△）	1,749,611,243	4,016,913,938
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（△）	57,229,630	171,383,771
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,470,412,954	5,837,245,537
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,967,234,894	3,506,313,110
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,967,234,894	3,506,313,110
剰余金減少額又は欠損金増加額	292,783,924	619,841,530
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	292,783,924	619,841,530
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,837,245,537	12,569,247,284

(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7期 自2023年12月1日 至2024年12月2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 2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第6期 2023年11月30日現在	第7期 2024年12月2日現在
1．　※1 期首元本額	3,494,206,618円	5,385,869,431円
期中追加設定元本額	2,298,603,181円	2,349,462,846円
期中一部解約元本額	406,940,368円	545,568,585円
2．　計算期間末日における受益権の総数	5,385,869,431口	7,189,763,692口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第6期 自2022年12月1日 至2023年11月30日	第7期 自2023年12月1日 至2024年12月2日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,692,382,876円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,353,610,400円）及び分配準備積立金（791,254,911円）より分配対象額は5,837,248,187円（1万口当たり10,838.08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（20,346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（3,845,507,388円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,448,736,074円）及び分配準備積立金（2,274,983,476円）より分配対象額は12,569,247,284円（1万口当たり17,482.14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7期 自2023年12月1日 至2024年12月2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7期 2024年12月2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6期 2023年11月30日現在	第7期 2024年12月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,751,707,645	4,007,286,129
合計	1,751,707,645	4,007,286,129

(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6期 2023年11月30日現在	第7期 2024年12月2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7期 自2023年12月1日 至2024年12月2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6期 2023年11月30日現在	第7期 2024年12月2日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0838円 (20,838円)	2.7482円 (27,482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	外国株式インデックスマザーファンド	2,834,175,288	19,757,035,932	
親投資信託受益証券 合計			19,757,035,932	
合計			19,757,035,932	

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、「外国株式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。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年11月30日現在 金 額（円）	2024年12月2日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	4,412,640,617	935,612,287
コール・ローン	21,476,693,013	12,314,896,732
株式	373,664,357,535	640,051,843,230
投資証券	7,914,490,575	12,968,542,961
派生商品評価勘定	767,966,339	531,977,165
未収入金	2,191,526	272,143,851
未収配当金	501,157,490	705,868,948
差入委託証拠金	7,673,160,653	8,426,163,601
流動資産合計	416,412,657,748	676,207,048,775
資産合計	416,412,657,748	676,207,048,775
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	430,202,473	102,188,208
未払金	-	351,019,600
未払解約金	112,438,900	96,853,900
流動負債合計	542,641,373	550,061,708
負債合計	542,641,373	550,061,708
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	78,806,686,628	96,924,210,803
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	337,063,329,747	578,732,776,264
元本等合計	415,870,016,375	675,656,987,067
純資産合計	415,870,016,375	675,656,987,067
負債純資産合計	416,412,657,748	676,207,048,775

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. ※1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	69,133,888,947円	78,806,686,628円
期中追加設定元本額	14,051,097,197円	25,952,061,446円
期中一部解約元本額	4,378,299,516円	7,834,537,271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	253,960,411円	220,998,023円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,398,033円	1,350,771円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	27,113,381円	15,969,460円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,173,336円	3,401,571円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	132,412,472円	86,602,062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）	99,283,243円	115,530,989円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	90,561,111円	78,362,997円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	-円	8,513,726,153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）	751,588,780円	778,108,890円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	4,575,264,354円	6,030,483,088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）	565,403,560円	574,681,998円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	20,741,287円	16,105,975円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	52,732,027円	46,031,100円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	7,602,914,266円	9,695,253,125円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,483,695,864円	1,527,157,717円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	320,411,034円	349,136,994円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,052,677円	17,731,066円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	47,516,377,923円	51,273,187,597円
ダイワ・ライフ・バランス３０	507,111,516円	436,772,696円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,075,299,438円	1,021,616,330円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,029,409,746円	999,681,626円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	2,012,098,874円	1,115,631,309円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,430,841円	9,608,677円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,894,554円	11,191,152円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,126,545,615円	2,834,175,288円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,059,357円	1,783,392円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,504,278円	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,293,680円	11,526,686円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	11,365,941円	15,080,207円

ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	54,089,276円	40,375,354円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	34,472,185円	28,290,570円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	912,121,494円	637,648,190円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	48,039,078円	33,662,281円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	140,584,660円	123,320,896円
スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	310,032円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	2,230,984円
スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	3,205,873円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	132,574円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	4,088,861円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	4,740,611円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	182,587円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	2,951,492円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	9,224,499円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,397,074,322円	1,222,019,164円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	429,662,271円	427,152,707円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,299,488,278円	5,037,602,817円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,021,971,653円	3,249,722,978円
ダイワライフスタイル２５	8,689,227円	6,740,978円
ダイワライフスタイル５０	39,113,782円	31,688,743円
ダイワライフスタイル７５	32,628,804円	27,235,788円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	89,653,999円	78,106,048円

ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	-円	75,686,081円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	-円	74,388,492円
計	78,806,686,628円	96,924,210,803円
2. 期末日における受益権の総数	78,806,686,628口	96,924,210,803口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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	2024年12月2日現在

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	39,406,570,740	123,657,362,007
投資証券	△350,897,450	1,822,195,992
合計	39,055,673,290	125,479,557,999

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2023年11月30日現在				2024年12月2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	33,591,785,481	-	34,198,119,607	606,334,126	22,935,030,498	-	23,364,331,715	429,301,217
合計	33,591,785,481	-	34,198,119,607	606,334,126	22,935,030,498	-	23,364,331,715	429,301,217

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2023年11月30日現在				2024年12月2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	21,334,077,040	-	21,065,506,780	△268,570,260	12,847,461,390	-	12,847,949,130	487,740
アメリカ・ドル	14,981,847,160	-	14,646,268,980	△335,578,180	7,322,207,200	-	7,322,560,000	352,800
イギリス・ポンド	1,079,899,470	-	1,101,174,230	21,274,760	1,062,272,960	-	1,062,247,760	△25,200
オーストラリア・ドル	630,276,320	-	642,564,780	12,288,460	601,938,160	-	602,055,340	117,180
カナダ・ドル	1,248,114,090	-	1,243,166,100	△4,947,990	1,642,414,620	-	1,642,630,220	215,600
スイス・フラン	1,013,961,080	-	1,027,848,170	13,887,090	1,240,881,010	-	1,240,759,830	△121,180
ユーロ	2,379,978,920	-	2,404,484,520	24,505,600	977,747,440	-	977,695,980	△51,460
合計	21,334,077,040	-	21,065,506,780	△268,570,260	12,847,461,390	-	12,847,949,130	487,740

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
１口当たり純資産額	5.2771円	6.9710円
（1万口当たり純資産額）	(52,771円)	(69,710円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,600	236.020	1,793,752.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	21,000	387.820	8,144,220.000	
	FIRST SOLAR INC	6,600	199.270	1,315,182.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,200	170.840	1,913,408.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,400	148.180	1,244,712.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	25,500	67.520	1,721,760.000	
	ABBOTT LABORATORIES	111,966	118.770	13,298,201.820	
	HOWMET AEROSPACE INC	24,983	118.380	2,957,487.540	
	VERISK ANALYTICS INC	9,200	294.210	2,706,732.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	23,700	53.060	1,257,522.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	77,600	72.650	5,637,640.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,200	567.640	1,816,448.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,100	85.300	2,994,030.000	
	QORVO INC	6,020	69.050	415,681.000	
	AFLAC INC	34,300	114.000	3,910,200.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	7,600	176.270	1,339,652.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	10,400	138.250	1,437,800.000	

ADOBE INC	28,320	515.930	14,611,137.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,500	89.660	1,031,090.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,200	320.660	2,308,752.000	
GARMIN LTD	9,900	212.600	2,104,740.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,400	334.330	4,814,352.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41,800	232.930	9,736,474.000	
WR BERKLEY CORP	19,613	64.550	1,266,019.150	
AUTOZONE INC	1,120	3,169.540	3,549,884.800	
DOLLAR TREE INC	13,171	71.270	938,697.170	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	76,900	16.780	1,290,382.000	
CELANESE CORP	7,050	73.210	516,130.500	
DR HORTON INC	18,916	168.780	3,192,642.480	
AUTODESK INC	13,900	291.900	4,057,410.000	
MOODY'S CORP	10,600	499.980	5,299,788.000	
DEVON ENERGY CORP	40,300	37.950	1,529,385.000	
ALBEMARLE CORP	7,600	107.700	818,520.000	
ATMOS ENERGY CORP	10,100	151.320	1,528,332.000	
ALLIANT ENERGY CORP	16,600	63.200	1,049,120.000	
CITIGROUP INC	122,773	70.870	8,700,922.510	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,300	306.930	8,072,259.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,300	99.860	3,425,198.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,230	476.190	1,061,903.700	
HESS CORP	17,900	147.180	2,634,522.000	
DAVITA INC	2,950	166.170	490,201.500	
DANAHER CORP	41,850	239.690	10,031,026.500	
FORTIVE CORP	22,600	79.330	1,792,858.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	37,000	160.960	5,955,520.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31,000	54.600	1,692,600.000	
APPLE INC	980,500	237.330	232,702,065.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,200	182.430	2,955,366.000	
BOEING CO/THE	46,900	155.440	7,290,136.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,115	159.830	1,616,680.450	
BECTON DICKINSON AND CO	18,599	221.900	4,127,118.100	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	165.400	1,372,820.000	
NISOURCE INC	28,900	38.090	1,100,801.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,600	105.580	802,408.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	47,571	81.870	3,894,637.770	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	270,904	44.340	12,011,883.360	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	85,350	483.020	41,225,757.000	

ANSYS INC	5,700	351.100	2,001,270.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	86,217	47.680	4,110,826.560	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	46,400	191.090	8,866,576.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	130,500	59.220	7,728,210.000	
JPMORGAN CHASE & CO	183,070	249.720	45,716,240.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,400	123.840	1,783,296.000	
LKQ CORP	16,700	39.290	656,143.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,812	42.080	497,048.960	
CADENCE DESIGN SYS INC	17,700	306.810	5,430,537.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,400	573.970	3,673,408.000	
DOLLAR GENERAL CORP	14,200	77.270	1,097,234.000	
SERVICENOW INC	13,300	1,049.440	13,957,552.000	
CATERPILLAR INC	31,200	406.110	12,670,632.000	
BROWN & BROWN INC	15,700	113.100	1,775,670.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,800	40.030	672,504.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,400	199.060	676,804.000	
CMS ENERGY CORP	19,300	69.710	1,345,403.000	
MOSAIC CO/THE	20,100	26.460	531,846.000	
DELTA AIR LINES INC	10,400	63.820	663,728.000	
CORNING INC	52,400	48.670	2,550,308.000	
CISCO SYSTEMS INC	256,750	59.210	15,202,167.500	
MORGAN STANLEY	78,152	131.610	10,285,584.720	
DECKERS OUTDOOR CORP	9,900	195.960	1,940,004.000	
MSCI INC	5,100	609.630	3,109,113.000	
FAIR ISAAC CORP	1,600	2,375.030	3,800,048.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,100	667.130	1,400,973.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,000	285.440	1,141,760.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,300	77.340	1,105,962.000	
BROADCOM INC	285,620	162.080	46,293,289.600	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,800	370.490	1,037,372.000	
CNH INDUSTRIAL NV	56,500	12.560	709,640.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,800	207.240	787,512.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,300	253.070	2,100,481.000	
DTE ENERGY COMPANY	13,400	125.780	1,685,452.000	
CENTENE CORP	33,907	60.000	2,034,420.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,800	215.850	1,467,780.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	28,900	48.140	1,391,246.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,100	312.240	4,402,584.000	
GARTNER INC	5,050	517.930	2,615,546.500	

DOMINION ENERGY INC	54,041	58.750	3,174,908.750	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,300	55.130	2,607,649.000	
SMITH (A.O.) CORP	7,800	74.490	581,022.000	
DEERE & CO	16,800	465.900	7,827,120.000	
QUANTA SERVICES INC	9,500	344.520	3,272,940.000	
POOL CORP	2,500	377.090	942,725.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,384	118.960	1,949,040.640	
BURLINGTON STORES INC	4,100	281.880	1,155,708.000	
NASDAQ INC	27,800	82.990	2,307,122.000	
TARGA RESOURCES CORP	13,400	204.300	2,737,620.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	146.860	675,556.000	
WESTLAKE CORP	2,500	128.400	321,000.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,300	100.590	2,243,157.000	
TELEFLEX INC	3,100	192.850	597,835.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,300	189.110	1,002,283.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,700	325.680	1,530,696.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,300	340.530	442,689.000	
CATALENT INC	11,700	61.110	714,987.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,900	227.850	2,255,715.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	297.900	1,132,020.000	
CARLISLE COS INC	3,000	456.700	1,370,100.000	
IDEX CORP	4,900	230.630	1,130,087.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,000	96.630	4,831,500.000	
ROLLINS INC	18,707	50.330	941,523.310	
AECOM	8,600	116.970	1,005,942.000	
WATSCO INC	2,300	551.600	1,268,680.000	
GRACO INC	10,900	91.080	992,772.000	
AMETEK INC	14,900	194.380	2,896,262.000	
TORO CO	6,500	87.080	566,020.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,800	110.130	1,740,054.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,450	59.360	620,312.000	
HEICO CORP	2,900	273.370	792,773.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,500	490.670	1,226,675.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,800	83.340	1,400,112.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,800	629.170	1,761,676.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,560	971.880	27,756,892.800	
EPAM SYSTEMS INC	3,700	243.920	902,504.000	
RPM INTERNATIONAL INC	8,300	138.780	1,151,874.000	
RELIANCE INC	3,600	321.240	1,156,464.000	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	88,200	61.520	5,426,064.000	
CUMMINS INC	8,900	375.040	3,337,856.000	
CDW CORP/DE	8,600	175.930	1,512,998.000	
COSTAR GROUP INC	26,400	81.340	2,147,376.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12,400	225.140	2,791,736.000	
MERCADOLIBRE INC	2,990	1,985.170	5,935,658.300	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,700	176.180	828,046.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,916	253.440	4,033,751.040	
DEXCOM INC	25,800	77.990	2,012,142.000	
NORDSON CORP	3,590	260.990	936,954.100	
COPART INC	55,800	63.390	3,537,162.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	12,300	177.590	2,184,357.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,600	232.770	1,070,742.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,900	325.150	1,593,235.000	
TRANSDIGM GROUP INC	3,690	1,252.970	4,623,459.300	
BIO-TECHNE CORP	10,220	75.360	770,179.200	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,500	126.750	823,875.000	
KINDER MORGAN INC	128,781	28.270	3,640,638.870	
HCA HEALTHCARE INC	12,500	327.220	4,090,250.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,500	258.690	646,725.000	
COTERRA ENERGY INC	47,600	26.720	1,271,872.000	
T-MOBILE US INC	33,827	246.940	8,353,239.380	
ZILLOW GROUP INC - C	9,950	84.710	842,864.500	
EMCOR GROUP INC	3,000	510.120	1,530,360.000	
COCA-COLA CO/THE	263,550	64.080	16,888,284.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,200	77.580	1,024,056.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,150	121.640	1,113,006.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	18,200	22.760	414,232.000	
CSX CORP	124,700	36.550	4,557,785.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,025	184.620	1,481,575.500	
AMAZON.COM INC	608,200	207.890	126,438,698.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	38,800	71.350	2,768,380.000	
EXXON MOBIL CORP	285,809	117.960	33,714,029.640	
AES CORP	45,800	13.040	597,232.000	
EVEREST GROUP LTD	2,800	387.560	1,085,168.000	
EOG RESOURCES INC	36,600	133.260	4,877,316.000	
EQT CORP	36,400	45.440	1,654,016.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	9,800	94.020	921,396.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	2,295.000	1,606,500.000	

CENCORA INC	11,500	251.550	2,892,825.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,500	137.970	2,552,445.000	
FORD MOTOR CO	251,223	11.130	2,796,111.990	
EXACT SCIENCES CORP	11,900	62.080	738,752.000	
ENTEGRIS INC	9,800	105.630	1,035,174.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	11,900	387.470	4,610,893.000	
AERCAP HOLDINGS NV	12,200	99.360	1,212,192.000	
FORTINET INC	41,900	95.050	3,982,595.000	
MARKEL CORP	820	1,782.920	1,461,994.400	
NEXTERA ENERGY INC	132,280	78.670	10,406,467.600	
FREEPORT-MCMORAN INC	92,508	44.200	4,088,853.600	
INSULET CORP	4,600	266.780	1,227,188.000	
US BANCORP	100,500	53.290	5,355,645.000	
UNITED RENTALS INC	4,300	866.000	3,723,800.000	
F5 NETWORKS INC	3,800	250.350	951,330.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	34,000	32.640	1,109,760.000	
FASTENAL CO	36,900	83.560	3,083,364.000	
FISERV INC	37,033	220.960	8,182,811.680	
GENERAL ELECTRIC CO	69,806	182.160	12,715,860.960	
AXON ENTERPRISE INC	4,700	646.960	3,040,712.000	
GENERAL MOTORS CO	72,300	55.590	4,019,157.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,100	284.010	4,288,551.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,350	608.570	12,384,399.500	
ALPHABET INC-CL A	377,000	168.950	63,694,150.000	
ALPHABET INC-CL C	323,440	170.490	55,143,285.600	
OWENS CORNING	5,600	205.620	1,151,472.000	
GENERAL MILLS INC	35,800	66.260	2,372,108.000	
FIRSTENERGY CORP	35,218	42.550	1,498,525.900	
GENUINE PARTS CO	9,050	126.730	1,146,906.500	
FIFTH THIRD BANCORP	43,600	48.060	2,095,416.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,250	246.250	3,016,562.500	
HALLIBURTON CO	56,800	31.860	1,809,648.000	
HOME DEPOT INC	63,950	429.130	27,442,863.500	
ASSURANT INC	3,350	227.100	760,785.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,500	18.010	1,683,935.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,610	197.920	516,571.200	
HERSHEY CO/THE	9,500	176.130	1,673,235.000	
HUMANA INC	7,800	296.380	2,311,764.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,400	229.370	3,761,668.000	

HENRY SCHEIN INC	8,100	77.050	624,105.000	
HP INC	62,000	35.430	2,196,660.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	83,600	21.220	1,773,992.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	24,300	100.720	2,447,496.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,403	31.970	1,867,143.910	
ENPHASE ENERGY INC	8,600	71.350	613,610.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	59,300	227.410	13,485,413.000	
HUBBELL INC	3,500	460.090	1,610,315.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	21,300	58.830	1,253,079.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,900	78.300	618,570.000	
ZOETIS INC	29,200	175.250	5,117,300.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,599	416.220	6,076,395.780	
CHENIERE ENERGY INC	14,600	224.010	3,270,546.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	157.940	458,026.000	
ALLEGION PLC	5,650	140.840	795,746.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,500	186.470	1,398,525.000	
WASTE CONNECTIONS INC	16,637	192.470	3,202,123.390	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.920	607,048.000	
JM SMUCKER CO/THE	6,900	117.790	812,751.000	
JOHNSON & JOHNSON	155,000	155.010	24,026,550.000	
ABBVIE INC	113,672	182.930	20,794,018.960	
HOLOGIC INC	15,000	79.500	1,192,500.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,700	139.350	3,023,895.000	
KROGER CO	44,300	61.080	2,705,844.000	
KLA CORP	8,700	647.030	5,629,161.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	13,800	529.410	7,305,858.000	
CORPAY INC	4,300	381.180	1,639,074.000	
LOWE'S COS INC	36,500	272.430	9,943,695.000	
ELI LILLY & CO	51,985	795.350	41,346,269.750	
LAM RESEARCH CORP	83,400	73.880	6,161,592.000	
LOEWS CORP	12,000	86.730	1,040,760.000	
MCDONALD'S CORP	46,150	296.010	13,660,861.500	
3M CO	35,390	133.530	4,725,626.700	
META PLATFORMS INC CLASS A	140,700	574.320	80,806,824.000	
S&P GLOBAL INC	20,639	522.510	10,784,083.890	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,000	600.000	2,400,000.000	
PHILLIPS 66	27,000	133.980	3,617,460.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	10,300	263.580	2,714,874.000	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,750	38.340	565,515.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,300	78.410	1,278,083.000	
METLIFE INC	38,300	88.230	3,379,209.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	55,800	92.690	5,172,102.000	
ARISTA NETWORKS INC	17,200	405.820	6,980,104.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,798	499.700	5,395,760.600	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,400	1,251.200	1,751,680.000	
BAKER HUGHES CO	63,923	43.950	2,809,415.850	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,300	295.140	2,154,522.000	
MERCK & CO. INC.	163,121	101.640	16,579,618.440	
DUPONT DE NEMOURS INC	26,951	83.590	2,252,834.090	
MASCO CORP	14,100	80.560	1,135,896.000	
M & T BANK CORP	10,799	219.990	2,375,672.010	
MARSH & MCLENNAN COS	31,670	233.230	7,386,394.100	
HEICO CORP-CLASS A	4,920	211.130	1,038,759.600	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,402	289.090	4,452,564.180	
WORKDAY INC-CLASS A	13,800	249.990	3,449,862.000	
BLOCK INC CLASS A	35,812	88.550	3,171,152.600	
TRANSUNION	12,600	101.500	1,278,900.000	
VISTRA CORP	22,100	159.840	3,532,464.000	
NETAPP INC	13,200	122.640	1,618,848.000	
NIKE INC -CL B	76,600	78.770	6,033,782.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	14,600	275.850	4,027,410.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34,600	68.170	2,358,682.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,605	169.280	2,133,774.400	
ALLY FINANCIAL INC	17,700	39.980	707,646.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,000	489.650	4,406,850.000	
APTIV PLC	17,100	55.530	949,563.000	
NEWMONT CORP	73,611	41.940	3,087,245.340	
MCKESSON CORP	8,400	628.500	5,279,400.000	
XYLEM INC	15,700	126.750	1,989,975.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,100	133.060	13,319,306.000	
NUCOR CORP	15,300	154.690	2,366,757.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,400	476.960	4,960,384.000	
GODADDY INC - CLASS A	9,100	197.570	1,797,887.000	
EVERGY INC	14,850	64.630	959,755.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,724	50.580	2,059,819.920	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,650	440.560	726,924.000	
OKTA INC	10,500	77.560	814,380.000	

WIX.COM LTD	3,610	223.740	807,701.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,400	48.230	983,892.000	
KKR & CO INC	40,000	162.870	6,514,800.000	
PAYCHEX INC	20,900	146.270	3,057,043.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	1,243.220	4,724,236.000	
ALTRIA GROUP INC	109,800	57.740	6,339,852.000	
P G & E CORP	130,700	21.630	2,827,041.000	
PFIZER INC	364,713	26.210	9,559,127.730	
CIGNA CORP	18,000	337.800	6,080,400.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	20,601	127.590	2,628,481.590	
XCEL ENERGY INC	35,900	72.560	2,604,904.000	
STERIS PLC	6,400	219.060	1,401,984.000	
SEA LTD-ADR	25,100	113.800	2,856,380.000	
FOX CORP - CLASS B	9,133	44.730	408,519.090	
FOX CORP - CLASS A	14,499	47.120	683,192.880	
STRYKER CORP	22,080	392.150	8,658,672.000	
DOW INC	45,118	44.210	1,994,666.780	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,500	135.500	1,016,250.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	16,100	82.690	1,331,309.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,300	702.900	5,834,070.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	121,800	71.960	8,764,728.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	151,167	179.260	27,098,196.420	
EXELON CORP	64,422	39.560	2,548,534.320	
INGERSOLL-RAND INC	26,008	104.170	2,709,253.360	
NVR INC	200	9,235.580	1,847,116.000	
CONOCOPHILLIPS	83,803	108.340	9,079,217.020	
TWILIO INC - A	9,800	104.540	1,024,492.000	
DOCUSIGN INC	13,100	79.690	1,043,939.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,400	231.920	788,528.000	
DAYFORCE INC	10,200	79.990	815,898.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	20,100	52.990	1,065,099.000	
PEPSICO INC	88,300	163.450	14,432,635.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,020	323.510	977,000.200	
MONGODB INC	4,800	322.490	1,547,952.000	
SNAP INC - A	67,900	11.810	801,899.000	
CORTEVA INC	44,568	62.240	2,773,912.320	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,000	129.410	2,976,430.000	
AMCOR PLC	93,100	10.640	990,584.000	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,000	345.970	5,189,550.000	
ROKU INC	8,200	69.030	566,046.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,600	136.940	1,725,444.000	
ACCENTURE PLC-CL A	40,300	362.370	14,603,511.000	
PENTAIR PLC	10,675	108.990	1,163,468.250	
QUALCOMM INC	71,700	158.530	11,366,601.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,900	87.090	1,297,641.000	
DATADOG INC - CLASS A	18,100	152.750	2,764,775.000	
PINTEREST INC- CLASS A	38,900	30.320	1,179,448.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,000	750.220	5,251,540.000	
REPUBLIC SERVICES INC	14,200	218.300	3,099,860.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,200	5,201.980	11,444,356.000	
ROSS STORES INC	21,400	154.870	3,314,218.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,830	248.850	1,450,795.500	
RESMED INC	9,500	249.020	2,365,690.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,230	162.660	1,176,031.800	
MODERNA INC	21,100	43.060	908,566.000	
HUBSPOT INC	3,180	721.050	2,292,939.000	
REVVITY INC	8,000	116.140	929,120.000	
CARRIER GLOBAL CORP	52,287	77.370	4,045,445.190	
OTIS WORLDWIDE CORP	25,838	102.980	2,660,797.240	
AVANTOR INC	43,800	21.060	922,428.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	14,700	53.230	782,481.000	
DYNATRACE INC	19,300	56.190	1,084,467.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	29,000	128.550	3,727,950.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	58,885	27.260	1,605,205.100	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	24,100	26.660	642,506.000	
MATCH GROUP INC	15,800	32.740	517,292.000	
CHEVRON CORP	111,818	161.930	18,106,688.740	
ZSCALER INC	5,900	206.590	1,218,881.000	
EDISON INTERNATIONAL	24,900	87.750	2,184,975.000	
TESLA INC	185,050	345.160	63,871,858.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,500	174.800	3,408,600.000	
GEN DIGITAL INC	35,300	30.850	1,089,005.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,002	89.450	894,678.900	
SYNOPSYS INC	9,900	558.490	5,529,051.000	
CARVANA CO	7,800	260.420	2,031,276.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,600	99.830	1,956,668.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,005	396.965	2,383,774.820	

VIATRIS INC	76,821	13.090	1,005,586.890	
DOORDASH INC - A	19,850	180.480	3,582,528.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	30,900	50.130	1,549,017.000	
AIRBNB INC-CLASS A	28,400	136.110	3,865,524.000	
CBRE GROUP INC - A	19,800	139.990	2,771,802.000	
SOUTHERN CO/THE	70,500	89.130	6,283,665.000	
SYSCO CORP	31,600	77.110	2,436,676.000	
TRAVELERS COS INC/THE	14,703	266.040	3,911,586.120	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,900	87.230	340,197.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,000	82.630	578,410.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,450	145.270	1,372,801.500	
SCHLUMBERGER LTD	91,352	43.940	4,014,006.880	
AT&T INC	461,491	23.160	10,688,131.560	
APA CORP	23,300	22.650	527,745.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,750	32.360	315,510.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	27,600	71.120	1,962,912.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,500	397.400	6,159,700.000	
SEMPRA ENERGY	40,800	93.670	3,821,736.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,300	49.500	509,850.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	131,100	67.080	8,794,188.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,650	101.330	1,383,154.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,500	296.200	3,702,500.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	58,800	201.030	11,820,564.000	
SALESFORCE.COM INC	61,566	329.990	20,316,164.340	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	25,709	175.030	4,499,846.270	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	43,034	83.860	3,608,831.240	
TERADYNE INC	10,600	110.000	1,166,000.000	
UNION PACIFIC CORP	39,280	244.660	9,610,244.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,488	156.150	3,355,351.200	
RTX CORP	85,679	121.830	10,438,272.570	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,200	135.720	6,405,984.000	
IQVIA HOLDINGS INC	11,804	200.840	2,370,715.360	
AMEREN CORPORATION	17,200	94.390	1,623,508.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,466	610.200	36,286,153.200	
APPLOVIN CORP CLASS A	13,400	336.750	4,512,450.000	
TOAST INC CLASS A	25,400	43.540	1,105,916.000	
VERISIGN INC	5,700	187.180	1,066,926.000	

RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	48,400	12.230	591,932.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	34,400	37.540	1,291,376.000	
VALERO ENERGY CORP	20,642	139.080	2,870,889.360	
ULTA BEAUTY INC	3,100	386.640	1,198,584.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	16,788	63.390	1,064,191.320	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,830	205.000	785,150.000	
ELEVANCE HEALTH INC	15,000	406.960	6,104,400.000	
WALT DISNEY CO/THE	116,762	117.470	13,716,032.140	
WELLS FARGO & CO	218,822	76.170	16,667,671.740	
WASTE MANAGEMENT INC	25,900	228.220	5,910,898.000	
WILLIAMS COS INC	78,500	58.520	4,593,820.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,000	283.670	1,985,690.000	
WALMART INC	284,500	92.500	26,316,250.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,100	112.100	1,468,510.000	
WYNN RESORTS LTD	6,400	94.380	604,032.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	143,300	5.000	716,500.000	
WABTEC CORP	11,311	200.620	2,269,212.820	
TJX COMPANIES INC	72,600	125.690	9,125,094.000	
WATERS CORP	3,900	384.720	1,500,408.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,400	407.000	1,383,800.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	47,300	9.020	426,646.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,563	322.000	2,113,286.000	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,200	172.020	1,410,564.000	
WESTERN DIGITAL CORP	22,400	72.990	1,634,976.000	
WEC ENERGY GROUP INC	20,400	101.050	2,061,420.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,100	94.300	3,027,030.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	107,850	315.080	33,981,378.000	
PPL CORP	47,500	34.930	1,659,175.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	20,124	256.560	5,163,013.440	
PULTEGROUP INC	13,350	135.270	1,805,854.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	149,953	10.480	1,571,507.440	
PPG INDUSTRIES INC	15,100	124.370	1,877,987.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,000	111.160	1,445,080.000	
NVIDIA CORP	1,580,200	138.250	218,462,650.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	25,613	214.720	5,499,623.360	

DRAFTKINGS INC CLASS A	28,200	43.650	1,230,930.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,900	250.000	475,000.000	
TYSON FOODS INC-CL A	18,400	64.500	1,186,800.000	
NETFLIX INC	27,690	886.810	24,555,768.900	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,600	529.630	13,028,898.000	
NRG ENERGY INC	13,350	101.610	1,356,493.500	
TEXTRON INC	12,000	85.630	1,027,560.000	
NEWS CORP - CLASS A	24,487	29.350	718,693.450	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,600.090	2,160,121.500	
OMNICOM GROUP	12,600	104.820	1,320,732.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,020	141.230	1,132,664.600	
ORACLE CORP	107,033	184.840	19,783,979.720	
MASTERCARD INC - A	53,100	532.940	28,299,114.000	
ONEOK INC	37,600	113.600	4,271,360.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,900	566.440	3,908,436.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,300	62.440	393,372.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	12,200	176.730	2,156,106.000	
EXPAND ENERGY CORP	13,500	98.960	1,335,960.000	
HF SINCLAIR CORP	10,500	40.930	429,765.000	
OVINTIV INC	17,000	45.420	772,140.000	
YUM! BRANDS INC	18,100	138.940	2,514,814.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	11,400	188.380	2,147,532.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,700	62.060	726,102.000	
BANK OF AMERICA CORP	449,301	47.510	21,346,290.510	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,100	485.260	1,504,306.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,300	66.030	812,169.000	
AMERICAN EXPRESS CO	36,600	304.680	11,151,288.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	29,535	83.220	2,457,902.700	
LINDE PLC	30,746	460.990	14,173,598.540	
ANALOG DEVICES INC	31,991	218.050	6,975,637.550	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	24,300	19.850	482,355.000	
MONDAYCOM LTD	2,600	285.360	741,936.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	104,227	137.175	14,297,338.720	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	32.370	556,764.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	13,600	88.360	1,201,696.000	
KENVUE INC	123,300	24.080	2,969,064.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	6,800	52.280	355,504.000	

VERALTO CORP	15,916	108.190	1,721,952.040	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,372	76.880	3,180,679.360	
BUNGE GLOBAL LTD	9,200	89.740	825,608.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	23,000	127.600	2,934,800.000	
NUTANIX INC CLASS A	17,100	65.280	1,116,288.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,300	87.590	902,177.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,800	244.060	3,856,148.000	
AVERY DENNISON CORP	5,230	205.950	1,077,118.500	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	31,900	80.490	2,567,631.000	
EMERSON ELECTRIC CO	36,900	132.600	4,892,940.000	
AON PLC-CLASS A	12,600	391.540	4,933,404.000	
AMGEN INC	34,600	282.870	9,787,302.000	
SAMSARA INC CLASS A	14,100	53.490	754,209.000	
EATON CORP PLC	25,636	375.420	9,624,267.120	
COOPER INC	12,900	104.460	1,347,534.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,600	240.950	2,554,070.000	
APPLIED MATERIALS INC	53,100	174.710	9,277,101.000	
CME GROUP INC	23,200	238.000	5,521,600.000	
ECOLAB INC	16,500	248.770	4,104,705.000	
EQUIFAX INC	8,000	261.560	2,092,480.000	
GILEAD SCIENCES INC	80,200	92.580	7,424,916.000	
KEURIG DR PEPPER INC	74,500	32.650	2,432,425.000	
HORMEL FOODS CORP	19,500	32.430	632,385.000	
STATE STREET CORP	19,013	98.510	1,872,970.630	
SOLVENTUM CORP	9,472	71.510	677,342.720	
GE VERNOVA	17,726	334.120	5,922,611.120	
SCHWAB (CHARLES) CORP	103,340	82.760	8,552,418.400	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	44,000	102.270	4,499,880.000	
LABCORP HOLDINGS	5,500	241.160	1,326,380.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	32,900	33.710	1,109,059.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	33,500	55.020	1,843,170.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,000	215.930	2,807,090.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,500	276.320	3,177,680.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	12,500	46.200	577,500.000	
CROWN HOLDINGS INC	7,780	92.090	716,460.200	
TE CONNECTIVITY LTD	19,595	151.120	2,961,196.400	
BLACKROCK INC	9,600	1,022.800	9,818,880.000	
CARDINAL HEALTH INC	15,600	122.240	1,906,944.000	
FEDEX CORP	15,000	302.670	4,540,050.000	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,654	192.010	4,733,814.540	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16,513	91.360	1,508,627.680	
INTEL CORP	275,300	24.050	6,620,965.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	24,200	30.810	745,602.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,850	123.310	2,324,393.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	19,100	277.520	5,300,632.000	
ILLUMINA INC	10,300	144.150	1,484,745.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	22,900	542.000	12,411,800.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,050	182.000	1,101,100.000	
SNAP-ON INC	3,400	369.690	1,256,946.000	
CARMAX INC	10,000	83.970	839,700.000	
DUKE ENERGY CORP	49,728	117.050	5,820,662.400	
TARGET CORP	29,700	132.310	3,929,607.000	
DOVER CORP	8,900	205.900	1,832,510.000	
WW GRAINGER INC	2,900	1,205.340	3,495,486.000	
JABIL INC	7,300	135.830	991,559.000	
CINTAS CORP	23,400	225.790	5,283,486.000	
CONAGRA BRANDS INC	30,800	27.550	848,540.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	9,100	77.240	702,884.000	
CLOROX COMPANY	8,000	167.170	1,337,360.000	
ENTERGY CORP	13,800	156.170	2,155,146.000	
MICROSOFT CORP	454,400	423.460	192,420,224.000	
INCYTE CORP	10,600	74.590	790,654.000	
CVS HEALTH CORP	80,969	59.850	4,845,994.650	
MEDTRONIC PLC	82,598	86.540	7,148,030.920	
MICRON TECHNOLOGY INC	71,400	97.950	6,993,630.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,000	32.620	1,370,040.000	
KELLOGG CO	17,800	81.290	1,446,962.000	
KEYCORP	60,700	19.480	1,182,436.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	86,011	64.950	5,586,414.450	
CHUBB LTD	24,699	288.730	7,131,342.270	
ALLSTATE CORP	17,000	207.390	3,525,630.000	
EBAY INC	31,400	63.290	1,987,306.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	62,450	86.770	5,418,786.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,600	104.720	795,872.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,100	72.120	1,089,012.000	
TRIMBLE INC	15,800	72.970	1,152,926.000	
LENNAR CORP-A	15,400	174.390	2,685,606.000	
PROGRESSIVE CORP	37,700	268.880	10,136,776.000	

	PACCAR INC	33,755	117.000	3,949,335.000	
	BIOGEN INC	9,400	160.630	1,509,922.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	5,300	421.750	2,235,275.000	
	STARBUCKS CORP	73,000	102.460	7,479,580.000	
	PTC INC	7,800	200.060	1,560,468.000	
	EVERSOURCE ENERGY	23,100	64.490	1,489,719.000	
	INTUIT INC	18,080	641.730	11,602,478.400	
	BEST BUY CO INC	13,150	90.000	1,183,500.000	
	BALL CORP	19,504	62.160	1,212,368.640	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	94,797	90.660	8,594,296.020	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,200	163.670	2,651,454.000	
	VULCAN MATERIALS CO	8,500	288.130	2,449,105.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,700	468.130	7,817,771.000	
	CARNIVAL CORP	67,000	25.430	1,703,810.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	248,490	43.190	10,732,283.100	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,900	43.660	475,894.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	74,900	4.550	340,795.000	
アメリカ・ドル 小計				3,362,585,021.410 (505,127,521,916)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	383,106	25.315	9,698,328.390	
	HALEON PLC	478,287	3.743	1,790,228.240	
	WISE PLC CLASS A	41,324	8.820	364,477.680	
	BP PLC	998,128	3.846	3,839,299.350	
	UNILEVER PLC	153,476	47.010	7,214,906.760	
	BARCLAYS PLC	894,022	2.638	2,358,430.030	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	525,954	5.586	2,937,979.040	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	139,100	3.827	532,335.700	
	PRUDENTIAL PLC	166,101	6.418	1,066,036.210	
	NATWEST GROUP PLC	439,038	4.027	1,768,006.020	
	BAE SYSTEMS PLC	186,884	12.270	2,293,066.680	
	AVIVA PLC	165,520	4.837	800,620.240	
	GSK	256,394	13.350	3,422,859.900	
	INFORMA PLC	82,266	8.566	704,690.550	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	79,673	5.744	457,641.710	
	AUTO TRADER GROUP PLC	54,168	8.390	454,469.520	
	DCC PLC	6,000	57.250	343,500.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,537	71.700	325,302.900	
	HALMA PLC	23,492	27.080	636,163.360	

ENTAIN PLC	37,644	8.056	303,260.060	
JD SPORTS FASHION PLC	157,238	1.018	160,068.280	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,485	5.140	223,512.900	
M&G PLC	140,210	1.982	277,896.220	
ENDEAVOUR MINING PLC	11,149	15.440	172,140.560	
RELX PLC	115,161	37.050	4,266,715.050	
DIAGEO PLC	137,617	23.525	3,237,439.920	
RIO TINTO PLC	69,763	49.365	3,443,850.490	
STANDARD CHARTERED PLC	129,547	9.724	1,259,715.020	
TESCO PLC	423,328	3.664	1,551,073.790	
SMITH & NEPHEW PLC	54,049	9.970	538,868.530	
GLENCORE PLC	641,359	3.799	2,436,843.520	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,583	10.935	236,010.100	
SMITHS GROUP PLC	21,328	17.710	377,718.880	
PEARSON PLC	36,465	12.330	449,613.450	
SAINSBURY (J) PLC	110,288	2.612	288,072.250	
NEXT PLC	7,260	100.800	731,808.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	219,530	1.310	287,584.300	
WHITBREAD PLC	11,175	28.500	318,487.500	
BUNZL PLC	20,780	35.580	739,352.400	
VODAFONE GROUP PLC	1,369,469	0.708	970,679.620	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,048	34.500	277,656.000	
KINGFISHER PLC	111,437	2.475	275,806.570	
WPP PLC	66,707	8.592	573,146.540	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	41,285	11.195	462,185.570	
SEVERN TRENT PLC	16,741	26.970	451,504.770	
RENTOKIL INITIAL PLC	156,167	3.938	614,985.640	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	42,667	48.600	2,073,616.200	
SCHRODERS PLC	50,139	3.152	158,038.120	
SSE PLC	68,310	17.715	1,210,111.650	
BARRATT REDROW PLC	83,251	4.277	356,064.520	
ASTRAZENECA PLC	95,878	106.120	10,174,573.360	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	360,719	2.213	798,271.140	
3I GROUP PLC	60,243	37.090	2,234,412.870	
ASHTEAD GROUP PLC	27,078	62.900	1,703,206.200	
SAGE GROUP PLC/THE	62,153	13.120	815,447.360	
NATIONAL GRID PLC	302,654	9.926	3,004,143.600	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,778,874	0.530	2,005,070.540	
IMPERIAL BRANDS PLC	49,174	25.690	1,263,280.060	

	CENTRICA PLC	317,757	1.274	404,822.410	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	6,307	41.480	261,614.360	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	123,236	29.880	3,682,291.680	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,360	21.980	447,512.800	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,123,966	7.327	8,235,298.880	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,545	25.205	1,979,726.720	
	MONDI PLC	27,400	11.905	326,197.000	
	COMPASS GROUP PLC	104,878	26.910	2,822,266.980	
	PERSIMMON PLC	19,842	12.580	249,612.360	
	BT GROUP PLC	400,162	1.593	637,458.060	
	COCA-COLA HBC AG-DI	13,456	28.040	377,306.240	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,766	98.000	957,068.000	
	INTERTEK GROUP PLC	9,770	47.160	460,753.200	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,546	112.700	3,329,834.200	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,116	19.240	194,631.840	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,763	25.630	404,005.690	
	ANTOFAGASTA PLC	23,883	17.025	406,608.070	
	EXPERIAN PLC	56,849	37.510	2,132,405.990	
イギリス・ポンド 小計				119,039,988.310 (22,700,925,771)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	83,833	24.400	2,045,525.200	
	AZRIELI GROUP LTD	2,916	293.100	854,679.600	
	ICL GROUP LTD	52,523	16.530	868,205.190	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,818	903.900	1,643,290.200	
	BANK HAPOALIM BM	85,712	42.920	3,678,759.040	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	102,278	42.400	4,336,587.200	
	NICE LTD	4,254	667.000	2,837,418.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,481	159.800	1,674,863.800	
イスラエル・シュケル 小計				17,939,328.230 (742,385,014)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	130,838	5.180	677,740.840	
	TELSTRA GROUP LTD	243,639	3.940	959,937.660	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	179,129	31.170	5,583,450.930	
	SGH LTD	11,606	49.510	574,613.060	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	161,885	3.820	618,400.700	
	BHP GROUP LTD	305,712	40.570	12,402,735.840	
	SOUTH32 LTD	272,748	3.720	1,014,622.560	

	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	114,396	24.510	2,803,845.960	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,972	18.990	1,936,448.280	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	185,047	39.100	7,235,337.700	
	WESTPAC BANKING CORP	206,888	33.360	6,901,783.680	
	SANTOS LTD	195,603	6.610	1,292,935.830	
	RIO TINTO LTD	22,336	118.240	2,641,008.640	
	ORIGIN ENERGY LTD	103,789	10.870	1,128,186.430	
	XERO LTD	8,695	173.850	1,511,625.750	
	PRO MEDICUS LTD	3,466	251.890	873,050.740	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,391	34.800	500,806.800	
	COLES GROUP LTD	80,744	18.590	1,501,030.960	
	WISETECH GLOBAL LTD	11,166	128.100	1,430,364.600	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	69,302	17.510	1,213,478.020	
	REECE LTD	13,293	25.740	342,161.820	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	92,025	4.370	402,149.250	
	SEEK LTD	20,978	26.120	547,945.360	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	49,025	11.330	555,453.250	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	100,813	158.580	15,986,925.540	
	ORICA LTD	29,452	18.110	533,375.720	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	90,688	20.000	1,813,760.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	73,541	30.180	2,219,467.380	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	8.770	388,791.640	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	25,870	56.210	1,454,152.700	
	MACQUARIE GROUP LTD	21,855	231.110	5,050,909.050	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,067	67.750	2,308,039.250	
	CSL LTD	29,205	282.220	8,242,235.100	
	WESFARMERS LTD	68,356	71.830	4,910,011.480	
	COCHLEAR LTD	3,939	304.240	1,198,401.360	
	BLUESCOPE STEEL LTD	26,558	22.130	587,728.540	
	SUNCORP GROUP LTD	76,617	19.700	1,509,354.900	
	ASX LTD	11,659	66.060	770,193.540	
	COMPUTERSHARE LTD	31,960	31.890	1,019,204.400	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	142,734	8.530	1,217,521.020	
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,610	28.570	788,817.700	
	BRAMBLES LTD	83,864	19.030	1,595,931.920	
	CARSALES.COM LTD	22,876	41.500	949,354.000	
	MINERAL RESOURCES LTD	10,688	33.630	359,437.440	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,801	39.590	427,611.590	
	REA GROUP LTD	3,200	251.530	804,896.000	

オーストラリア・ドル 小計				108,785,234.930 (10,614,175,372)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	44,400	81.910	3,636,804.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	20,881	80.310	1,676,953.110	
	IMPERIAL OIL LTD	10,800	103.690	1,119,852.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,200	4,734.160	5,680,992.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	18,087	97.510	1,763,663.370	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,600	87.120	2,317,392.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,450	266.670	2,786,701.500	
	BCE INC	4,130	37.900	156,527.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,300	171.440	1,937,272.000	
	SUNCOR ENERGY INC	73,830	55.710	4,113,069.300	
	METRO INC/CN	12,300	91.230	1,122,129.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	20,000	138.710	2,774,200.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	72,600	79.850	5,797,110.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	55,300	90.880	5,025,664.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	102,500	79.230	8,121,075.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	16,500	50.410	831,765.000	
	MEG ENERGY CORP	15,100	25.200	380,520.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	82,950	176.160	14,612,472.000	
	TOURMALINE OIL CORP	20,900	66.080	1,381,072.000	
	TC ENERGY CORP	60,850	68.260	4,153,621.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	34,029	57.680	1,962,792.720	
	BARRICK GOLD CORP	102,700	24.520	2,518,204.000	
	CAE INC	18,800	32.910	618,708.000	
	THOMSON REUTERS CORP	9,241	228.440	2,111,014.040	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,600	41.980	319,048.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,200	137.520	440,064.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,850	77.610	686,848.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	23,900	29.700	709,830.000	
	HYDRO ONE LTD	19,400	45.790	888,326.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,960	181.700	1,628,032.000	
	STANTEC INC	6,600	121.270	800,382.000	
	WSP GLOBAL INC	7,700	248.970	1,917,069.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,900	115.000	563,500.000	
	PARKLAND CORP	8,300	36.150	300,045.000	
	QUEBECOR INC -CL B	9,200	33.060	304,152.000	

EMERA INC	17,000	53.420	908,140.000	
TFI INTERNATIONAL INC	4,800	213.170	1,023,216.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,500	35.940	269,550.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	21,100	50.000	1,055,000.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	44,400	18.850	836,940.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	29,517	118.060	3,484,777.020	
AIR CANADA	10,200	24.960	254,592.000	
KINROSS GOLD CORP	72,100	13.710	988,491.000	
BANK OF MONTREAL	42,800	133.500	5,713,800.000	
POWER CORP OF CANADA	33,000	47.160	1,556,280.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	71,100	161.840	11,506,824.000	
NUTRIEN LTD	29,019	65.400	1,897,842.600	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	8,000	44.620	356,960.000	
CAMECO CORP	25,600	83.850	2,146,560.000	
FIRSTSERVICE CORP	2,400	273.120	655,488.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,500	66.410	896,535.000	
TELUS CORP	10,800	21.800	235,440.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	26,700	65.370	1,745,379.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,100	154.370	478,547.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	123,800	47.520	5,882,976.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	1,986.300	2,582,190.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,700	63.630	998,991.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,537	225.050	796,001.850	
PAN AMERICAN SILVER CORP	21,400	31.060	664,684.000	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,100	165.100	842,010.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,900	86.170	2,921,163.000	
ENBRIDGE INC	127,700	60.570	7,734,789.000	
BROOKFIELD CORP	80,225	86.040	6,902,559.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	102,900	45.070	4,637,703.000	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	54,720	107.110	5,861,059.200	
IA FINANCIAL CORP INC	5,400	133.830	722,682.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	69.600	577,680.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,350	156.340	4,901,259.000	
CGI INC - CLASS A	12,000	158.480	1,901,760.000	
ONEX CORPORATION	3,600	113.890	410,004.000	
IGM FINANCIAL INC	4,700	47.310	222,357.000	
TMX GROUP LTD	16,400	44.270	726,028.000	
OPEN TEXT CORP	15,400	42.640	656,656.000	
SAPUTO INC	15,000	26.100	391,500.000	

	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,700	19.130	778,591.000	
	FORTIS INC	29,100	62.590	1,821,369.000	
	RB GLOBAL INC	10,800	138.340	1,494,072.000	
	LUNDIN MINING CORP	38,900	13.740	534,486.000	
	CENOVUS ENERGY INC	79,700	22.180	1,767,746.000	
	DOLLARAMA INC	16,500	145.840	2,406,360.000	
	ALTAGAS LTD	17,600	34.240	602,624.000	
	KEYERA CORP	13,500	46.170	623,295.000	
	ARC RESOURCES LTD	34,200	25.810	882,702.000	
カナダ・ドル 小計				182,412,528.210 (19,527,261,145)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	158,800	2.730	433,524.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	85,800	36.360	3,119,688.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	135,140	42.430	5,733,990.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,975	6.310	637,152.250	
	KEPPEL CORP LTD	98,800	6.730	664,924.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	175,200	2.410	422,232.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	229,600	16.280	3,737,888.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	410,000	0.765	313,650.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	503,950	3.100	1,562,245.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	105,900	4.500	476,550.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	60,600	5.220	316,332.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	58,200	12.720	740,304.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,300	3.080	401,324.000	
シンガポール・ドル 小計				18,559,803.450 (2,076,656,408)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	24,336	40.140	976,847.040	
	GALDERMA GROUP N AG	3,485	90.250	314,521.250	
	AVOLTA AG	5,344	32.560	174,000.640	
	UBS GROUP AG-REG	195,634	28.480	5,571,656.320	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,953	270.800	528,872.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	398	626.500	249,347.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,081	23.500	236,903.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	41,826	255.500	10,686,543.000	
	SIKA AG-REG	9,038	228.100	2,061,567.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	100,000.000	700,000.000	
	ABB LTD-REG	94,086	50.280	4,730,644.080	
	SWISS RE AG	17,985	130.150	2,340,747.750	

	NESTLE SA-REG	155,813	76.480	11,916,578.240	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,313	1,280.000	1,680,640.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,459	254.400	625,569.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,239	58.300	713,533.700	
	SGS SA-REG	8,915	87.480	779,884.200	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,361	249.500	339,569.500	
	TEMENOS AG - REG	3,332	57.850	192,756.200	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,158	154.400	333,195.200	
	VAT GROUP AG	1,568	351.400	550,995.200	
	BKW AG	1,274	151.400	192,883.600	
	ALCON INC	29,765	78.380	2,332,980.700	
	SIG GROUP N AG	17,784	17.420	309,797.280	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,680	159.950	268,716.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,683	558.600	4,850,323.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	167.400	439,257.600	
	CLARIANT AG-REG	12,962	10.610	137,526.820	
	NOVARTIS AG-REG	117,237	93.270	10,934,694.990	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	1,344.000	284,928.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,976	68.100	134,565.600	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	31,964	122.700	3,921,982.800	
	SWISSCOM AG-REG	1,501	508.500	763,258.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,706	87.450	149,189.700	
	GEBERIT AG-REG	2,037	530.400	1,080,424.800	
	GIVAUDAN-REG	532	3,881.000	2,064,692.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,672	114.650	764,944.800	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,042	300.800	915,033.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,027	71.500	645,430.500	
	LONZA GROUP AG-REG	4,286	526.400	2,256,150.400	
	HOLCIM LTD	31,012	89.740	2,783,016.880	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,665	721.800	1,201,797.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,908	210.600	612,424.800	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,478	97.350	435,933.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	10,180.000	600,620.000	
スイス・フラン 小計				83,784,946.090 (14,250,981,480)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	14,863	241.600	3,590,900.800	
	ERICSSON LM-B SHS	188,367	88.680	16,704,385.560	
	VOLVO AB-B SHS	107,747	271.600	29,264,085.200	

	SKF AB-B SHARES	23,083	209.500	4,835,888.500	
	TELE2 AB-B SHS	37,061	114.450	4,241,631.450	
	GETINGE AB-B SHS	15,558	170.450	2,651,861.100	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	107,545	151.500	16,293,067.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	98,755	113.500	11,208,692.500	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,604	213.800	12,315,735.200	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,431	151.250	5,812,688.750	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	41,123	141.700	5,827,129.100	
	SKANSKA AB-B SHS	23,045	227.500	5,242,737.500	
	SANDVIK AB	72,305	201.700	14,583,918.500	
	INVESTOR AB-B SHS	117,358	299.250	35,119,381.500	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	182,109	174.150	31,714,282.350	
	VOLVO AB-A SHS	13,595	273.000	3,711,435.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,187	410.800	2,130,819.600	
	SECURITAS AB-B SHS	33,354	137.950	4,601,184.300	
	TELIA CO AB	159,946	31.950	5,110,274.700	
	ALFA LAVAL AB	19,616	464.300	9,107,708.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	105,851	154.100	16,311,639.100	
	ASSA ABLOY AB-B	67,924	334.900	22,747,747.600	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,434	360.600	5,204,900.400	
	SAAB AB-B	21,739	238.850	5,192,360.150	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,245	358.200	2,953,359.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	44,935	83.920	3,770,945.200	
	INDUTRADE AB	18,567	278.400	5,169,052.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,243	302.400	4,004,683.200	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,174	529.000	2,737,046.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,085	277.000	2,793,545.000	
	LIFCO AB-B SHS	15,838	331.000	5,242,378.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	102,777	46.220	4,750,352.940	
	BEIJER REF AB	26,093	172.000	4,487,996.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	41,334	300.200	12,408,466.800	
	BOLIDEN AB	18,584	325.400	6,047,233.600	
	EPIROC AB-A	44,685	198.750	8,881,143.750	
	EPIROC AB-B	26,397	179.900	4,748,820.300	
	EQT AB	25,224	330.500	8,336,532.000	
	EVOLUTION AB	11,473	952.000	10,922,296.000	
	HEXAGON AB-B SHS	140,739	92.940	13,080,282.660	
	ADDTECH AB-B SHARES	17,593	300.000	5,277,900.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	357.500	3,882,092.500	

スウェーデン・クローナ 小計				383,018,580.910 (5,262,675,302)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	213,987	757.300	162,052,355.100	
	DANSKE BANK A/S	46,742	202.700	9,474,603.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	187	11,570.000	2,163,590.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68,428	109.700	7,506,551.600	
	CARLSBERG AS-B	6,514	726.800	4,734,375.200	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	23,918	413.700	9,894,876.600	
	COLOPLAST-B	8,571	889.400	7,623,047.400	
	DSV PANALPINA A/S	13,856	1,507.000	20,880,992.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	599	2,574.000	1,541,826.000	
	DEMANT A/S	6,039	269.200	1,625,698.800	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	301	11,975.000	3,604,475.000	
	TRYG A/S	22,999	162.600	3,739,637.400	
	PANDORA A/S	5,558	1,136.500	6,316,667.000	
	GENMAB A/S	4,267	1,526.000	6,511,442.000	
	ZEALAND PHARMA A/S	4,339	730.000	3,167,470.000	
	ORSTED A/S	11,406	391.800	4,468,870.800	
デンマーク・クローネ 小計				255,306,478.300 (5,415,050,405)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	88,421	6.210	549,094.410	
	MERCURY NZ LTD	47,473	6.620	314,271.260	
	INFRATIL LTD	62,300	12.850	800,555.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	102,597	7.760	796,152.720	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,694	38.050	1,510,356.700	
ニュージーランド・ドル 小計				3,970,430.090 (351,819,810)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	60,750	230.700	14,015,025.000	
	NORSK HYDRO ASA	95,339	68.300	6,511,653.700	
	ORKLA ASA	47,532	101.900	4,843,510.800	
	TELENOR ASA	41,757	130.000	5,428,410.000	
	EQUINOR ASA	56,779	267.200	15,171,348.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,226	310.600	3,486,795.600	
	MOWI ASA	31,524	200.400	6,317,409.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,578	196.400	2,666,719.200	
	AKER BP ASA	21,464	226.400	4,859,449.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,949	1,299.000	7,727,751.000	

	SALMAR ASA	4,513	574.000	2,590,462.000	
ノルウェー・クローネ 小計				73,618,535.300 (998,267,339)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	51,857	22.810	1,182,858.170	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,125	35.800	1,114,275.000	
	EXOR NV	6,288	93.650	588,871.200	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,168	59.080	423,485.440	
	DSM FIRMENICH AG	11,673	103.950	1,213,408.350	
	FERROVIAL	29,720	39.020	1,159,674.400	
	LOTUS BAKERIES NV	25	11,380.000	284,500.000	
	SYENSQO SA	4,547	70.260	319,472.220	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	14,400	23.170	333,648.000	
	BAYER AG-REG	61,899	19.388	1,200,097.810	
	EVONIK INDUSTRIES AG	15,701	17.365	272,647.860	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	119,323	16.074	1,917,997.900	
	COMMERZBANK AG	59,422	14.525	863,104.550	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,012	80.720	1,050,328.640	
	SIEMENS AG-REG	47,898	183.160	8,772,997.680	
	E.ON SE	141,342	12.185	1,722,252.270	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,111	70.020	1,268,132.220	
	GEA GROUP AG	9,811	47.320	464,256.520	
	CONTINENTAL AG	6,941	62.040	430,619.640	
	BASF SE	56,200	42.420	2,384,004.000	
	ALLIANZ SE-REG	24,668	292.200	7,207,989.600	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	10,655	80.760	860,497.800	
	RHEINMETALL AG	2,761	622.400	1,718,446.400	
	RWE AG	39,781	31.870	1,267,820.470	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,885	6.336	240,039.360	
	BRENNTAG SE	7,967	61.000	485,987.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	26,647	33.270	886,545.690	
	SAP SE	65,778	224.900	14,793,472.200	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,384	494.300	4,144,211.200	
	ZALANDO SE	14,145	29.420	416,145.900	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,557	119.400	1,021,705.800	
	COVESTRO AG	11,566	57.720	667,589.520	
	RATIONAL AG	306	885.000	270,810.000	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	83.550	317,490.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,607	217.800	350,004.600	

TALANX AG	3,951	80.200	316,870.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,387	34.620	324,977.940	
DELIVERY HERO SE	11,722	38.740	454,110.280	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,594	56.550	146,690.700	
BECHTLE AG	5,223	31.100	162,435.300	
NEMETSCHEK SE	3,634	98.200	356,858.800	
SCOUT24 AG	4,599	85.050	391,144.950	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,757	51.320	911,289.240	
KNORR-BREMSE AG	4,442	72.150	320,490.300	
SIEMENS ENERGY AG	40,302	51.020	2,056,208.040	
BEIERSDORF AG	6,274	122.650	769,506.100	
MERCK KGAA	8,107	141.600	1,147,951.200	
ADIDAS AG	10,212	223.100	2,278,297.200	
PUMA SE	6,466	44.300	286,443.800	
HENKEL AG & CO KGAA	6,571	71.850	472,126.350	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	219,851	30.280	6,657,088.280	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	12,965	41.600	539,344.000	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,136	52.960	2,496,322.560	
QIAGEN N.V.	13,970	41.385	578,148.450	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,194	30.815	2,532,808.110	
HANNOVER RUECK SE	3,790	247.100	936,509.000	
DHL GROUP	64,185	34.770	2,231,712.450	
DEUTSCHE BOERSE AG	11,825	221.500	2,619,237.500	
MTU AERO ENGINES AG	3,393	322.200	1,093,224.600	
SYMRISE AG	8,328	104.500	870,276.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,505	64.500	226,072.500	
VONOVIA SE	46,599	31.400	1,463,208.600	
LEG IMMOBILIEN SE	4,566	87.740	400,620.840	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	50,277	25.790	1,296,643.830	
NN GROUP NV	17,062	43.970	750,216.140	
ARCELORMITTAL	29,514	23.840	703,613.760	
HEINEKEN NV	18,115	70.060	1,269,136.900	
AEGON LTD	85,054	6.102	518,999.500	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	58,511	32.650	1,910,384.150	
AKZO NOBEL N.V.	10,737	55.300	593,756.100	
WOLTERS KLUWER	14,999	157.950	2,369,092.050	
ING GROEP NV	207,983	14.658	3,048,614.810	
KONINKLIJKE KPN NV	241,485	3.671	886,491.430	
ASML HOLDING NV	25,150	658.400	16,558,760.000	

ABN AMRO BANK NV-CVA	28,945	14.715	425,925.670	
IMCD NV	3,592	142.100	510,423.200	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,713	113.000	532,569.000	
ASR NEDERLAND NV	10,012	45.300	453,543.600	
ADYEN NV	1,328	1,378.400	1,830,515.200	
PROSUS NV	85,918	38.550	3,312,138.900	
JDE PEET'S NV	7,685	18.870	145,015.950	
INPOST SA	14,300	16.580	237,094.000	
ASM INTERNATIONAL NV	2,974	511.400	1,520,903.600	
RANDSTAD NV	6,852	41.610	285,111.720	
HEINEKEN HOLDING NV	8,128	60.000	487,680.000	
TOTALENERGIES SE	135,905	54.970	7,470,697.850	
MICHELIN (CGDE)	42,054	30.750	1,293,160.500	
AIR LIQUIDE SA	36,365	157.280	5,719,487.200	
KERING	4,655	220.750	1,027,591.250	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,449	243.500	8,388,331.500	
BOUYGUES SA	11,619	28.160	327,191.040	
BNP PARIBAS	64,063	56.640	3,628,528.320	
THALES SA	5,789	141.500	819,143.500	
DANONE	40,692	64.660	2,631,144.720	
CARREFOUR SA	34,145	14.400	491,688.000	
VIVENDI	44,106	8.690	383,281.140	
L'OREAL	15,118	328.650	4,968,530.700	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	28,554	86.340	2,465,352.360	
LEGRAND SA	16,540	94.880	1,569,315.200	
PERNOD RICARD SA	12,803	105.900	1,355,837.700	
EURAZEO SE	2,599	69.550	180,760.450	
REXEL SA	14,143	24.440	345,654.920	
SOCIETE GENERALE SA	45,311	25.095	1,137,079.540	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,330	592.500	10,268,025.000	
ACCOR SA	12,225	43.680	533,988.000	
CAPGEMINI SE	9,805	151.900	1,489,379.500	
PUBLICIS GROUPE	14,406	102.700	1,479,496.200	
BUREAU VERITAS SA	20,039	28.800	577,123.200	
EIFFAGE	4,669	85.400	398,732.600	
SODEXO SA	5,616	78.600	441,417.600	
IPSEN	2,311	109.400	252,823.400	
AMUNDI SA	3,852	61.650	237,475.800	
TELEPERFORMANCE	3,431	89.020	305,427.620	

EURONEXT NV	4,921	105.700	520,149.700	
EUROFINS SCIENTIFIC	8,265	46.790	386,719.350	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,790	180.350	322,826.500	
SEB SA	1,488	89.800	133,622.400	
ESSILORLUXOTTICA	18,689	229.800	4,294,732.200	
DASSAULT AVIATION SA	1,289	188.400	242,847.600	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	6,098	37.400	228,065.200	
AXA SA	110,566	32.980	3,646,466.680	
EDENRED	15,273	31.300	478,044.900	
RENAULT SA	12,080	40.530	489,602.400	
HERMES INTERNATIONAL	2,041	2,065.000	4,214,665.000	
STMICROELECTRONICS NV	43,022	24.270	1,044,143.940	
DASSAULT SYSTEMES SE	42,143	32.650	1,375,968.950	
ORANGE	117,209	10.085	1,182,052.760	
ALSTOM	21,803	21.290	464,185.870	
SANOFI	71,927	92.090	6,623,757.430	
VINCI SA	31,507	99.860	3,146,289.020	
AIRBUS SE	37,456	147.560	5,527,007.360	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,401	27.570	1,224,135.570	
CREDIT AGRICOLE SA	67,084	12.670	849,954.280	
BIOMERIEUX	2,542	98.850	251,276.700	
ENGIE	115,034	15.085	1,735,287.890	
SAFRAN SA	23,010	220.500	5,073,705.000	
ARKEMA	3,434	75.000	257,550.000	
ADP	2,122	109.500	232,359.000	
GETLINK SE	19,144	15.465	296,061.960	
BOLLORE	43,698	5.835	254,977.830	
UCB SA	7,939	185.350	1,471,493.650	
KBC GROUP NV	14,445	68.240	985,726.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,201	65.450	340,405.450	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,575	50.940	2,881,930.500	
AGEAS	10,078	47.760	481,325.280	
D'IETEREN GROUP	1,322	201.800	266,779.600	
ELIA GROUP SA/NV	1,802	88.650	159,747.300	
SOFINA	931	219.600	204,447.600	
ARGENX SE	3,739	586.400	2,192,549.600	
PRYSMIAN SPA	17,730	62.420	1,106,706.600	
GENERALI	58,894	27.080	1,594,849.520	
MEDIOBANCA SPA	31,488	13.805	434,691.840	

TENARIS SA	25,343	18.160	460,228.880	
UNICREDIT SPA	92,732	36.385	3,374,053.820	
UNIPOL GRUPPO SPA	26,800	11.420	306,056.000	
TELECOM ITALIA SPA	612,014	0.227	139,110.780	
INTESA SANPAOLO	921,048	3.627	3,340,641.090	
POSTE ITALIANE SPA	28,013	13.285	372,152.700	
MONCLER SPA	14,751	46.350	683,708.850	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,409	51.550	330,383.950	
ENI SPA	144,794	13.406	1,941,108.360	
BPER BANCA	67,500	5.778	390,015.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	38,820	5.678	220,419.960	
BANCO BPM SPA	81,084	7.204	584,129.130	
DIASORIN SPA	1,344	105.800	142,195.200	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	20,601	9.750	200,859.750	
NEXI SPA	32,152	5.604	180,179.800	
AMPLIFON SPA	7,824	24.030	188,010.720	
LEONARDO SPA	25,455	25.470	648,338.850	
ENEL SPA	512,156	6.810	3,487,782.360	
SNAM SPA	126,955	4.412	560,125.460	
TERNA SPA	88,571	8.008	709,276.560	
FINECOBANK SPA	38,474	15.190	584,420.060	
STELLANTIS NV	122,988	12.536	1,541,777.560	
FERRARI NV	7,916	411.700	3,259,017.200	
TELEFONICA SA	249,904	4.286	1,071,088.540	
ENDESA SA	19,465	20.740	403,704.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	362,894	8.936	3,242,820.780	
IBERDROLA SA	380,468	13.490	5,132,513.320	
BANCO DE SABADELL SA	342,595	1.785	611,703.370	
REPSOL SA	74,479	11.825	880,714.170	
GRIFOLS SA	18,913	8.616	162,954.400	
BANCO SANTANDER SA	975,665	4.375	4,269,022.200	
AMADEUS IT GROUP SA	28,359	66.420	1,883,604.780	
CAIXABANK SA	253,450	5.146	1,304,253.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,247	43.960	494,418.120	
AENA SME SA	4,688	204.800	960,102.400	
CELLNEX TELECOM SA	33,399	33.980	1,134,898.020	
ACCIONA SA	1,472	120.300	177,081.600	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	68,731	52.180	3,586,383.580	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	24,877	16.900	420,421.300	

	UPM-KYMMENE OYJ	33,648	24.900	837,835.200	
	NOKIA OYJ	335,838	3.979	1,336,467.320	
	WARTSILA OYJ ABP	31,673	17.205	544,933.960	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	35,682	9.192	327,988.940	
	ELISA OYJ	8,714	42.880	373,656.320	
	SAMPO OYJ-A SHS	31,415	40.540	1,273,564.100	
	FORTUM OYJ	27,499	14.265	392,273.230	
	KESKO OYJ-B SHS	17,250	18.815	324,558.750	
	KONE OYJ-B	21,393	49.060	1,049,540.580	
	NESTE OYJ	25,885	14.405	372,873.420	
	ORION OYJ-CLASS B	6,816	44.720	304,811.520	
	METSO CORPORATION	38,123	8.326	317,412.090	
	NORDEA BANK ABP	198,712	10.705	2,127,211.960	
	VERBUND AG	4,249	75.500	320,799.500	
	OMV AG	9,024	37.920	342,190.080	
	ERSTE GROUP BANK AG	21,198	51.900	1,100,176.200	
	AIB GROUP PLC	117,515	5.150	605,202.250	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	62,250	8.288	515,928.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,753	71.200	694,413.600	
	JERONIMO MARTINS	17,354	18.440	320,007.760	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	197,570	3.422	676,084.540	
	GALP ENERGIA SGPS SA	29,235	15.535	454,165.720	
	EDP RENOVAVEIS SA	18,553	11.080	205,567.240	
	KERRY GROUP PLC-A	9,656	91.450	883,041.200	
ユーロ 小計				316,186,144.150 (50,039,619,173)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	94,000	51.000	4,794,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	34.550	5,147,950.000	
	MTR CORP	106,000	27.250	2,888,500.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	98,500	77.250	7,609,125.000	
	SINO LAND CO	264,000	7.620	2,011,680.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	182,169	40.500	7,377,844.500	
	WHARF HOLDINGS LTD	73,000	21.350	1,558,550.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	28,000	64.050	1,793,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	111,500	65.300	7,280,950.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	98,507	24.400	2,403,570.800	
	HONG KONG & CHINA GAS	759,475	5.900	4,480,902.500	
	HANG SENG BANK LTD	51,100	92.450	4,724,195.000	
	WH GROUP LTD	565,500	6.170	3,489,135.000	

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,700	289.800	23,676,660.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	130,669	31.800	4,155,274.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	43,000	53.600	2,304,800.000	
	AIA GROUP LTD	741,400	58.150	43,112,410.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	92,000	20.250	1,863,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	114,000	20.850	2,376,900.000	
	SANDS CHINA LTD	164,800	19.840	3,269,632.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	93,500	109.600	10,247,600.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	251,000	23.900	5,998,900.000	
香港・ドル 小計				152,564,979.000 (2,944,504,095)	
合計				640,051,843,230 [640,051,843,230]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,237	2,173,927.950	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	21,007	3,856,885.200	
		BXP INC	9,700	795,303.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,000	1,583,750.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,000	1,686,520.000	
		EQUINIX INC	6,108	5,994,879.840	
		AMERICAN TOWER CORP	30,100	6,290,900.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	45,243	833,376.060	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	21,200	811,748.000	
		KIMCO REALTY CORP	43,400	1,109,738.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,700	913,497.000	
		INVITATION HOMES INC	37,400	1,280,950.000	
		VICI PROPERTIES INC	67,400	2,197,914.000	
		VENTAS INC	26,800	1,717,076.000	
		WEYERHAEUSER CO	46,814	1,510,219.640	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,000	2,975,000.000	
		IRON MOUNTAIN INC	18,900	2,337,363.000	
		SUN COMMUNITIES INC	8,100	1,023,273.000	
		PROLOGIS INC	59,654	6,966,394.120	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,200	1,124,346.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,900	868,020.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,200	1,303,932.000	

	WELLTOWER INC	39,900	5,513,382.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,000	989,550.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,600	1,247,616.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,500	820,295.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	34,800	693,564.000	
	REALTY INCOME CORP	56,095	3,247,339.550	
	PUBLIC STORAGE	10,200	3,550,110.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,000	831,490.000	
	UDR INC	20,200	926,372.000	
	WP CAREY INC	14,100	804,546.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,100	4,129,059.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,700	2,342,152.000	
アメリカ・ドル 小計			74,450,488.360 (11,183,952,361)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	43,890	264,656.700	
	SEGRO PLC	79,485	619,983.000	
イギリス・ポンド 小計			884,639.700 (168,700,791)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	187,089	2,394,739.200	
	APA GROUP	78,315	565,434.300	
	SCENTRE GROUP	313,440	1,153,459.200	
	GPT GROUP	112,602	535,985.520	
	MIRVAC GROUP	238,518	515,198.880	
	STOCKLAND	144,307	753,282.540	
	GOODMAN GROUP	103,698	3,931,191.180	
	VICINITY CENTRES	227,463	491,320.080	
オーストラリア・ドル 小計			10,340,610.900 (1,008,933,406)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,800	220,080.000	
カナダ・ドル 小計			220,080.000 (23,559,564)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	253,500	664,170.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	395,270	774,729.200	

	シンガポール・ドル 小計			1,438,899.200 (160,998,431)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,457	578,364.920	
		GECINA SA	2,908	277,277.800	
		KLEPIERRE	13,182	377,268.840	
		COVIVIO	3,349	174,148.000	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,363	237,713.960	
	ユーロ 小計			1,644,773.520 (260,301,857)	
	香港・ドル	LINK REIT	174,700	5,913,595.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	257,000	2,485,190.000	
	香港・ドル 小計			8,398,785.000 (162,096,551)	
投資証券 合計				12,968,542,961 [12,968,542,961]	
合計				12,968,542,961 [12,968,542,961]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 570銘柄 投資証券 34銘柄	97.8%	2.2%	79.0%
イギリス・ポンド	株式 76銘柄 投資証券 2銘柄	99.3%	0.7%	3.5%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 46銘柄 投資証券 8銘柄	91.3%	8.7%	1.8%
カナダ・ドル	株式 83銘柄 投資証券 1銘柄	99.9%	0.1%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄 株式 13銘柄	92.8%	7.2%	0.3%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	2.2%

スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	100%	-%	0.8%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100%	-%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 215銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	7.7%
香港・ドル	投資証券 2銘柄 株式 22銘柄	94.8%	5.2%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	20,965,778,818円
Ⅱ	負債総額	14,641,172円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,951,137,646円
Ⅳ	発行済数量	7,343,246,744口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8531円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

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

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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(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。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2024年12月末日現在

資本金の額　　414億2,454万1,896円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　326万657株

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

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

CI0が議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

３【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第65期事業年度（2023年４月１日から2024年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第66期事業年度に係る中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）		当事業年度 （2024年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,982		4,813
有価証券		346		503
前払費用		393		481
未収委託者報酬		12,525		16,513
未収収益		47		78
関係会社短期貸付金		22,100		23,400
その他		59		88
流動資産計		37,455		45,878
固定資産				
有形固定資産	※1	196	※1	176
建物		3		2
器具備品		193		174
無形固定資産		1,482		1,342
ソフトウェア		1,351		1,063
ソフトウェア仮勘定		131		279
投資その他の資産		13,824		13,660

投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180
資産合計	52,959	61,058

（単位:百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）		当事業年度 （2024年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		101		158
未払金		5,874		6,187
未払収益分配金		38		39
未払償還金		12		12
未払手数料		4,525		5,849
その他未払金	※2	1,297	※2	285
未払費用		3,987		5,035
未払法人税等		560		3,842
未払消費税等		327		872
賞与引当金		692		1,048
その他		2		1
流動負債計		11,545		17,146
固定負債				
退職給付引当金		2,276		2,227
役員退職慰労引当金		51		62
その他		0		-
固定負債計		2,329		2,289
負債合計		13,874		19,435
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048

福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

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

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

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社項目

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

	前事業年度 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
未払金	1,178百万円	236百万円

３　保証債務

前事業年度（2023年３月31日）

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

当事業年度（2024年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年６月26日定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年３月31日	2023年６月27日

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

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

①剰余金の配当の総額	11,858百万円
②配当の原資	利益剰余金
③１株当たり配当額	4,546円
④基準日	2024年３月31日
⑤効力発生日	2024年６月20日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ⅰ）為替変動リスクの管理

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

（ⅱ）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（2023年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

当事業年度（2024年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	―	8,285
資産合計	144	8,141	―	8,285

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2023年３月31日）

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

当事業年度（2024年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2023年３月31日）

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

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

当事業年度（2024年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	144	55	89
（２）その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	△213
小計	1,543	1,756	△213
合計	8,285	6,079	2,205

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

４．減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度184百万円、当事業年度187百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262

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

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

前事業年度（2023年３月31日）

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

当事業年度（2024年３月31日）

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				

親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	17,100 0	関係会社短期貸付金 -	22,100 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	2,354	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 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・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

（注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,317	11,859
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

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

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

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

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

その他	1,095
投資その他の資産合計	14,924
固定資産合計	16,211
資産合計	58,128

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2024年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		6,580
未払費用		5,540
未払法人税等		4,405
賞与引当金		910
その他	※２	1,107
流動負債合計		18,545
固定負債		
退職給付引当金		2,270
役員退職慰労引当金		55
固定負債合計		2,325
負債合計		20,870
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		8,774
利益剰余金合計		9,148
株主資本合計		35,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,438
評価・換算差額等合計		1,438
純資産合計		37,257
負債・純資産合計		58,128

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

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

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		

当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,858	△11,858	△11,858
中間純利益	-	-	-	7,584	7,584	7,584
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△4,274	△4,274	△4,274
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,774	9,148	35,818

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,858
中間純利益	-	-	7,584
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△91	△91	△91
当中間期変動額合計	△91	△91	△4,365
当中間期末残高	1,438	1,438	37,257

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

５．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

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

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2024年９月30日現在）
有形固定資産	358百万円

※２　消費税等の取扱い

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

３　保証債務

当中間会計期間（2024年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

※２　営業外収益の主要項目

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

※３　営業外費用の主要項目

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

※４　特別利益の項目

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

※５　特別損失の項目

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

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （百万円）	１株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2024年６月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 ３月31日	2024年 ６月20日

（金融商品関係）
当中間会計期間（2024年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2024年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,386百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	123	55	67

（２）その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	3,756	3,988	△232
小計	3,756	3,988	△232
合計	10,594	8,520	2,073

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

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

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式　652,132株

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

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 (2024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）	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。
（注13）資産運用業務を行なっています。
（注14）資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

２【関係業務の概要】

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

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2024年５月27日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年４月１日から2024年３月31日までの第65期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表

を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年1月24日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワつみたてインデックス外国株式の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワつみたてインデックス外国株式の2024年12月2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

2024年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2024年４月１日から2025年３月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成

基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。