

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2025年2月21日提出
【計算期間】	第1計算期間 (自 2023年12月11日 至 2024年12月2日)
【ファンド名】	スタイル9(4資産分散・保守型) スタイル9(4資産分散・バランス型) スタイル9(4資産分散・積極型) スタイル9(6資産分散・保守型) スタイル9(6資産分散・バランス型) スタイル9(6資産分散・積極型) スタイル9(8資産分散・保守型) スタイル9(8資産分散・バランス型) スタイル9(8資産分散・積極型)
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	佐竹 優子
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

〈スタイル9(4資産分散・保守型/バランス型/積極型)〉

〈スタイル9(6資産分散・保守型/バランス型/積極型)〉

〈スタイル9(8資産分散・保守型/バランス型/積極型)〉

単字型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単字型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ()
	内外	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

〈スタイル9(4資産分散・保守型/バランス型/積極型)〉

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本		
不動産投信	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産 配分変更型 (株式、債券))	年6回 (隔月)	欧州		
資産複合 ()	年12回 (毎月)	アジア		
資産配分固定型 資産配分変更型	日々	オセアニア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
	その他 ()	中南米		
		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。

属性区分表

〈スタイル9（6資産分散・保守型／バランス型／積極型）〉

〈スタイル9（8資産分散・保守型／バランス型／積極型）〉

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
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		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
	年6回 (隔月)	欧州		
	年6回 (隔月)	アジア		
不動産投信		オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産 配分変更型 (株式、債券、 不動産投信))	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
	日々	アフリカ		
資産複合 ()	その他 ()	中近東 (中東)		
資産配分固定型 資産配分変更型		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。

(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、各ファンドについて3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 「スタイル9」は、投資先資産クラスと目標リスク水準が異なる9本のファンドで構成されます。

- 投資先資産クラスに応じて「4資産分散」、「6資産分散」、「8資産分散」があります。また、それぞれについて、目標リスク水準に応じて「保守型」、「バランス型」、「積極型」があります。

2 各ファンドは、複数のマザーファンドの受益証券への投資を通じて、国内外の様々な資産クラスに投資を行います。

ファンドの仕組み

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を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。



- 各マザーファンドの組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 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。

- 各マザーファンドにおいては、投資成果を以下の対象指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

[各マザーファンドの基本情報]

資産クラス	マザーファンド	対象指数
国内株式	トピックス・インデックス・マザーファンド	東証株価指数(配当込み)
国内債券	日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)
先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
国内リート	ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
海外リート	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)
新興国株式	新興国株式インデックス・マザーファンド	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)
新興国債券	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	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・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

※対象指数の内容については、後掲の「指数の概要について」をご参照下さい。

3

各ファンドにおいて、以下を目標とするリスク水準とします。

【目標リスク水準】

ファンド	保守型	バランス型	積極型
4資産分散	年率5%程度～7%程度	年率9%程度～11%程度	年率14%程度～16%程度
6資産分散			
8資産分散			

※目標とするリスク水準とは、ファンドの月次収益率の標準偏差(年率)の目安を指し、資産配分を決定する際の目標値として使用します。

※当ファンドにおける目標とするリスク水準は、市場環境において投資家が許容すると考えられるリスク水準のなかで、それぞれ相対的に「保守的」、「積極と保守の中間」または「積極的」と判断できる水準に設定しています。そのため、市場環境が大きく変動した場合、上記の目標とするリスク水準を変更する場合があります。

※実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

4

資産配分は、客観的に入手しうるデータに基づき、目標リスク水準に対してリターンが最大化するよう定量的に算出します。

5

各マザーファンドの組入比率の決定は、大和証券株式会社からの資産配分の助言に基づき行ないます。

- デリバティブ取引(法人税法第61条の5で定めるものをいいます。)は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに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以外には利用しません。

- 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～5.の運用が行なわれないことがあります。

[指数の概要について]

● 東証株価指数(TOPIX)

TOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

● ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数

ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本の債券市場のパフォーマンス・インデックスです。日本で発行されている公募の確定利付円建債のうち、残存額、残存期間などの水準により選定された債券で構成され、時価総額加重平均方式で算出されます。

● MSCIコクサイ指数

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

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

[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]

● FTSE世界国債インデックス

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

● 東証REIT指数(配当込み)

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

配当込み東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

● S&P先進国REIT指数

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

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

● MSCIエマージング・マーケット・インデックス

MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。なお、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)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、MSCI Inc.の承諾を得て委託会社が計算したものです。本ファンドは、MSCI Inc.〔MSCI〕によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。

[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]

● 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・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与える制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

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・マーケット 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.

6 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、2024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。
- 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(2) 【ファンドの沿革】

2023年12月11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1）、償還金など お申込金（ 4）
お取扱窓口	<p>販売会社</p> <p>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。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 4）
委託会社	<p>大和アセットマネジメント株式会社</p> <p>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。なお、投資顧問会社（注2）から運用にかかる助言を受けて運用を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行</p> <p>信託財産の運用指図</p> <p>信託財産の計算</p> <p>運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	損益 信託金（ 4）
2	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p> <p>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十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。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分</p> <p>信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
	損益 投資

投資対象	<p><4資産分散> 内外の株式・債券など (ファミリーファンド方式で運用します。)</p> <p><6資産分散、8資産分散> 内外の株式・債券およびリート(不動産投資信託)など (ファミリーファンド方式で運用します。)</p>
------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(注1)「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。

(注2)投資顧問会社については、次のとおりです。

名称	関係業務の内容
大和証券株式会社	委託会社との投資顧問契約(3)に基づき、委託会社に対して、信託財産の運用に関するアドバイス(投資助言)を行ないます。

- 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: 委託会社と投資顧問会社の間で締結されます。投資顧問サービスの内容および報酬、運用の責任等が規定されています。
- 4: 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 | 株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携 |

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

<各ファンド共通>

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

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

<4資産分散>

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

<6資産分散>

1. (4資産分散の1.と同規定)
2. (4資産分散の2.と同規定)
3. (4資産分散の3.と同規定)
4. (4資産分散の4.と同規定)
5. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
(東証REIT指数(配当込み))
6. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
(S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース))

<8資産分散>

1. (4資産分散の1.と同規定)
2. (4資産分散の2.と同規定)
3. (4資産分散の3.と同規定)
4. (4資産分散の4.と同規定)
5. (6資産分散の5.と同規定)

6.（6資産分散の6.と同規定）

7. 新興国株式インデックス・マザーファンドの受益証券

（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））

8. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券

（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・マーケット グローバル ダイ
バーシファイド（円換算））

投資態度

< 保守型 >

イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

ロ. 目標とするリスク水準は年率5%程度～7%程度とします。

目標とするリスク水準とは、ファンドの月次収益率の標準偏差（年率）の目途を指し、資産配分を決定する際の目標値として使用します。

当ファンドにおける目標とするリスク水準は、市場環境において投資家が許容すると考えられるリスク水準のなかで、相対的に保守的と判断できる水準に設定しています。そのため、市場環境が大きく変動した場合、上記の目標とするリスク水準を変更する場合があります。

ハ. 資産配分は、客観的に入手しうるデータに基づき、目標リスク水準に対してリターンが最大化するように定量的に算出します。

ニ. 各マザーファンドの組入比率の決定は、大和証券株式会社からの資産配分の助言に基づき行ないます。

ホ. 各マザーファンドの組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ヘ. 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。

ト. デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに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以外には利用しません。

チ. 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。

< バランス型 >

イ.（保守型のイ.と同規定）

ロ. 目標とするリスク水準は年率9%程度～11%程度とします。

目標とするリスク水準とは、ファンドの月次収益率の標準偏差（年率）の目途を指し、資産配分を決定する際の目標値として使用します。

当ファンドにおける目標とするリスク水準は、市場環境において投資家が許容すると考えられるリスク水準のなかで、相対的に積極と保守の中間と判断できる水準に設定しています。そのため、市場環境が大きく変動した場合、上記の目標とするリスク水準を変更する場合があります。

ハ.（保守型のハ.と同規定）

ニ.（保守型のニ.と同規定）

ホ.（保守型のホ.と同規定）

ヘ.（保守型のヘ.と同規定）

ト.（保守型のト.と同規定）

チ.（保守型のチ.と同規定）

<積極型>

イ．（保守型のイ.と同規定）

ロ．目標とするリスク水準は年率14%程度～16%程度とします。

目標とするリスク水準とは、ファンドの月次収益率の標準偏差（年率）の目途を指し、資産配分を決定する際の目標値として使用します。

当ファンドにおける目標とするリスク水準は、市場環境において投資家が許容すると考えられるリスク水準のなかで、相対的に積極的と判断できる水準に設定しています。そのため、市場環境が大きく変動した場合、上記の目標とするリスク水準を変更する場合があります。

ハ．（保守型のハ.と同規定）

ニ．（保守型のニ.と同規定）

ホ．（保守型のホ.と同規定）

ヘ．（保守型のヘ.と同規定）

ト．（保守型のト.と同規定）

チ．（保守型のチ.と同規定）

(2)【投資対象】

<各ファンド共通>

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)、および 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

<4資産分散>

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の5．から25．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

9. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 10. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 13. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 14. コマーシャル・ペーパー
 15. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの
 17. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 18. 投資証券、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。)
 19. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 20. 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せん。)
 21. 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。)
 22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 23. 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。)
 24. 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。)
 25. 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23.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5.の証券または証書ならびに前16.および前21.の証券または証書のうち前5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前6.から前10.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券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16.および前21.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券(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。

<6資産分散>

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から6.までに掲げる親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券、ならびに次の7.から27.までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
5. ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券
6. ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券
7. 株券または新株引受権証書
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 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。）
12. 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。）
13. 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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. コマーシャル・ペーパー
17. 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
18. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前7. から前17. までの証券または証書の性質を有するもの
19. 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。）
20. 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。）
21. 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。）
22. 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。）
23. 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。）
24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
25. 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。）
26. 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。）
27. 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25. 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7. の証券または証書ならびに前18. および前23. の証券または証書のうち前7. 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8. から前12. までの証券ならびに前20. 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18. および前23. の証券または証書のうち前8. から前12. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前19. の証券および前20. 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。

<8資産分散>

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1. から8. までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の9. から29. までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
5. ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券
6. ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券
7. 新興国株式インデックス・マザーファンドの受益証券
8. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
9. 株券または新株引受権証書
10. 国債証券
11. 地方債証券
12. 特別の法律により法人の発行する債券
13. 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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. 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。）
17. 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。）
18. コマーシャル・ペーパー
19. 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
20. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9. から前19. までの証券または証書の性質を有するもの
21. 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。）
22. 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。）
23. 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。）
24. 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。）
25. 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。）
26. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

27. 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。)

28. 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。)

29. 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27.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9.の証券または証書ならびに前20.および前25.の証券または証書のうち前9.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10.から前14.までの証券ならびに前22.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20.および前25.の証券または証書のうち前10.から前14.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前21.の証券および前22.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。

<各ファンド共通>

委託会社は、信託金を、前 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

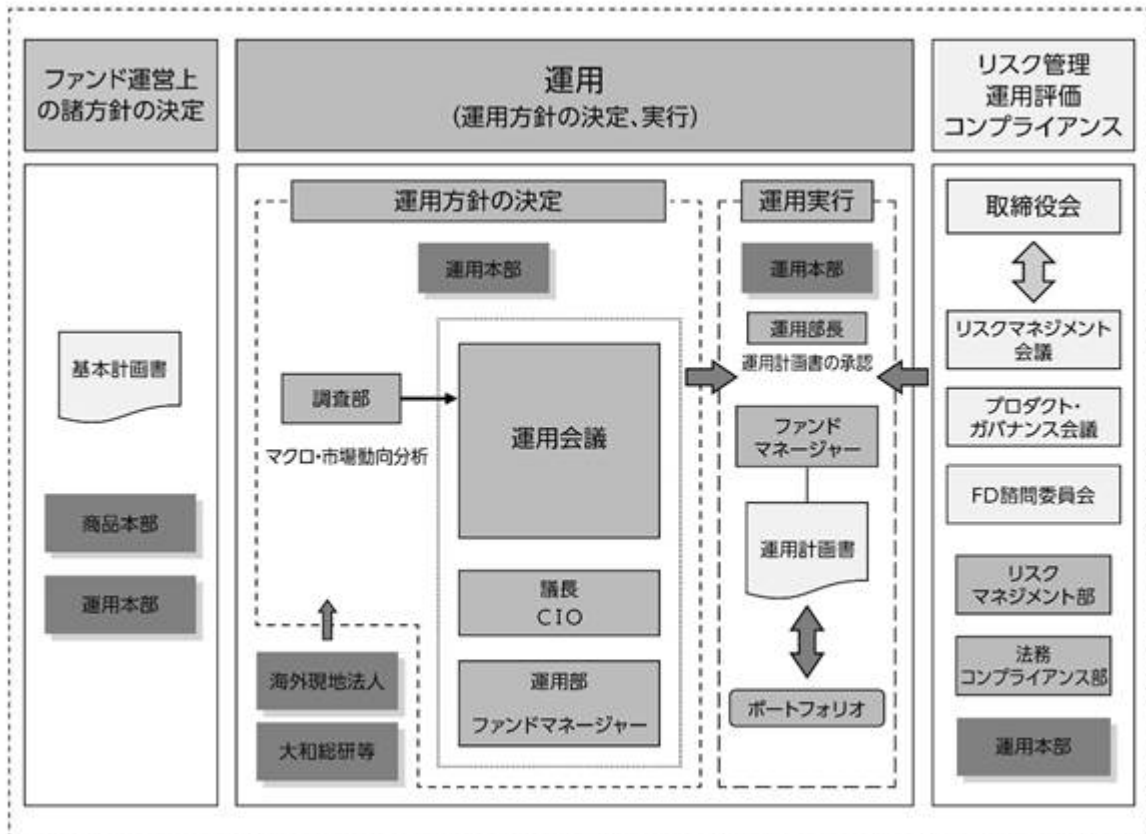
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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)【運用体制】

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。なお、委託会社は、運用にあたって投資顧問会社の助言を受けます。



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。

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。

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。

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】

<各ファンド共通>

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。

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、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

<各ファンド共通>

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。

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。

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。

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、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、

信用取引（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとし、
- ロ．前イ．の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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

号八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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ. 委託会社は、わが国の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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ハ. 委託会社は、わが国の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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)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。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引

にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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(以下本八.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. 前八.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るときは、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。

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(以下本八.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.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. 前八.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るときは、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。

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。

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るときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

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。

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。

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。

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。

資金の借入れ（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 各マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

2. 日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

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

(2) 投資対象

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

- 1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. 預託証券(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券
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

委託会社は、信託金を、前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

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

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

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

外貨建資産への投資は、行ないません。

3. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式(預託証券を含みます。)を主要投資対象とします。

投資態度

イ. 主として外国の株式(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

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。

委託会社は、信託金を、前 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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

4. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

5. ダイワJ - REITマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。

投資態度

- イ。「東証REIT指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。
- ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)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

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

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 4．新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）
- 5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

1．預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

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

6. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

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

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

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

7. 新興国株式インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

次の有価証券および取引を主要投資対象とします。

- イ．新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みません。）
- ロ．新興国の企業のDR（預託証券）
- ハ．新興国の株価指数を対象とした先物取引
- ニ．新興国の株価指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）

投資態度

イ．主として、新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果を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）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

信託財産の規模によっては、新興国の株価指数との連動をめざすETFおよび新興国の株価指数を対象とした先物取引を利用します。

ロ．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を利用することがあります。このため、株式およびETFの組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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．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

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

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

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せん。)
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.で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。

委託会社は、信託金を、前 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

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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。

スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、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。

ニ．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るときは、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。

金利先渡取引および為替先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引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。

ニ．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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

8. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果を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・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）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．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．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．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

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限りま。）
 - 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

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することができます。

- 1．転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りま。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．コマーシャル・ペーパー
- 8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. 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。)
13. 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。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 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。)
16. 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。)
17. 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
18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.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10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

号口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号八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ならびに外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。

スワップ取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、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が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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。

金利先渡取引および為替先渡取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引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が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)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。)の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. 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が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．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。

ヘ．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
要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

<各ファンド共通>

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。

<8資産分散>

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低い
ことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動
性が大きくなる傾向が考えられます。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

<各ファンド共通>

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

<8資産分散>

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがよ
り高いものになると考えられます。

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

<6資産分散、8資産分散>

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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
 - ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。
- ロ．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。
- ・リーートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リーートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
 - ・リーートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリーートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リーートの価格が大幅に下落することも想定されます。
 - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
 - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リーートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リーートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
 - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

<各ファンド共通>

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

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

<8資産分散>

特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

ロ．カントリー・リスク

<各ファンド共通>

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。

<8資産分散>

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる面がある場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

その他

<各ファンド共通>

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。

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け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付け、ご換金の申込みを取消すことがあります。

ご換金の申込みの受け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け付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

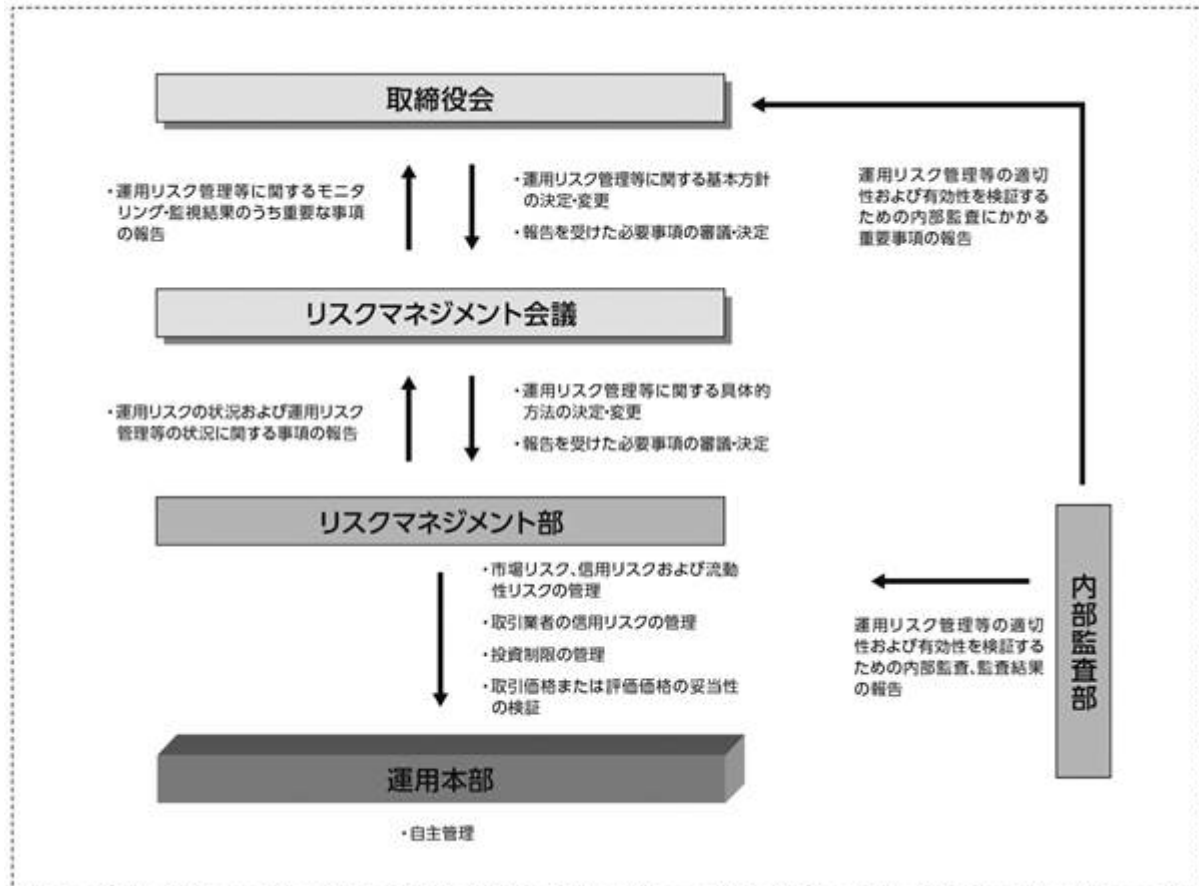
流動性リスクに関する事項

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け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

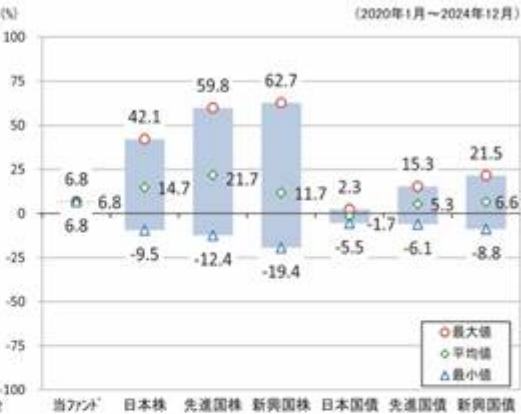
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

[スタイル9(4資産分散・保守型)]



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



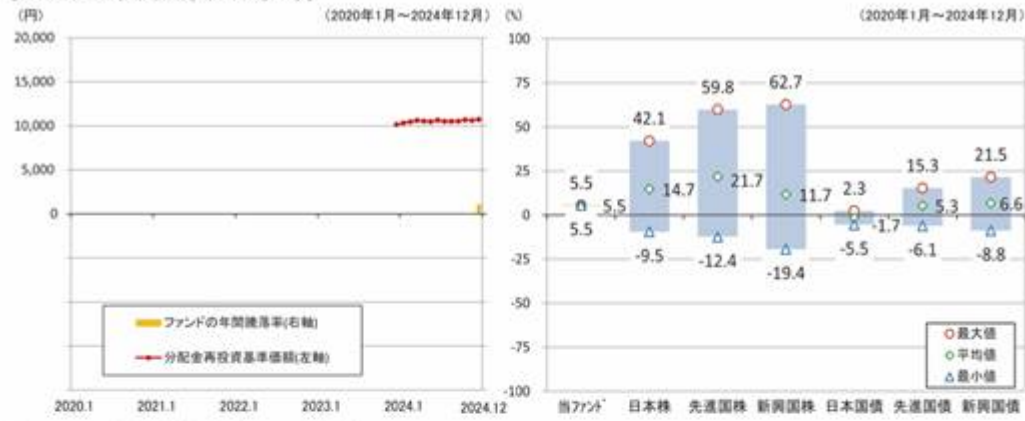
[スタイル9(4資産分散・バランス型)]



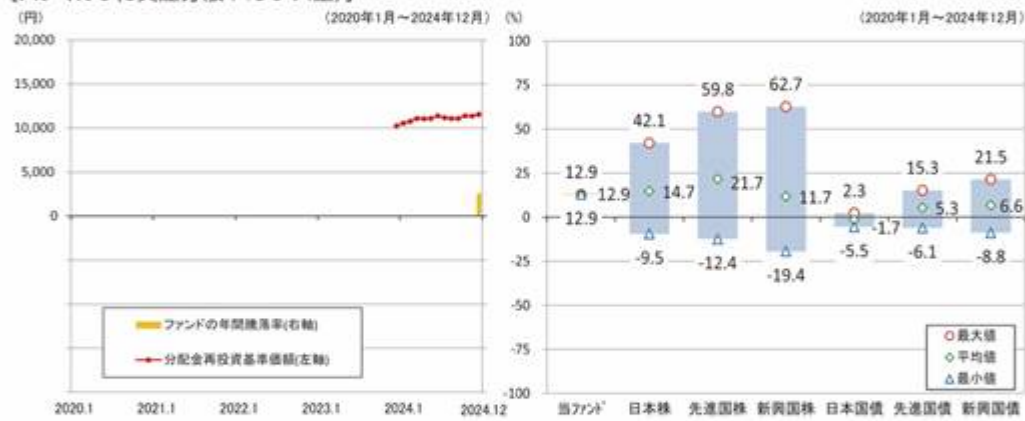
[スタイル9(4資産分散・積極型)]



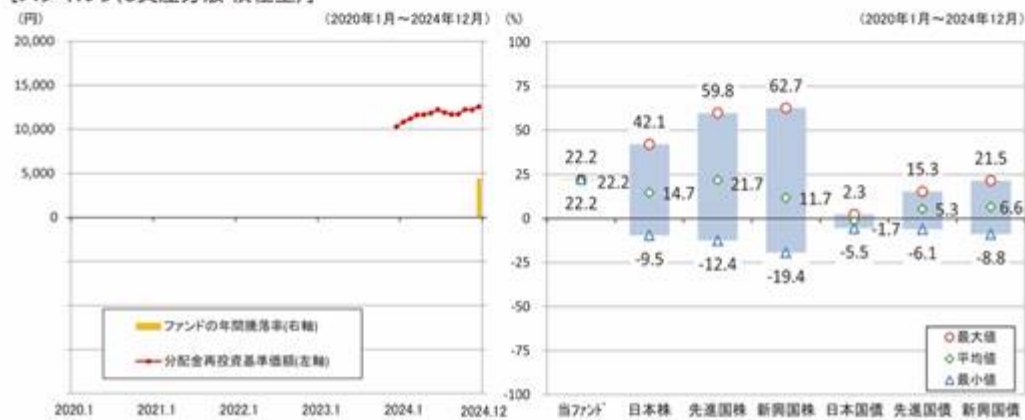
【スタイル9(6資産分散・保守型)】



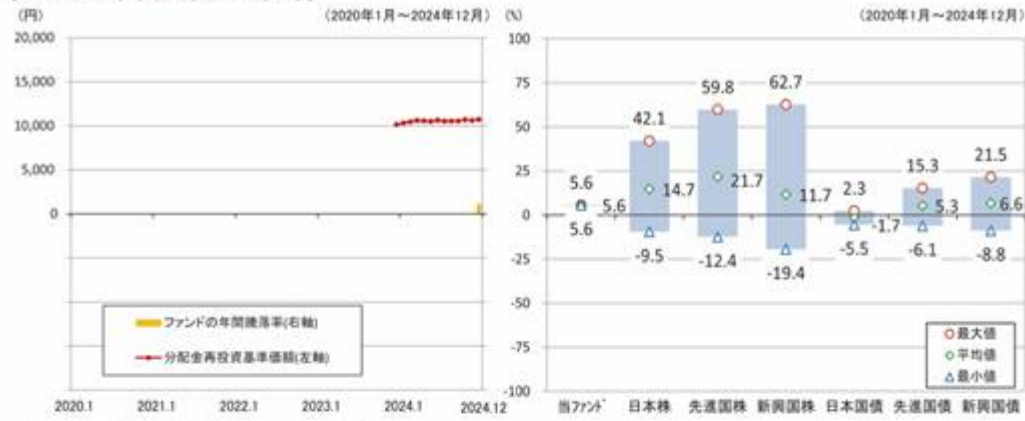
【スタイル9(6資産分散・バランス型)】



【スタイル9(6資産分散・積極型)】



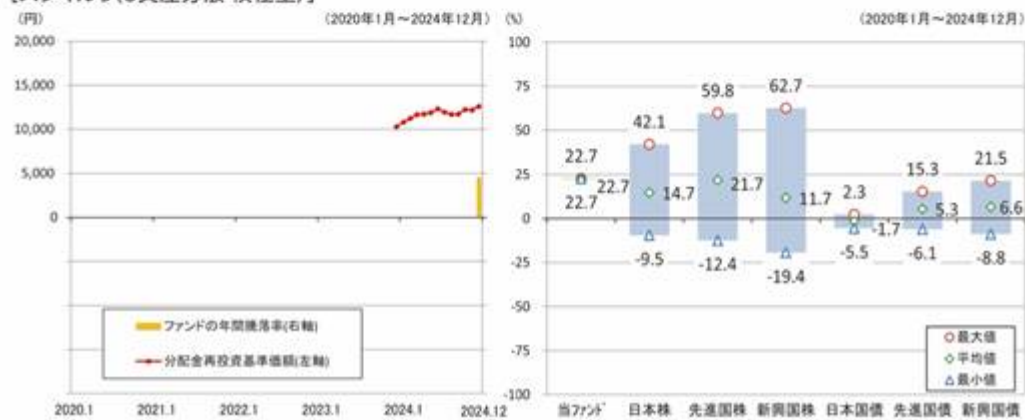
【スタイル9(8資産分散・保守型)】



【スタイル9(8資産分散・バランス型)】



【スタイル9(8資産分散・積極型)】



※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・インデックスー エマージング・マーケット 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準または商標は、株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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準または商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X 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・インデックスー エマージング・マーケット 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】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.2%（税抜2.0%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、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。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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0.825%（税抜0.75%）以内を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬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。

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0.28%以内 (税抜)	年率0.45% (税抜)	年率0.02% (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。

委託会社への配分は、マザーファンドにおいて組入れる上場投資信託証券の費用に応じて、上記の料率の範囲で決定します。

前 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】

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。

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。

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

信託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。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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）」をご利用の場合

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

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

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

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

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。

<注1> 個別元本について

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。

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。

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。

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

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。

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】

【スタイル9（4資産分散・保守型）】

(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	13,244,561	98.99
内 日本	13,244,561	98.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	134,863	1.01
純資産総額	13,379,424	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）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデクスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,067,024	1.3090 7,942,150	1.3098 7,946,588	59.39
2	外国株式インデクスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	343,640	6.9798 2,398,549	7.2380 2,487,266	18.59
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	925,950	1.9955 1,847,772	2.0481 1,896,438	14.17
4	外国債券インデクスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	243,021	3.6473 886,376	3.7621 914,269	6.83

(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	98.99%
合計	98.99%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,020,303	-	1.0180	-
2024年1月末日	1,315,652	-	1.0370	-
2月末日	1,853,199	-	1.0551	-
3月末日	2,400,929	-	1.0696	-
4月末日	3,172,352	-	1.0643	-
5月末日	4,141,755	-	1.0601	-
6月末日	5,042,115	-	1.0774	-
7月末日	6,177,286	-	1.0618	-
8月末日	7,307,743	-	1.0600	-
9月末日	9,405,494	-	1.0616	-
10月末日	10,787,091	-	1.0782	-
11月末日	11,918,346	-	1.0721	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	11,927,991	11,927,991	1.0730	1.0730
12月末日	13,379,424	-	1.0868	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	7.3
--------	-----

(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	10,515,043	398,312

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	409,408,926,410	98.05
内 日本	409,408,926,410	98.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,135,524,843	1.95
純資産総額	417,544,451,253	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	7,885,795,000	1.89
内 日本	7,885,795,000	1.89

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	5,475,100	2,614.96 14,317,206,091	3,146.00 17,224,664,600	4.13
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,606,800	2,660.14 9,594,618,914	3,369.00 12,151,309,200	2.91

3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,507,000	1,472.17 9,579,455,766	1,846.00 12,011,922,000	2.88
4	日立	日本	株式	電気機器	2,678,700	3,698.65 9,907,589,002	3,937.00 10,546,041,900	2.53
5	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	826,100	9,284.68 7,670,075,400	11,145.00 9,206,884,500	2.21
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,116,100	3,021.75 6,394,328,172	3,764.00 7,965,000,400	1.91
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	103,000	67,273.86 6,929,208,002	64,630.00 6,656,890,000	1.59
8	任天堂	日本	株式	その他製 品	650,200	7,726.52 5,023,788,446	9,264.00 6,023,452,800	1.44
9	伊藤忠	日本	株式	卸売業	732,500	7,670.91 5,618,945,172	7,832.00 5,736,940,000	1.37
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	990,400	5,229.36 5,179,159,357	5,728.00 5,673,011,200	1.36
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,369,200	2,881.87 3,945,857,046	3,873.00 5,302,911,600	1.27
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,601,100	2,952.90 4,727,902,127	3,311.00 5,301,242,100	1.27
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	218,000	23,096.03 5,034,934,623	24,185.00 5,272,330,000	1.26
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,014,000	2,874.32 5,788,881,262	2,604.00 5,244,456,000	1.26
15	信越化学	日本	株式	化学	925,100	5,754.48 5,323,474,405	5,296.00 4,899,329,600	1.17
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信 業	30,726,100	150.32 4,618,884,547	158.00 4,854,723,800	1.16
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	509,600	8,455.19 4,308,768,959	9,185.00 4,680,676,000	1.12
18	第一三共	日本	株式	医薬品	974,900	4,939.02 4,815,051,829	4,352.00 4,242,764,800	1.02
19	三菱重工業	日本	株式	機械	1,819,100	1,887.13 3,432,895,554	2,223.00 4,043,859,300	0.97
20	HOYA	日本	株式	精密機器	201,200	19,309.43 3,885,058,431	19,815.00 3,986,778,000	0.95
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	919,100	4,259.69 3,915,088,494	4,181.00 3,842,757,100	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	759,800	4,819.52 3,661,874,722	5,042.00 3,830,911,600	0.92

23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,440,300	1,537.30 3,751,478,321	1,535.00 3,745,860,500	0.90
24	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	61,300	46,295.58 2,837,919,286	53,820.00 3,299,166,000	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	16,532,600	197.23 3,260,784,168	198.90 3,288,334,140	0.79
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,203,800	2,180.17 2,624,496,192	2,487.00 2,993,850,600	0.72
27	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	324,600	6,563.78 2,130,603,490	9,198.00 2,985,670,800	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,058,100	2,266.72 2,398,426,554	2,687.00 2,843,114,700	0.68
29	富士通	日本	株式	電気機器	957,200	2,914.77 2,790,024,240	2,799.50 2,679,681,400	0.64
30	キャノン	日本	株式	電気機器	513,700	4,759.83 2,445,127,571	5,161.00 2,651,205,700	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.05%
合計	98.05%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.24%
建設業	2.11%
食料品	2.99%
繊維製品	0.40%
パルプ・紙	0.13%
化学	5.05%
医薬品	4.26%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.56%
ガラス・土石製品	0.65%
鉄鋼	0.80%
非鉄金属	0.82%

金属製品	0.48%
機械	5.45%
電気機器	17.28%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.35%
その他製品	2.61%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	2.20%
海運業	0.68%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.33%
卸売業	6.68%
小売業	4.51%
銀行業	8.39%
証券、商品先物取引業	0.87%
保険業	3.22%
その他金融業	1.18%
不動産業	1.73%
サービス業	5.04%
合計	98.05%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0703月	買建	283	7,766,705,650	7,885,795,000	1.89%

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		107,575,986,620	84.56
	内 日本	107,575,986,620	84.56
地方債証券		6,311,476,800	4.96
	内 日本	6,311,476,800	4.96
特殊債券		3,915,652,200	3.08
	内 日本	3,915,652,200	3.08
社債券		8,907,388,400	7.00
	内 日本	8,907,388,400	7.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		510,090,717	0.40
純資産総額		127,220,594,737	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）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	149 5年国債	日本	国債証券	1,480,000,000	98.94 1,464,341,600	99.05 1,465,999,200	0.005000 2026/09/20	1.15
2	150 5年国債	日本	国債証券	1,480,000,000	98.79 1,462,179,500	98.90 1,463,838,400	0.005000 2026/12/20	1.15
3	370 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	96.80 1,452,015,000	96.61 1,449,195,000	0.500000 2033/03/20	1.14
4	147 5年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	99.31 1,340,705,200	99.43 1,342,426,500	0.005000 2026/03/20	1.06
5	365 10年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	95.23 1,333,290,000	95.07 1,331,050,000	0.100000 2031/12/20	1.05
6	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	98.40 1,230,012,500	98.53 1,231,675,000	0.100000 2027/12/20	0.97
7	373 10年国債	日本	国債証券	1,160,000,000	96.78 1,122,659,100	96.59 1,120,478,800	0.600000 2033/12/20	0.88

8	163 5年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	98.97 1,118,427,500	99.05 1,119,366,700	0.400000 2028/09/20	0.88
9	369 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	97.07 1,106,609,400	96.85 1,104,101,400	0.500000 2032/12/20	0.87
10	364 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	95.49 1,088,629,800	95.36 1,087,138,200	0.100000 2031/09/20	0.85
11	354 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	97.43 1,071,818,000	97.53 1,072,852,000	0.100000 2029/03/20	0.84
12	360 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	96.30 1,059,373,600	96.36 1,060,015,000	0.100000 2030/09/20	0.83
13	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.69 1,036,297,500	0.100000 2027/09/20	0.81
14	154 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.69 1,036,297,500	0.100000 2027/09/20	0.81
15	363 10年国債	日本	国債証券	1,080,000,000	95.73 1,033,938,000	95.61 1,032,663,600	0.100000 2031/06/20	0.81
16	367 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	95.33 1,000,971,300	95.14 999,012,000	0.200000 2032/06/20	0.79
17	166 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	98.83 968,612,400	98.92 969,435,600	0.400000 2028/12/20	0.76
18	362 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.97 959,780,000	95.89 958,930,000	0.100000 2031/03/20	0.75
19	368 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.03 950,380,000	94.85 948,540,000	0.200000 2032/09/20	0.75
20	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.98 940,395,500	99.09 941,374,000	0.100000 2026/12/20	0.74
21	158 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.22 933,147,000	98.36 934,496,000	0.100000 2028/03/20	0.73
22	371 10年国債	日本	国債証券	960,000,000	95.69 918,624,000	95.54 917,251,200	0.400000 2033/06/20	0.72
23	466 2年国債	日本	国債証券	900,000,000	99.79 898,128,000	99.85 898,695,000	0.500000 2026/11/01	0.71
24	2 CT5年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.96 890,694,000	99.02 891,261,000	0.500000 2029/06/20	0.70
25	347 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.70 888,376,500	98.83 889,551,000	0.100000 2027/06/20	0.70
26	372 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.74 888,678,000	98.55 887,004,000	0.800000 2033/09/20	0.70
27	161 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	98.73 868,868,000	98.85 869,888,800	0.300000 2028/06/20	0.68

28	148 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	99.12 862,420,700	99.23 863,353,200	0.005000 2026/06/20	0.68
29	156 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	98.75 859,132,300	98.82 859,768,800	0.200000 2027/12/20	0.68
30	151 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	98.64 838,457,000	98.77 839,562,000	0.005000 2027/03/20	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.56%
地方債証券	4.96%
特殊債券	3.08%
社債券	7.00%
合計	99.60%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (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）

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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		329,561,475,020	97.63
	内 ユーロ	98,988,156,413	29.32
	内 中国	37,401,130,797	11.08
	内 シンガポール	1,183,190,219	0.35

内 マレーシア	1,652,564,172	0.49
内 イスラエル	981,866,029	0.29
内 ノルウェー	449,279,632	0.13
内 スウェーデン	470,488,647	0.14
内 デンマーク	677,336,592	0.20
内 イギリス	16,896,608,775	5.01
内 ポーランド	1,667,863,602	0.49
内 カナダ	6,186,807,335	1.83
内 アメリカ	155,950,958,216	46.20
内 メキシコ	2,303,723,398	0.68
内 オーストラリア	3,954,516,301	1.17
内 ニュージーランド	796,984,892	0.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,000,731,379	2.37
純資産総額	337,562,206,399	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,731,096,765	0.51
内 日本	1,731,096,765	0.51

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.98 1,859,386,851	101.70 1,872,607,291	1.850000 2027/05/15	0.55
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	97.76 1,701,056,647	94.85 1,650,388,429	3.875000 2033/08/15	0.49
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,608,365,710	102.66 1,623,435,886	2.050000 2029/04/15	0.48
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,618,434,488	99.21 1,569,430,324	4.500000 2033/11/15	0.46
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,618,703,394	94.24 1,565,255,953	3.875000 2034/08/15	0.46

6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,422,144,971	82.24 1,392,001,083	1.125000 2031/02/15	0.41
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,323,855,025	102.38 1,330,665,621	2.390000 2026/11/15	0.39
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,364,205,219	88.39 1,328,335,531	2.750000 2032/08/15	0.39
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,356,321,369	81.33 1,325,104,863	1.250000 2031/08/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,363,111,404	98.14 1,319,629,304	4.375000 2034/05/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	91.87 1,351,490,394	89.52 1,316,920,155	2.875000 2032/05/15	0.39
12	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,292,252,908	103.84 1,304,703,908	2.370000 2029/01/15	0.39
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,307,576,779	98.14 1,288,500,429	4.000000 2029/07/31	0.38
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,319,411,016	81.43 1,288,138,830	1.375000 2031/11/15	0.38
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,289,472,920	81.54 1,264,034,728	0.875000 2030/11/15	0.37
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	98.51 1,277,814,421	95.43 1,237,864,480	4.000000 2034/02/15	0.37
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	96.32 1,177,582,525	96.44 1,179,159,644	1.625000 2026/05/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,206,951,363	92.70 1,173,151,460	3.500000 2033/02/15	0.35
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	85.94 1,182,773,392	84.06 1,156,805,139	1.625000 2031/05/15	0.34
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,126,423,568	105.44 1,142,128,663	2.540000 2030/12/25	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	94.32 1,163,822,637	91.58 1,129,979,393	3.375000 2033/05/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,096,718,884	98.49 1,090,628,954	3.750000 2027/08/15	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.98 1,151,373,238	96.82 1,072,137,712	4.625000 2054/05/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	94.40 1,045,275,585	94.39 1,045,231,294	1.125000 2026/10/31	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,700,000	99.87 1,058,491,840	97.21 1,030,301,000	4.125000 2032/11/15	0.31

26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	82.41 1,042,849,104	80.94 1,024,361,025	0.625000 2030/08/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	95.76 1,014,902,019	94.85 1,005,300,177	2.875000 2028/08/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	90.08 997,441,953	89.61 992,226,758	0.750000 2028/01/31	0.29
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	102.43 976,307,555	104.00 991,319,460	2.280000 2031/03/25	0.29
30	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	100.68 959,694,381	103.69 988,374,267	2.110000 2034/08/25	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.63%
合計	97.63%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2025年 1月	買建	295,000	57,271,816	58,644,857	0.02%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2025年1月	買建	595,000	52,491,554	52,994,746	0.02%
		オフショア人民元買/円 売 2025年1月	買建	26,825,000	556,578,360	580,512,483	0.17%
		米ドル買/円売 2025年1 月	買建	3,052,000	475,309,857	482,262,300	0.14%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2025年1月	買建	848,000	11,623,366	12,194,494	0.00%

ノルウェー・クローネ 買/円売 2025年1月	買建	1,911,000	25,771,172	26,608,572	0.01%
カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	671,000	72,177,138	73,596,623	0.02%
メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	14,865,000	108,144,361	115,171,047	0.03%
ユーロ買/円売 2025年1 月	買建	1,997,000	324,038,591	329,111,643	0.10%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(4資産分散・保守型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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	10,868円
純資産総額	13百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.4%
3か月間	2.4%
6か月間	0.9%
1年間	6.8%
3年間	-
5年間	-
設定来	8.7%

※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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月	0円									
分配金	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。

マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.4%	国内債券	429	59.2%	日本円	74.6%	APPLE INC	アメリカ	1.0%
外国株式INDEXMF	18.6%	外国株式・先物	1,156	18.3%	米ドル	17.8%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.9%
トピックス・インデックス・MF	14.2%	国内株式・先物	2,091	14.2%	ユーロ	3.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.8%
外国債券INDEXMF	6.8%	外国債券	1,025	6.7%	英ポンド	1.0%	トヨタ自動車	日本	0.6%
		外国リート	51	0.3%	オフショア人民元	0.8%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.6%
		外国投資証券	3	0.0%	カナダ・ドル	0.7%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	0.5%
					スイス・フラン	0.4%	ソニーグループ	日本	0.4%
					豪ドル	0.4%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%
					スウェーデン・クローネ	0.2%	日立	日本	0.4%
		コール・ローン、その他		2.5%	その他	0.6%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.4%
合計	99.0%	合計	4,755	-	合計	100.0%	合計		6.0%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(4資産分散・バランス型)】

(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		57,334,566	99.01
	内 日本	57,334,566	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		572,415	0.99
純資産総額		57,906,981	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)

【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	2,432,910	6.9811 16,984,501	7.2380 17,609,402	30.41
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,006,471	1.3090 15,717,473	1.3098 15,726,075	27.16
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,625,111	1.9950 13,217,684	2.0481 13,568,889	23.43
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,772,441	3.6485 10,115,404	3.7621 10,430,200	18.01

(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	99.01%
合計	99.01%

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,025,481	-	1.0232	-
2024年1月末日	3,572,858	-	1.0619	-
2月末日	6,907,289	-	1.0918	-
3月末日	11,159,015	-	1.1193	-
4月末日	15,457,984	-	1.1210	-
5月末日	20,929,351	-	1.1275	-
6月末日	25,751,717	-	1.1590	-
7月末日	30,750,521	-	1.1292	-
8月末日	35,577,496	-	1.1141	-
9月末日	39,601,522	-	1.1151	-
10月末日	46,451,890	-	1.1516	-
11月末日	51,307,603	-	1.1452	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	51,441,073	51,441,073	1.1482	1.1482
12月末日	57,906,981	-	1.1752	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	14.8

(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	45,660,575	1,857,522

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●スタイル9(4資産分散・バランス型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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	11,752円
純資産総額	57百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	2.6%
3か月間	5.4%
6か月間	1.4%
1年間	14.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	17.5%

※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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月	0円									
分配金	0円									

※分配金は、収益配分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。

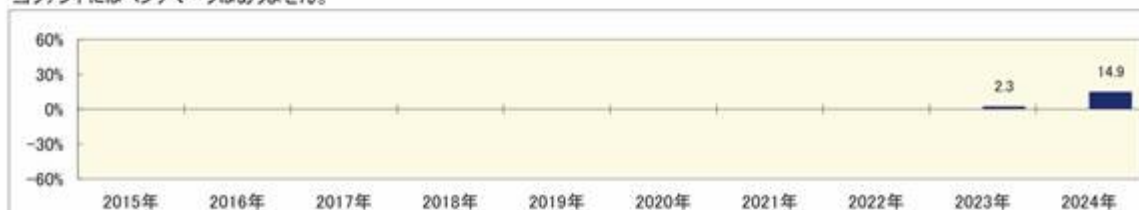
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	30.4%	外国株式・先物	1,156	29.9%	日本円	51.6%	APPLE INC	アメリカ	1.7%
日本債券INDEXMF	27.2%	国内債券	429	27.0%	米ドル	32.4%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.5%
トピックス・インデックス・MF	23.4%	国内株式・先物	2,091	23.4%	ユーロ	7.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.3%
外国債券INDEXMF	18.0%	外国債券	1,025	17.6%	オフショア人民元	2.1%	トヨタ自動車	日本	1.0%
		外国リート	51	0.5%	英ポンド	2.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.9%
		外国投資証券	3	0.0%	カナダドル	1.3%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	0.9%
					豪ドル	0.8%	ソニーグループ	日本	0.7%
					スイス・フラン	0.7%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.7%
					スウェーデン・クローネ	0.3%	日立	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		3.3%	その他	1.1%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.6%
合計	99.0%	合計	4,755	-	合計	100.0%	合計		9.8%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(4資産分散・積極型)】

(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	56,765,606	98.59
内 日本	56,765,606	98.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	810,871	1.41
純資産総額	57,576,477	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2024年12月30日現在)

【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	3,594,054	6.9839 25,100,663	7.2380 26,013,762	45.18
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,564,183	1.9954 19,085,282	2.0481 19,588,403	34.02
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,524,520	3.6476 9,208,466	3.7621 9,497,496	16.50
4	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,271,908	1.3092 1,665,189	1.3098 1,665,945	2.89

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.59%
合計	98.59%

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,033,271	-	1.0273	-
2024年1月末日	3,090,555	-	1.0847	-
2月末日	6,526,446	-	1.1257	-
3月末日	11,017,340	-	1.1655	-
4月末日	14,872,122	-	1.1718	-
5月末日	19,694,015	-	1.1886	-
6月末日	25,122,685	-	1.2331	-
7月末日	29,321,964	-	1.1912	-
8月末日	34,457,299	-	1.1648	-
9月末日	37,150,182	-	1.1648	-
10月末日	44,981,877	-	1.2194	-
11月末日	49,464,517	-	1.2154	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	49,694,238	49,694,238	1.2211	1.2211
12月末日	57,576,477	-	1.2597	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.1

(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	42,415,564	2,718,282

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

● スタイル9(4資産分散・積極型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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。



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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月										
分配金	0円									

※分配金は、収益配分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。

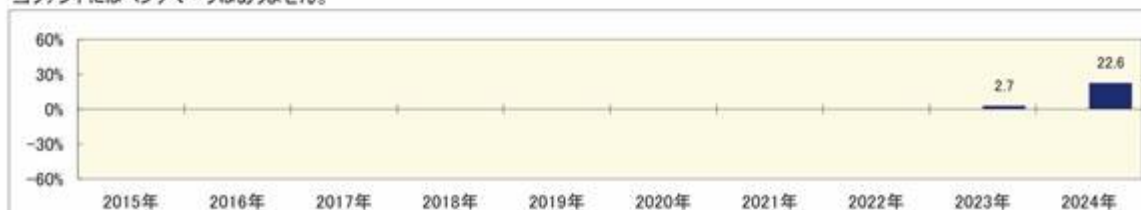
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	45.2%	外国株式・先物	1,156	44.4%	米ドル	43.3%	APPLE INC	アメリカ	2.5%
トピックス・インデックス・MF	34.0%	国内株式・先物	2,091	34.0%	日本円	38.3%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.2%
外国債券INDEXMF	16.5%	外国債券	1,025	16.1%	ユーロ	8.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.0%
日本債券INDEXMF	2.9%	国内債券	429	2.9%	英ポンド	2.5%	トヨタ自動車	日本	1.4%
		外国リート	51	0.8%	オフショア人民元	1.9%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.4%
		外国投資証券	3	0.0%	カナダ・ドル	1.7%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	1.3%
					スイス・フラン	1.0%	ソニーグループ	日本	1.0%
					豪ドル	1.0%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
					スウェーデン・クローネ	0.4%	日立	日本	0.9%
		コール・ローン、その他		4.4%	その他	1.3%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.9%
合計	98.6%	合計	4,755	-	合計	100.0%	合計		14.4%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



*ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

*2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(6資産分散・保守型)】

(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	5,969,656	98.99
内 日本	5,969,656	98.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	60,684	1.01
純資産総額	6,030,340	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）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,738,581	1.3089 3,584,791	1.3098 3,586,993	59.48
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	139,815	6.9757 975,317	7.2380 1,011,980	16.78
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	375,903	1.9941 749,624	2.0481 769,886	12.77
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	79,457	3.1047 246,697	3.1195 247,866	4.11
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	52,419	3.6445 191,046	3.7621 197,205	3.27
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	38,046	4.1979 159,716	4.0931 155,726	2.58

(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	98.99%
合計	98.99%

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,019,641	-	1.0183	-
2024年1月末日	1,280,572	-	1.0328	-
2月末日	1,729,172	-	1.0469	-
3月末日	2,176,672	-	1.0623	-
4月末日	2,394,988	-	1.0562	-
5月末日	3,013,943	-	1.0502	-
6月末日	3,318,455	-	1.0657	-
7月末日	3,819,123	-	1.0533	-
8月末日	4,229,588	-	1.0536	-
9月末日	4,544,889	-	1.0551	-
10月末日	5,244,124	-	1.0688	-
11月末日	5,673,939	-	1.0630	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	5,675,699	5,675,699	1.0633	1.0633
12月末日	6,030,340	-	1.0741	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.3

(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	4,394,036	56,327

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	256,272,413,516	96.55
内 日本	256,272,413,516	96.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,152,197,159	3.45
純資産総額	265,424,610,675	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

不動産投信指数先物取引(買建)	9,153,200,000	3.45
内 日本	9,153,200,000	3.45

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	156,018	135,124.92 21,081,921,045	122,400.00 19,096,603,200	7.19
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	137,377	118,330.10 16,255,834,641	107,900.00 14,822,978,300	5.58
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	138,698	101,068.66 14,018,022,106	90,200.00 12,510,559,600	4.71
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	85,621	151,202.24 12,946,087,280	137,700.00 11,790,011,700	4.44
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	74,832	154,542.00 11,564,687,160	149,500.00 11,187,384,000	4.21
6	GLP投資法人	日本	投資証券	89,846	135,128.57 12,140,762,239	123,400.00 11,086,996,400	4.18
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	46,596	267,755.64 12,476,342,176	222,900.00 10,386,248,400	3.91
8	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	147,371	58,073.25 8,558,313,070	66,200.00 9,755,960,200	3.68
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	39,889	235,181.83 9,381,168,201	231,800.00 9,246,270,200	3.48
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	53,295	155,475.95 8,286,090,852	164,100.00 8,745,709,500	3.29
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	59,401	140,297.92 8,333,836,789	140,800.00 8,363,660,800	3.15
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	26,287	336,149.58 8,836,364,188	292,400.00 7,686,318,800	2.90
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	98,265	68,629.73 6,743,901,313	70,600.00 6,937,509,000	2.61

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.55%
合計	96.55%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT 先物 0703月	買建	5,600	9,004,856,000	9,153,200,000	3.45%

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

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

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,169,404,968	2.41
内 アメリカ	1,169,404,968	2.41
投資証券	45,980,596,214	94.74
内 ガーンジー	64,537,239	0.13
内 韓国	74,209,961	0.15
内 香港	400,803,882	0.83
内 シンガポール	1,462,102,253	3.01
内 イスラエル	65,161,614	0.13
内 イギリス	1,884,279,250	3.88
内 アイルランド	13,358,296	0.03
内 オランダ	52,096,823	0.11
内 ベルギー	335,240,995	0.69
内 フランス	686,244,707	1.41

内 ドイツ	12,486,370	0.03
内 スペイン	166,474,234	0.34
内 イタリア	3,909,646	0.01
内 カナダ	578,406,097	1.19
内 アメリカ	36,591,851,397	75.39
内 オーストラリア	3,548,765,058	7.31
内 ニュージーランド	40,668,392	0.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,385,754,381	2.86
純資産総額	48,535,755,563	100.00

その他の資産の投資状況

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	187,400	18,404.24 3,448,984,718	16,646.86 3,119,622,164	6.43
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	19,506	154,857.42 3,020,649,077	149,109.95 2,908,538,856	5.99
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	119,635	21,744.53 2,601,414,249	19,772.50 2,365,483,038	4.87
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	63,004	30,837.50 1,942,886,464	28,178.18 1,775,338,380	3.66
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	62,030	28,983.79 1,797,873,247	27,208.54 1,687,745,848	3.48
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	31,803	54,821.23 1,743,482,762	47,153.45 1,499,621,425	3.09

7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	408,653	3,725.86 1,522,585,017	3,633.66 1,484,908,103	3.06
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	177,116	9,127.61 1,616,650,730	8,329.75 1,475,333,560	3.04
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	83,300	15,261.20 1,271,261,087	14,038.47 1,169,404,968	2.41
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,697	37,157.43 1,066,308,297	34,986.25 1,004,000,485	2.07
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	42,821	26,924.60 1,152,942,726	23,424.87 1,003,076,624	2.07
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	59,313	19,471.00 1,154,892,856	16,564.60 982,496,689	2.02
13	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	213,300	5,135.47 1,095,403,460	4,577.72 976,429,638	2.01
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	84,845	10,095.68 856,569,400	9,315.22 790,349,858	1.63
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	69,057	12,097.92 835,454,500	11,322.52 781,899,567	1.61
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	115,225	5,407.22 623,052,236	5,077.57 585,063,925	1.21
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	12,967	48,965.56 634,938,288	44,991.13 583,400,079	1.20
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	23,591	25,912.73 611,310,742	24,320.17 573,737,248	1.18
19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	136,385	4,034.06 550,186,176	3,696.66 504,169,874	1.04
20	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,460	17,377.33 546,693,617	15,557.00 489,423,314	1.01
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,207	19,960.41 483,182,688	19,560.53 473,501,963	0.98
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	141,540	3,470.78 491,261,935	3,176.25 449,567,048	0.93
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	55,436	8,142.31 451,380,227	7,568.91 419,590,261	0.86
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	60,760	7,241.63 440,010,983	6,866.59 417,214,239	0.86
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	38,566	11,243.59 433,623,703	10,534.78 406,284,634	0.84
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	141,386	2,912.88 411,858,030	2,843.28 402,000,764	0.83

27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	21,568	19,840.20 427,916,350	18,227.08 393,121,692	0.81
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,112,672	362.38 403,265,903	347.70 386,881,618	0.80
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	33,007	11,947.49 394,354,466	11,697.41 386,096,445	0.80
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	279,635	1,551.95 433,993,685	1,379.20 385,674,997	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	買建	188	1,116,450,701	1,063,127,780	2.19%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 25	買建	360	377,907,055	373,147,992	0.77%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1 月	買建	2,330,000	351,544,637	368,078,000	0.76%
		ユーロ買/円売 2025年1 月	買建	1,030,000	162,423,687	169,710,422	0.35%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●スタイル9(6資産分散・保守型)

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	10,741円
純資産総額	6百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.0%
3カ月間	1.8%
6カ月間	0.8%
1年間	5.5%
3年間	-
5年間	-
設定来	7.4%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月	0円									
分配金	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。

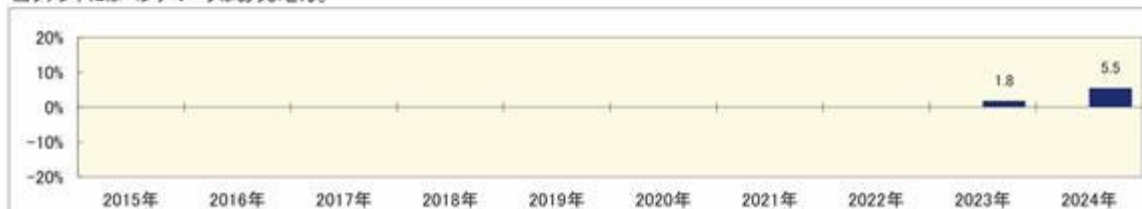
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.5%	国内債券	429	59.2%	日本円	77.4%	APPLE INC	アメリカ	0.9%
外国株式INDEXMF	16.8%	外国株式・先物	1,156	16.5%	米ドル	16.8%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.8%
トピックス・インデックス・MF	12.8%	国内株式・先物	2,091	12.8%	ユーロ	2.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%
ダイワJ-REIT MF	4.1%	国内リート・先物	58	4.1%	英ポンド	0.9%	トヨタ自動車	日本	0.5%
外国債券INDEXMF	3.3%	外国債券	1,025	3.2%	カナダ・ドル	0.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.5%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	2.6%	外国リート・先物	296	2.8%	豪ドル	0.5%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	0.5%
		外国投資信託等	5	0.1%	スイス・フラン	0.4%	ソニーグループ	日本	0.4%
					オフショア人民元	0.4%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%
					シンガポール・ドル	0.1%	日立	日本	0.3%
		コール・ローン、その他		2.5%	その他	0.5%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.3%
合計	99.0%	合計	5,060	-	合計	100.0%	合計		5.4%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(6資産分散・バランス型)】

(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	112,664,801	98.97
内 日本	112,664,801	98.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,175,369	1.03
純資産総額	113,840,170	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）

【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	4,435,421	6.9807 30,962,751	7.2380 32,103,577	28.20
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,922,874	1.3090 31,316,488	1.3098 31,334,180	27.52
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,018,021	1.9945 23,970,773	2.0481 24,614,108	21.62
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,095,646	3.1032 9,606,655	3.1195 9,656,867	8.48
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,966,235	4.1950 8,248,543	4.0931 8,047,996	7.07
6	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,836,228	3.6461 6,695,108	3.7621 6,908,073	6.07

(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	98.97%
合計	98.97%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,076,223	-	1.0243	-
2024年1月末日	7,046,777	-	1.0556	-
2月末日	14,271,837	-	1.0776	-
3月末日	23,383,593	-	1.1086	-
4月末日	30,618,274	-	1.1073	-
5月末日	40,600,938	-	1.1100	-
6月末日	51,217,428	-	1.1378	-
7月末日	60,662,765	-	1.1168	-
8月末日	69,881,039	-	1.1087	-
9月末日	80,852,961	-	1.1099	-
10月末日	93,058,207	-	1.1403	-
11月末日	102,544,317	-	1.1358	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	102,704,313	102,704,313	1.1376	1.1376
12月末日	113,840,170	-	1.1564	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.8

(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	92,313,825	3,031,336

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(6資産分散・バランス型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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	11,564円
純資産総額	1.1億円



※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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月	0円									
分配金	0円									

※分配金は、収益配分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。

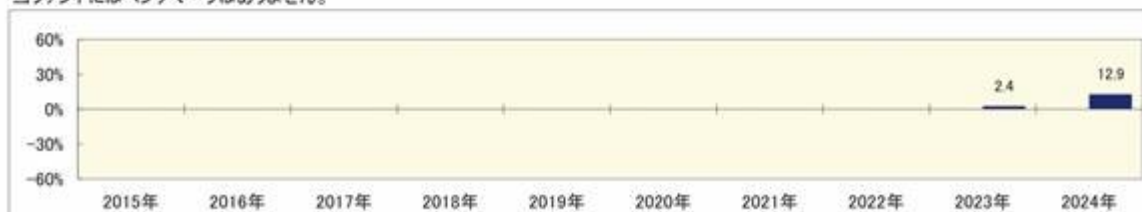
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	28.2%	外国株式・先物	1,156	27.7%	日本円	58.7%	APPLE INC	アメリカ	1.6%
日本債券INDEXMF	27.5%	国内債券	429	27.4%	米ドル	30.7%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.4%
トピックス・インデックス・MF	21.6%	国内株式・先物	2,091	21.6%	ユーロ	4.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.2%
ダイワJ-REIT MF	8.5%	国内リート・先物	58	8.5%	英ポンド	1.6%	トヨタ自動車	日本	0.9%
ダイワ・グローバル・REIT INDEX MF	7.1%	外国リート・先物	296	7.4%	豪ドル	1.1%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.9%
外国債券INDEXMF	6.1%	外国債券	1,025	5.9%	カナダ・ドル	1.1%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	0.8%
		外国投資信託等	5	0.2%	オフショア人民元	0.7%	ソニーグループ	日本	0.6%
					スイス・フラン	0.6%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%
					シンガポール・ドル	0.3%	日本ビルファンド	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		3.4%	その他	0.9%	日立	日本	0.5%
合計	99.0%	合計	5,060	-	合計	100.0%	合計		9.1%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(6資産分散・積極型)】

(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	82,137,499	99.03
内 日本	82,137,499	99.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	805,700	0.97
純資産総額	82,943,199	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)

【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	5,157,783	6.9801 36,002,349	7.2380 37,332,033	45.01
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,664,682	1.9946 27,256,577	2.0481 27,986,635	33.74
3	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,640,977	4.1945 6,883,227	4.0931 6,716,682	8.10
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,657,315	3.1036 5,143,660	3.1195 5,169,994	6.23
5	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,907,519	1.3090 2,497,131	1.3098 2,498,468	3.01
6	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	646,896	3.6457 2,358,396	3.7621 2,433,687	2.93

(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	99.03%
合計	99.03%

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,165,359	-	1.0299	-
2024年1月末日	5,718,210	-	1.0836	-
2月末日	10,721,311	-	1.1215	-
3月末日	16,886,782	-	1.1667	-
4月末日	22,984,798	-	1.1692	-
5月末日	30,999,866	-	1.1840	-
6月末日	38,924,614	-	1.2266	-
7月末日	44,563,107	-	1.1932	-
8月末日	50,064,041	-	1.1729	-
9月末日	57,824,002	-	1.1737	-
10月末日	66,945,377	-	1.2248	-
11月末日	73,862,952	-	1.2234	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	74,148,223	74,148,223	1.2281	1.2281
12月末日	82,943,199	-	1.2586	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.8

(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	62,571,812	3,196,858

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(6資産分散・積極型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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。



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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月										
分配金	0円									

※分配金は、収益配分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。

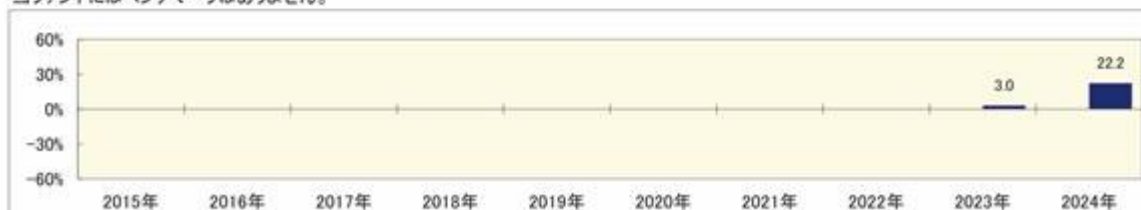
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	45.0%	外国株式・先物	1,156	44.2%	日本円	44.0%	APPLE INC	アメリカ	2.5%
トピックス・インデックス・MF	33.7%	国内株式・先物	2,091	33.7%	米ドル	43.2%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.2%
ダイワ・グローバル・REIT INDEX MF	8.1%	外国リート・先物	296	8.7%	ユーロ	4.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.0%
ダイワJ-REIT MF	6.2%	国内リート・先物	58	6.2%	英ポンド	2.1%	トヨタ自動車	日本	1.4%
日本債券INDEXMF	3.0%	国内債券	429	3.0%	カナダ・ドル	1.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.4%
外国債券INDEXMF	2.9%	外国債券	1,025	2.9%	豪ドル	1.4%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	1.3%
		外国投資信託等	5	0.2%	スイス・フラン	1.0%	ソニーグループ	日本	1.0%
					シンガポール・ドル	0.4%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
					スウェーデン・クローネ	0.4%	日立	日本	0.9%
		コール・ローン、その他		4.1%	その他	1.2%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.8%
合計	99.0%	合計	5,060	-	合計	100.0%	合計		14.3%

※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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



*ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

*2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(8資産分散・保守型)】

(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	9,269,498	98.71
内 日本	9,269,498	98.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	120,832	1.29
純資産総額	9,390,330	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)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,199,925	1.3090 5,497,856	1.3098 5,501,061	58.58
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	196,120	6.9753 1,368,005	7.2380 1,419,516	15.12
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	588,460	1.9942 1,173,529	2.0481 1,205,224	12.83
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	108,749	3.1052 337,690	3.1195 339,242	3.61
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	81,611	3.6437 297,368	3.7621 307,028	3.27
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	48,224	4.1962 202,360	4.0931 197,385	2.10
7	新興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	142,437	1.1440 162,950	1.1913 169,685	1.81
8	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	67,553	1.8548 125,298	1.9297 130,357	1.39

(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	98.71%
合計	98.71%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,019,347	-	1.0181	-
2024年1月末日	1,353,550	-	1.0321	-
2月末日	1,801,271	-	1.0470	-
3月末日	2,432,359	-	1.0618	-
4月末日	2,981,980	-	1.0570	-
5月末日	3,880,282	-	1.0512	-
6月末日	4,353,722	-	1.0666	-
7月末日	5,413,447	-	1.0539	-
8月末日	6,506,350	-	1.0547	-
9月末日	7,250,029	-	1.0573	-
10月末日	8,307,117	-	1.0705	-
11月末日	8,692,289	-	1.0633	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	8,695,281	8,695,281	1.0636	1.0636
12月末日	9,390,330	-	1.0752	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.4

(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	7,362,985	187,803

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

新興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(%)
投資証券	49,220,238	85.03
内 アメリカ	49,220,238	85.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,668,837	14.97
純資産総額	57,889,075	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)	8,597,083	14.85
内 アメリカ	8,597,083	14.85
為替予約取引(買建)	2,148,256	3.71
内 日本	2,148,256	3.71

(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）

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	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	投資証券	5,900	8,583.63 50,644,016	8,342.41 49,220,238	85.03

(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。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	85.03%
合計	85.03%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

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	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) MAR 25	買建	1	8,737,784	8,597,083	14.85%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1 月	買建	13,600	2,029,196	2,148,256	3.71%

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	50,237,477,132	97.06
内 中国	5,234,762,800	10.11
内 タイ	4,888,279,344	9.44
内 マレーシア	5,175,469,649	10.00

内 インドネシア	5,060,499,715	9.78
内 インド	3,102,256,219	5.99
内 ポーランド	3,650,743,941	7.05
内 ハンガリー	1,252,286,247	2.42
内 セルビア	165,057,924	0.32
内 ルーマニア	1,739,256,729	3.36
内 トルコ	701,311,135	1.35
内 チェコ	2,725,281,525	5.27
内 メキシコ	5,088,529,215	9.83
内 ドミニカ共和国	128,634,952	0.25
内 コロンビア	1,911,659,466	3.69
内 ペルー	1,077,251,633	2.08
内 チリ	880,598,511	1.70
内 ブラジル	3,117,755,402	6.02
内 ウルグアイ	90,040,975	0.17
内 南アフリカ	4,247,801,750	8.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,521,514,018	2.94
純資産総額	51,758,991,150	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	355,162,950	0.69
内 日本	355,162,950	0.69

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	31,500,000	80.19 643,421,870	80.25 643,911,311	- 2026/07/01	1.24
2	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	26,000,000	84.99 562,870,330	86.54 573,178,670	- 2026/01/01	1.11
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	78,020,000	76.12 503,023,339	80.60 532,635,104	8.750000 2048/02/28	1.03

4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,650,000	104.12 517,232,238	104.16 517,455,783	10.500000 2026/12/21	1.00
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	63,000,000	92.60 494,133,532	95.85 511,507,873	8.000000 2030/01/31	0.99
6	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	68,700,000	89.43 477,850,957	91.57 489,252,686	5.500000 2027/03/04	0.95
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	65,500,000	93.00 473,761,903	95.37 485,841,450	5.750000 2026/03/05	0.94
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	61,700,000	86.16 450,271,298	91.14 476,296,728	8.875000 2035/02/28	0.92
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	67,850,000	89.20 470,733,867	89.34 471,437,286	7.750000 2031/05/29	0.91
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	59,800,000	88.17 446,586,340	92.73 469,718,469	8.250000 2032/03/31	0.91
11	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	21,400,000	93.86 511,638,495	84.48 460,524,794	10.000000 2029/01/01	0.89
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	60,500,000	93.46 439,750,910	94.98 446,933,402	7.500000 2027/06/03	0.86
13	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,800,000	80.05 398,702,719	85.03 423,499,932	8.500000 2037/01/31	0.82
14	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	18,000,000	96.76 443,669,340	90.92 416,888,799	10.000000 2027/01/01	0.81
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	54,730,000	94.28 401,320,136	94.77 403,410,400	8.500000 2029/05/31	0.78
16	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	53,000,000	94.68 390,270,815	94.70 390,366,054	8.500000 2029/03/01	0.75
17	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	52,000,000	93.53 378,259,118	95.72 387,141,860	7.000000 2026/09/03	0.75
18	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	106.96 388,119,805	106.67 387,074,755	7.500000 2028/07/25	0.75
19	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,900,000	101.83 389,186,124	100.94 385,761,919	6.000000 2033/10/25	0.75
20	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	62,620,000	80.52 392,169,090	76.85 374,299,941	7.750000 2042/11/13	0.72
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	87.27 365,524,294	88.59 371,052,958	2.750000 2029/10/25	0.72
22	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	85.76 369,537,438	84.58 364,448,909	7.500000 2033/05/26	0.70
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	80.38 336,324,388	85.28 356,851,975	9.000000 2040/01/31	0.69

24	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	96.23 342,339,274	96.20 342,232,552	6.375000 2032/04/15	0.66
25	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	76.61 309,518,955	81.18 328,014,945	8.750000 2044/01/31	0.63
26	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	54,800,000	80.58 343,444,733	75.87 323,355,039	8.000000 2053/07/31	0.62
27	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	48,000,000	86.20 321,796,355	83.82 312,927,152	7.750000 2034/11/23	0.60
28	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,190,000	94.79 299,712,057	96.19 304,125,585	2.500000 2026/07/25	0.59
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	26,920,000,000	109.07 287,744,111	108.66 286,678,294	8.375000 2034/03/15	0.55
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,400,000	77.35 280,697,416	78.83 286,064,181	1.250000 2030/10/25	0.55

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.06%
合計	97.06%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	チェコ・コロナ買/円売 2025年1月	買建	19,000,000	124,374,000	124,197,300	0.24%
		米ドル買/円売 2025年1 月	買建	800,000	126,422,640	126,432,000	0.24%
		メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	5,000,000	38,774,000	38,783,000	0.07%

	ポーランド・ズロチ買/ 円売 2025年1月	買建	500,000	18,274,410	19,259,400	0.04%
	南アフリカ・ランド買/ 円売 2025年1月	買建	5,500,000	45,922,375	46,491,250	0.09%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(8資産分散・保守型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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	10,752円
純資産総額	9百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.1%
3カ月間	1.7%
6カ月間	0.8%
1年間	5.6%
3年間	-
5年間	-
設定来	7.5%

※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 24年12月								
分配金	0円								

※分配金は、収益配分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。

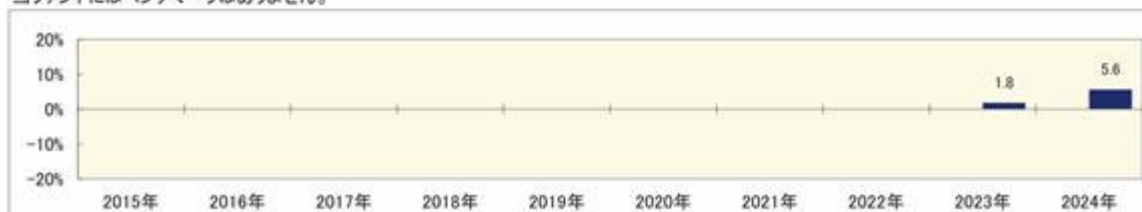
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	58.6%	国内債券	429	58.3%	日本円	76.3%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	1.5%
外国株式INDEXMF	15.1%	外国株式・先物	1,157	15.1%	米ドル	16.9%	APPLE INC	アメリカ	0.8%
トピックス・インデックス・MF	12.8%	国内株式・先物	2,091	12.8%	ユーロ	2.2%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.7%
ダイワJ-REIT MF	3.6%	外国債券	1,286	4.5%	英ポンド	0.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%
外国債券INDEXMF	3.3%	国内リート・先物	58	3.6%	カナダ・ドル	0.6%	トヨタ自動車	日本	0.5%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	2.1%	外国リート・先物	296	2.3%	オフショア人民元	0.5%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.5%
新興国株式インデックスMF	1.8%	外国投資信託等	6	1.6%	豪ドル	0.5%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	0.4%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	1.4%				スイス・フラン	0.3%	ソニーグループ	日本	0.4%
					メキシコ・ペソ	0.2%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%
		コール・ローン、その他		3.0%	その他	1.7%	日立	日本	0.3%
合計	98.7%	合計	5,323	-	合計	100.0%	合計		6.3%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(8資産分散・バランス型)】

(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		92,043,638	98.89
	内 日本	92,043,638	98.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,035,958	1.11
純資産総額		93,079,596	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)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	18,356,237	1.3090 24,029,258	1.3098 24,042,999	25.83
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,185,941	6.9800 22,237,943	7.2380 23,059,840	24.77
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,708,240	1.9946 19,364,346	2.0481 19,883,446	21.36
4	ダイワ・REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,261,014	3.1037 7,017,518	3.1195 7,053,233	7.58
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,795,602	3.6461 6,547,044	3.7621 6,755,234	7.26
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,288,910	4.1934 5,404,964	4.0931 5,275,637	5.67
7	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,613,461	1.8564 2,995,269	1.9297 3,113,495	3.34
8	新興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	2,400,533	1.1448 2,748,175	1.1913 2,859,754	3.07

(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	98.89%
合計	98.89%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,230,635	-	1.0238	-
2024年1月末日	5,447,446	-	1.0539	-
2月末日	11,202,575	-	1.0765	-
3月末日	18,185,352	-	1.1057	-
4月末日	25,328,982	-	1.1074	-
5月末日	34,356,716	-	1.1105	-
6月末日	41,896,327	-	1.1374	-
7月末日	49,815,930	-	1.1145	-
8月末日	57,711,450	-	1.1047	-
9月末日	66,364,841	-	1.1079	-
10月末日	77,099,198	-	1.1374	-
11月末日	84,141,669	-	1.1297	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	84,274,136	84,274,136	1.1315	1.1315
12月末日	93,079,596	-	1.1525	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.2

(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	75,863,991	2,382,789

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

新興国株式インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

● スタイル9(8資産分散・バランス型)

2024年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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	11,525円
純資産総額	93百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.0%
3カ月間	4.0%
6カ月間	1.3%
1年間	12.6%
3年間	-
5年間	-
設定来	15.3%

※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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
24年12月	0円									
分配金	0円									

※分配金は、収益配分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。分配金を支払わ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。

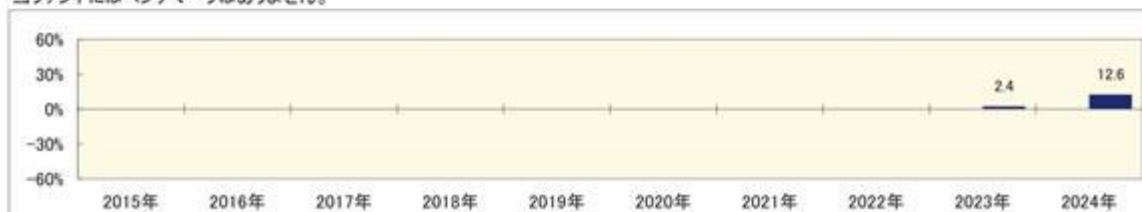
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	25.8%	国内債券	429	25.7%	日本円	55.9%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	2.6%
外国株式INDEXMF	24.8%	外国株式・先物	1,157	24.8%	米ドル	30.5%	APPLE INC	アメリカ	1.4%
トピックス・インデックス・MF	21.4%	国内株式・先物	2,091	21.3%	ユーロ	4.3%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.2%
ダイワJ-REIT MF	7.6%	外国債券	1,286	10.3%	英ポンド	1.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%
外国債券INDEXMF	7.3%	国内リート・先物	58	7.6%	オフショア人民元	1.2%	トヨタ自動車	日本	0.9%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	5.7%	外国リート・先物	296	6.0%	カナダ・ドル	1.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.8%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	3.3%	外国投資信託等	6	2.8%	豪ドル	1.0%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	0.7%
新興国株式インデックスMF	3.1%				スイス・フラン	0.6%	ソニーグループ	日本	0.6%
					メキシコ・ペソ	0.4%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		3.9%	その他	3.7%	日本ビルファンド	日本	0.5%
合計	98.9%	合計	5,323	-	合計	100.0%	合計		10.4%

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



*ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

*2023年は設定日(12月11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。

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。

【スタイル9(8資産分散・積極型)】

(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		163,953,644	98.63
	内 日本	163,953,644	98.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,278,749	1.37
純資産総額		166,232,393	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)

【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	10,004,389	6.9792 69,822,793	7.2380 72,411,767	43.56
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	28,718,143	1.9943 57,273,213	2.0481 58,817,628	35.38
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,027,039	3.6450 7,388,751	3.7621 7,625,923	4.59
4	新興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	6,193,630	1.1443 7,087,886	1.1913 7,378,471	4.44
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,317,858	4.1949 5,528,297	4.0931 5,394,124	3.24
6	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,666,878	1.3090 4,800,028	1.3098 4,802,876	2.89
7	ダイワ - REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,211,369	3.1033 3,759,309	3.1195 3,778,865	2.27
8	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,940,193	1.8557 3,600,445	1.9297 3,743,990	2.25

(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	98.63%
合計	98.63%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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)
2023年12月末日	1,178,165	-	1.0284	-
2024年1月末日	8,069,441	-	1.0832	-
2月末日	19,350,116	-	1.1258	-
3月末日	31,928,478	-	1.1686	-
4月末日	41,060,191	-	1.1746	-
5月末日	57,091,123	-	1.1910	-
6月末日	73,168,380	-	1.2337	-
7月末日	85,352,133	-	1.1949	-
8月末日	100,980,828	-	1.1708	-
9月末日	114,664,891	-	1.1740	-
10月末日	134,666,413	-	1.2257	-
11月末日	148,469,980	-	1.2206	-
第1計算期間末 (2024年12月2日)	149,155,387	149,155,387	1.2262	1.2262
12月末日	166,232,393	-	1.2621	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.6

(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	124,547,432	3,909,199

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

新興国株式インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●スタイル9(8資産分散・積極型)

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	12,621円
純資産総額	1.6億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.4%
3カ月間	7.5%
6カ月間	2.3%
1年間	22.7%
3年間	-
5年間	-
設定来	26.2%

※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 24年12月								
分配金	0円								

※分配金は、収益配分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。

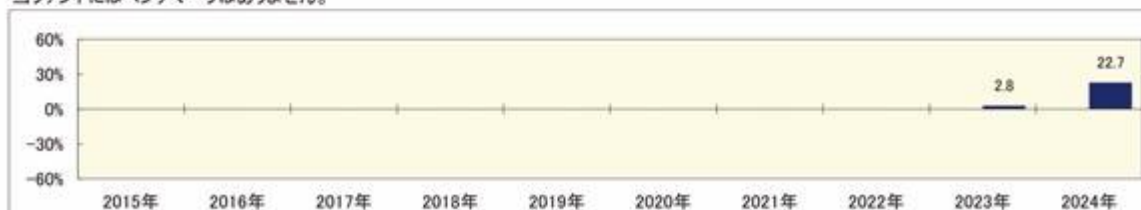
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	43.6%	外国株式・先物	1,157	43.5%	米ドル	43.4%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	3.8%
トピックス・インデックス・MF	35.4%	国内株式・先物	2,091	35.4%	日本円	41.9%	APPLE INC	アメリカ	2.4%
外国債券INDEXMF	4.6%	外国債券	1,286	6.7%	ユーロ	4.9%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.1%
新興国株式インデックスMF	4.4%	外国リート・先物	296	3.9%	英ポンド	1.9%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.9%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	3.2%	外国投資信託等	6	3.9%	カナダドル	1.5%	トヨタ自動車	日本	1.5%
日本債券INDEXMF	2.9%	国内債券	429	2.9%	豪ドル	1.1%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.3%
ダイワJ-REIT MF	2.3%	国内リート・先物	58	2.3%	スイス・フラン	1.0%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	1.2%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	2.3%				オフショア人民元	0.8%	ソニーグループ	日本	1.0%
					スウェーデン・クローネ	0.3%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.0%
		コール・ローン、その他		5.0%	その他	3.1%	日立	日本	0.9%
合計	98.6%	合計	5,323	-	合計	100.0%	合計		17.2%

※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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11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。

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
スタイル9(4資産分散・保守型)	0.80%	0.79%	0.01%
スタイル9(4資産分散・バランス型)	0.81%	0.79%	0.02%
スタイル9(4資産分散・積極型)	0.81%	0.79%	0.02%
スタイル9(6資産分散・保守型)	0.81%	0.79%	0.02%
スタイル9(6資産分散・バランス型)	0.81%	0.79%	0.02%
スタイル9(6資産分散・積極型)	0.81%	0.79%	0.02%
スタイル9(8資産分散・保守型)	0.81%	0.79%	0.01%
スタイル9(8資産分散・バランス型)	0.81%	0.79%	0.02%
スタイル9(8資産分散・積極型)	0.81%	0.79%	0.02%

※対象期間は2023年12月11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)をご覧ください。

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、次のイ．またはロ．に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

<4資産分散>

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

<6資産分散>

イ．ニューヨーク証券取引所またはオーストラリア証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．（4資産分散のロ．と同規定）

<8資産分散>

イ．ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日と同じ日付の日

ロ．（4資産分散のロ．と同規定）

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（当初自己設定については1万口当たり1万円）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、取得申込みの受け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る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、次のイ．またはロ．に掲げる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け付けを行ないません。

<4資産分散>

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

<6資産分散>

イ．ニューヨーク証券取引所またはオーストラリア証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．（4資産分散のロ．と同規定）

<8資産分散>

イ．ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日と同じ日付の日

ロ．（4資産分散のロ．と同規定）

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約請求の受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消することができるものとします。一部解約請求の受け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請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を

撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受付けたものとして、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。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) 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、2023年12月11日から2024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】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。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發します。
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、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。

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發します。
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。

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。

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。

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。

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、)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、)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】

【スタイル9(4資産分散・保守型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9(4資産分散・保守型)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		186,055
親投資信託受益証券		11,772,474
流動資産合計		11,958,529
資産合計		11,958,529
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		805
未払委託者報酬		29,489
その他未払費用		244
流動負債合計		30,538
負債合計		30,538
純資産の部		
元本等		
元本		11,116,731
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		811,260
(分配準備積立金)		163,994
元本等合計		11,927,991
純資産合計		11,927,991
負債純資産合計		11,958,529

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	15
有価証券売買等損益	212,574
営業収益合計	212,589
営業費用	
受託者報酬	1,004
委託者報酬	38,023
その他費用	426
営業費用合計	39,453
営業利益又は営業損失()	173,136
経常利益又は経常損失()	173,136
当期純利益又は当期純損失()	173,136
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()	9,142
剰余金増加額又は欠損金減少額	667,434
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	667,434
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,168
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,168
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	811,260

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	10,515,043円
期中一部解約元本額	398,312円
2. 計算期間末日における受益権の総数	11,116,731口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(11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(163,983円)、投資信託約款に規定される収益調整金(647,266円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は811,260円(1万口当たり729.76円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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	<p>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。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p>

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してあります。

(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1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）	
親投資信託受益証券		203,950
合計		203,950

(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1期 2024年12月2日現在	
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1期 自2023年12月11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1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)	1.0730円 (10,730円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	835,518	1,665,772	
	日本債券インデックスマザーファンド	5,455,841	7,141,150	
	外国株式インデックスマザーファンド	310,032	2,161,233	
	外国債券インデックスマザーファンド	220,791	804,319	
親投資信託受益証券 合計			11,772,474	
合計			11,772,474	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	

コール・ローン		25,585,460,365
株式	2 3	391,517,177,670
派生商品評価勘定		176,529,100
未収入金		62,700,000
未収配当金		2,027,187,340
その他未収収益	4	37,026,196
差入委託証拠金		284,044,537
流動資産合計		419,690,125,208
資産合計		419,690,125,208
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		20,967,200
前受金		17,562,000
未払金		444,285,079
未払解約金		46,343,940
未払利息		3,063,770
受入担保金		15,559,156,640
流動負債合計		16,091,378,629
負債合計		16,091,378,629
純資産の部		
元本等		
元本	1	202,433,131,578
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		201,165,615,001
元本等合計		403,598,746,579
純資産合計		403,598,746,579
負債純資産合計		419,690,125,208

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11日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	166,605,835,445円
期中追加設定元本額	52,806,206,952円
期中一部解約元本額	16,978,910,819円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックスファンド	2,769,295,099円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	3,756,385,932円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	904,928円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	8,959,470円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	133,303,700円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,283,120円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	308,944,173円

国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,175,871,836円
日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	863,762,165円
アセット・アロケーションファンド(リスク判断付き)2023-07(適格機関投資家専用)	1,591,364,318円
D-I's TOPIXインデックス	11,681,440円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	249,887,779円
iFree TOPIXインデックス	9,987,610,465円
iFree 8資産バランス	5,194,586,600円
iFree 年金バランス	1,226,436,928円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	4,267,029円
DCダイワ日本株式インデックス	73,323,264,253円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,984,565,474円
ダイワ・ライフ・バランス50	5,200,504,890円
ダイワ・ライフ・バランス70	6,246,948,097円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,605,345,409円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	50,268,884円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	76,509,117円
ダイワつみたてインデックス日本株式	6,548,376,674円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,566,747円
ダイワつみたてインデックスバランス50	14,112,652円
ダイワつみたてインデックスバランス70	74,843,139円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	23,412,332,129円
ダイワ世界バランスファンド40VA	47,104,361円
ダイワ世界バランスファンド60VA	19,806,181円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,013,743,783円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	280,960,285円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	39,319,630円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	55,931,105円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	243,752,682円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	15,501,409,759円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	14,241,732,223円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,514,898,479円
スタイル9(4資産分散・保守型)	835,518円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	6,046,890円
スタイル9(4資産分散・積極型)	8,560,607円
スタイル9(6資産分散・保守型)	362,454円

	スタイル9(6資産分散・バランス型)	11,046,182円
	スタイル9(6資産分散・積極型)	12,686,752円
	スタイル9(8資産分散・保守型)	560,029円
	スタイル9(8資産分散・バランス型)	8,978,957円
	スタイル9(8資産分散・積極型)	27,048,309円
	ダイワ国内株式インデックス(投資一任専用)	5,000,018円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	994,378,310円
	ダイワライフスタイル25	93,262,550円
	ダイワライフスタイル50	433,705,855円
	ダイワライフスタイル75	379,825,506円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	7,647,992,706円
	計	202,433,131,578円
2.	期末日における受益権の総数	202,433,131,578口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 14,884,104,090円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 997,940,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	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	13,137,588,921
合計	13,137,588,921

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年12月2日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株値指数 先物取引				
買建	12,908,783,000	-	13,064,610,000	155,827,000
合計	12,908,783,000	-	13,064,610,000	155,827,000

(注) 1. 時価の算定方法

株値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. 株値指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.9937円
(1万口当たり純資産額)	(19,937円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)	備考
----	-----	--------	----

		単価	金額	
極 洋	5,900	3,970.00	23,423,000	
ニッセイ	141,300	938.90	132,666,570	
マルハニチロ	21,000	3,012.00	63,252,000	
雪国まいたけ	12,000	1,040.00	12,480,000	
カネコ種苗	4,000	1,374.00	5,496,000	
サカタのタネ	15,700	3,410.00	53,537,000	
ホクト	12,600	1,742.00	21,949,200	
ホクリヨウ	300	1,100.00	330,000	貸付株式数 200株
ショーボンドHD	18,600	5,185.00	96,441,000	
ミライト・ワン	46,200	2,149.00	99,283,800	貸付株式数 6,300株
タマホーム	8,900	3,605.00	32,084,500	貸付株式数 3,400株
サンヨーホームズ	200	710.00	142,000	貸付株式数 100株 (100株)
日本アクア	800	783.00	626,400	
ファーストコーポレーション	500	806.00	403,000	貸付株式数 400株
ベステラ	400	998.00	399,200	貸付株式数 300株 (300株)
キャンディル	300	551.00	165,300	貸付株式数 100株
住石ホールディングス	15,500	842.00	13,051,000	貸付株式数 7,500株
日鉄鉱業	5,700	4,180.00	23,826,000	
三井松島HLDGS	6,900	3,435.00	23,701,500	貸付株式数 2,700株
I N P E X	427,100	1,991.50	850,569,650	
石油資源開発	77,500	1,091.00	84,552,500	
K&Oエナジーグループ	6,400	3,360.00	21,504,000	
リョーサン菱洋HD	18,000	2,276.00	40,968,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,263.00	505,200	貸付株式数 300株
第一カッター興業	4,100	1,446.00	5,928,600	
明豊ファシリティワークス	600	858.00	514,800	
安藤・間	81,900	1,163.00	95,249,700	
東急建設	44,300	690.00	30,567,000	
コムシスホールディングス	50,100	3,296.00	165,129,600	
ピーアールホールディングス	20,700	336.00	6,955,200	
高松コンストラクションGP	10,500	2,626.00	27,573,000	
東建コーポレーション	3,600	11,090.00	39,924,000	
ソネック	200	835.00	167,000	貸付株式数 100株
ヤマウラ	7,200	1,167.00	8,402,400	貸付株式数 2,300株

オリエンタル白石	52,300	386.00	20,187,800	
大成建設	89,700	6,623.00	594,083,100	
大林組	326,300	2,141.00	698,608,300	
清水建設	280,300	1,190.50	333,697,150	
長谷工コーポレーション	90,700	2,022.50	183,440,750	貸付株式数 4,000株
松井建設	9,200	844.00	7,764,800	貸付株式数 3,400株
銭高組	100	3,790.00	379,000	
鹿島建設	219,200	2,762.50	605,540,000	
不動テトラ	6,200	2,042.00	12,660,400	貸付株式数 2,400株
大末建設	500	1,588.00	794,000	
鉄建建設	6,500	2,261.00	14,696,500	
西松建設	15,800	5,085.00	80,343,000	
三井住友建設	79,700	405.00	32,278,500	
大豊建設	2,700	3,315.00	8,950,500	
佐田建設	700	971.00	679,700	
ナカノフドー建設	900	659.00	593,100	
奥村組	17,500	3,855.00	67,462,500	貸付株式数 6,800株
東鉄工業	10,900	3,200.00	34,880,000	
イチケン	300	2,540.00	762,000	
富士ピー・エス	500	402.00	201,000	貸付株式数 400株
浅沼組	39,600	642.00	25,423,200	
戸田建設	121,600	936.80	113,914,880	貸付株式数 17,600株
熊谷組	16,300	3,580.00	58,354,000	
北野建設	200	4,080.00	816,000	
植木組	300	1,536.00	460,800	
矢作建設	13,400	1,477.00	19,791,800	
ピーエス・コンストラクション	7,200	1,042.00	7,502,400	
日本ハウスHLDGS	21,100	335.00	7,068,500	貸付株式数 8,100株
大東建託	33,800	16,880.00	570,544,000	
新日本建設	13,900	1,510.00	20,989,000	
東亜道路	17,100	1,279.00	21,870,900	貸付株式数 5,200株
日本道路	9,900	1,743.00	17,255,700	
東亜建設	29,800	1,178.00	35,104,400	
日本国土開発	28,100	507.00	14,246,700	貸付株式数 10,800株
若築建設	2,900	3,640.00	10,556,000	
東洋建設	28,500	1,279.00	36,451,500	
五洋建設	129,400	616.50	79,775,100	
世紀東急	14,100	1,506.00	21,234,600	貸付株式数 5,500株
福田組	3,700	5,290.00	19,573,000	貸付株式数 1,400株

日本ドライケミカル	300	3,855.00	1,156,500	貸付株式数	100株
住友林業	85,400	5,640.00	481,656,000		
日本基礎技術	800	597.00	477,600		
巴コーポレーション	1,200	1,026.00	1,231,200		
大和ハウス	298,300	4,743.00	1,414,836,900		
ライト工業	20,100	2,188.00	43,978,800		
積水ハウス	299,900	3,584.00	1,074,841,600		
日特建設	9,400	989.00	9,296,600		
北陸電気工事	6,800	1,103.00	7,500,400		
ユアテック	19,100	1,423.00	27,179,300		
日本リーテック	7,700	1,141.00	8,785,700	貸付株式数	2,900株
四電工	12,400	1,475.00	18,290,000		
中電工	15,300	3,370.00	51,561,000		
関電工	54,200	2,223.00	120,486,600		
きんでん	68,700	3,098.00	212,832,600		
東京エネシス	10,500	1,046.00	10,983,000		
トーエネック	16,400	966.00	15,842,400		
住友電設	8,100	4,810.00	38,961,000		
日本電設工業	18,600	1,903.00	35,395,800		
エクシオグループ	104,700	1,741.00	182,282,700	貸付株式数	41,300株
新日本空調	6,400	3,945.00	25,248,000		
九電工	21,400	5,182.00	110,894,800		
三機工業	20,600	2,836.00	58,421,600		
日揮ホールディングス	97,800	1,300.50	127,188,900		
中外炉工業	3,200	3,285.00	10,512,000		
ヤマト	1,000	1,198.00	1,198,000	貸付株式数	400株
太平電業	6,300	4,975.00	31,342,500	貸付株式数	700株
高砂熱学	23,800	6,000.00	142,800,000		
三晃金属	100	4,330.00	433,000		
NECネットエスアイ	37,900	3,255.00	123,364,500		
朝日工業社	9,200	1,939.00	17,838,800		
明星工業	17,000	1,335.00	22,695,000		
大気社	12,700	4,720.00	59,944,000		
ダイダン	13,000	3,600.00	46,800,000		
日比谷総合設備	8,100	3,975.00	32,197,500		
ニッポン	32,700	2,130.00	69,651,000	貸付株式数	12,000株
日清製粉G本社	103,200	1,843.50	190,249,200		
日東富士製粉	1,800	6,570.00	11,826,000		
昭和産業	8,400	2,787.00	23,410,800		
鳥越製粉	1,000	687.00	687,000		

中部飼料	13,700	1,312.00	17,974,400	
フィード・ワン	14,500	799.00	11,585,500	
東洋精糖	200	1,436.00	287,200	
日本甜菜糖	5,200	2,386.00	12,407,200	貸付株式数 2,100株
DM三井製糖ホールディ	9,800	3,190.00	31,262,000	
塩水港精糖	1,500	304.00	456,000	貸付株式数 200株
ウェルネオシュガー	5,900	2,158.00	12,732,200	
L I F U L L	25,300	190.00	4,807,000	
M I X I	19,500	2,793.00	54,463,500	
ジェイエイシーリクルート メント	37,400	692.00	25,880,800	
日本M&Aセンターホールデ	152,400	635.40	96,834,960	
メンバーズ	4,000	1,035.00	4,140,000	
中広	200	436.00	87,200	
U T グループ	13,500	2,033.00	27,445,500	貸付株式数 5,200株
アイティメディア	5,600	1,505.00	8,428,000	貸付株式数 100株
ケアネット	21,200	589.00	12,486,800	貸付株式数 3,400株
E・Jホールディングス	6,100	1,663.00	10,144,300	
オープンアップグループ	31,100	1,811.00	56,322,100	
コシダカホールディングス	31,400	1,133.00	35,576,200	貸付株式数 12,200株
アルトナー	500	1,867.00	933,500	貸付株式数 400株
パソナグループ	12,600	1,965.00	24,759,000	貸付株式数 2,200株
C D S	300	1,825.00	547,500	
リンクアンドモチベーショ ン	25,500	547.00	13,948,500	貸付株式数 9,600株
エス・エム・エス	39,600	1,678.00	66,448,800	
サニーサイドアップG	400	575.00	230,000	
パーソルホールディングス	966,800	232.40	224,684,320	
リニカル	800	344.00	275,200	
クックパッド	28,300	158.00	4,471,400	貸付株式数 10,900株
エスクリ	500	187.00	93,500	貸付株式数 200株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホール ディンク	800	722.00	577,600	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	41,500	2,783.00	115,494,500	
中村屋	2,500	3,195.00	7,987,500	
江崎グリコ	28,400	4,427.00	125,726,800	
名糖産業	4,400	1,935.00	8,514,000	貸付株式数 1,400株
井村屋グループ	5,400	2,420.00	13,068,000	
不二家	6,800	2,671.00	18,162,800	貸付株式数 2,600株

山崎製パン	66,400	2,832.00	188,044,800	
第一屋製パン	300	586.00	175,800	貸付株式数 200株
モロゾフ	3,200	4,430.00	14,176,000	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	6,300	4,175.00	26,302,500	貸付株式数 2,400株
寿スピリッツ	58,700	2,148.00	126,087,600	貸付株式数 23,200株
カルビー	45,400	3,170.00	143,918,000	貸付株式数 3,000株
森永乳業	38,100	2,932.00	111,709,200	
六甲バター	7,300	1,393.00	10,168,900	貸付株式数 2,200株
ヤクルト	141,800	3,078.00	436,460,400	貸付株式数 1,400株
明治ホールディングス	132,700	3,206.00	425,436,200	
雪印メグミルク	26,700	2,736.00	73,051,200	
プリマハム	13,300	2,173.00	28,900,900	
日本ハム	42,700	5,146.00	219,734,200	
林兼産業	400	463.00	185,200	貸付株式数 300株
丸大食品	10,000	1,707.00	17,070,000	貸付株式数 3,700株
S Foods	10,900	2,656.00	28,950,400	貸付株式数 4,300株
柿安本店	3,900	2,759.00	10,760,100	貸付株式数 1,200株
伊藤ハム米久HLDGS	15,200	3,790.00	57,608,000	
学情	5,300	1,761.00	9,333,300	
スタジオアリス	5,200	2,090.00	10,868,000	貸付株式数 1,800株 (800株)
クロスキャット	5,800	1,063.00	6,165,400	貸付株式数 1,600株
エプコ	300	783.00	234,900	
システナ	144,500	356.00	51,442,000	
N J S	2,600	3,685.00	9,581,000	貸付株式数 1,000株
デジタルアーツ	6,400	5,920.00	37,888,000	貸付株式数 2,500株
日鉄ソリューションズ	34,500	4,115.00	141,967,500	貸付株式数 13,600株
総合警備保障	173,100	1,133.50	196,208,850	貸付株式数 68,300株
キューブシステム	5,300	1,039.00	5,506,700	貸付株式数 1,600株
いちご	84,000	367.00	30,828,000	
日本駐車場開発	118,100	224.00	26,454,400	
コア	4,500	1,813.00	8,158,500	
カカクコム	74,700	2,499.50	186,712,650	貸付株式数 29,500株
アイロムグループ	4,200	2,573.00	10,806,600	
セントケア・ホールディング	6,600	741.00	4,890,600	貸付株式数 2,000株
グ				
サイネックス	200	739.00	147,800	貸付株式数 100株
ルネサンス	8,100	1,019.00	8,253,900	貸付株式数 2,700株
ディップ	18,100	2,528.00	45,756,800	貸付株式数 6,800株

SBSホールディングス	9,000	2,472.00	22,248,000	
デジタルホールディングス	5,300	1,242.00	6,582,600	
新日本科学	11,000	1,617.00	17,787,000	貸付株式数 4,200株
キャリアデザインセンター	200	1,808.00	361,600	
エムスリー	204,800	1,491.00	305,356,800	貸付株式数 80,800株
ツカダ・グローバルHOLD	900	444.00	399,600	貸付株式数 600株
プラス	200	537.00	107,400	貸付株式数 100株
ウェルネット	1,000	864.00	864,000	
ワールドホールディングス	4,100	2,087.00	8,556,700	貸付株式数 1,600株
ディー・エヌ・エー	41,400	2,437.50	100,912,500	
博報堂D Y HLDGS	117,500	1,142.50	134,243,750	貸付株式数 49,700株
ぐるなび	19,200	312.00	5,990,400	貸付株式数 7,400株
タカミヤ	14,000	414.00	5,796,000	
ファンコミュニケーションズ	14,500	417.00	6,046,500	
ライク	3,900	1,381.00	5,385,900	貸付株式数 1,400株 (1,200株)
A o b a B B T	500	317.00	158,500	貸付株式数 400株
エスプール	32,700	315.00	10,300,500	貸付株式数 12,900株
WDBホールディングス	5,300	1,684.00	8,925,200	貸付株式数 1,800株
手間いらず	1,700	3,450.00	5,865,000	貸付株式数 600株
ティア	800	427.00	341,600	貸付株式数 300株
アドウェイズ	12,700	320.00	4,064,000	
パリュウコマース	9,100	1,137.00	10,346,700	
インフォマート	97,900	279.00	27,314,100	貸付株式数 1,800株
サッポロホールディングス	32,700	8,855.00	289,558,500	
アサヒグループホールディングン	745,200	1,615.00	1,203,498,000	
キリンHD	413,400	2,113.50	873,720,900	
シマダヤ	2,900	1,437.00	4,167,300	
宝ホールディングス	66,900	1,289.50	86,267,550	貸付株式数 9,300株
オエノンホールディングス	32,100	414.00	13,289,400	
養命酒	3,300	2,516.00	8,302,800	
飛島ホールディングス	10,100	1,566.00	15,816,600	
コカ・コーラボトラーズJHD	70,000	2,429.00	170,030,000	
サントリー食品インター	69,900	5,132.00	358,726,800	
ダイドーグループHD	11,200	3,465.00	38,808,000	貸付株式数 4,300株
伊藤園	33,200	3,300.00	109,560,000	
キーコーヒー	11,100	2,063.00	22,899,300	貸付株式数 4,200株
ユニカフェ	400	945.00	378,000	貸付株式数 300株

日清オイリオグループ	14,000	5,030.00	70,420,000	
不二製油グループ	19,800	3,517.00	69,636,600	
かどや製油	100	3,585.00	358,500	
J - オイルミルズ	11,400	2,168.00	24,715,200	
サンエー	18,100	2,722.00	49,268,200	貸付株式数 2,600株
カワチ薬品	8,300	2,539.00	21,073,700	
エーピーシー・マート	46,700	3,117.00	145,563,900	
ハードオフコーポレーション	4,200	1,789.00	7,513,800	
高千穂交易	4,200	3,815.00	16,023,000	貸付株式数 1,600株
アスクル	25,200	1,863.00	46,947,600	貸付株式数 200株
ゲオホールディングス	12,000	1,620.00	19,440,000	
アダストリア	14,700	3,665.00	53,875,500	
ジーフット	1,000	283.00	283,000	貸付株式数 900株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	522.00	104,400	貸付株式数 100株
オルバヘルスケアHLDGS	200	1,958.00	391,600	
伊藤忠食品	2,400	6,980.00	16,752,000	
くら寿司	12,500	3,880.00	48,500,000	貸付株式数 200株
キャンドウ	3,800	3,335.00	12,673,000	貸付株式数 1,400株
エレマテック	9,400	2,396.00	22,522,400	
IKホールディングス	400	382.00	152,800	貸付株式数 300株
パルグループHLDGS	24,400	3,250.00	79,300,000	
エディオン	46,400	1,799.00	83,473,600	
あらた	16,300	3,040.00	49,552,000	貸付株式数 2,900株
サーラコーポレーション	22,400	803.00	17,987,200	貸付株式数 8,400株
ワッツ	500	678.00	339,000	貸付株式数 400株
トーメンデバイス	1,500	6,680.00	10,020,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,200	4,045.00	16,989,000	
JPホールディングス	26,500	627.00	16,615,500	貸付株式数 10,400株
フジオフードG本社	12,000	1,207.00	14,484,000	貸付株式数 4,600株 (300株)
あみやき亭	7,700	1,622.00	12,489,400	貸付株式数 3,000株
東京エレクトロニクスデバイス	10,600	3,110.00	32,966,000	
ひらまつ	2,700	168.00	453,600	貸付株式数 1,000株
円谷フィールズホールディ	17,300	2,195.00	37,973,500	貸付株式数 6,800株
双日	118,700	3,084.00	366,070,800	
アルフレッサホールディングス	99,400	2,189.50	217,636,300	
大黒天物産	3,300	9,870.00	32,571,000	貸付株式数 1,200株

ハニーズホールディングス	9,500	1,650.00	15,675,000	貸付株式数	3,300株
ファーマライズHD	300	601.00	180,300	貸付株式数	100株
キッコーマン	328,800	1,640.00	539,232,000	貸付株式数	14,500株
味の素	229,900	6,360.00	1,462,164,000	貸付株式数	32,600株
ブルドックソ - ス	5,300	1,841.00	9,757,300		
キューピー	53,300	3,480.00	185,484,000	貸付株式数	14,100株
ハウス食品G本社	33,400	2,851.50	95,240,100		
カゴメ	42,500	2,985.00	126,862,500		
アリアケジャパン	9,900	5,460.00	54,054,000	貸付株式数	3,900株
ピエトロ	200	1,742.00	348,400	貸付株式数	100株
エバラ食品工業	2,700	2,855.00	7,708,500		
やまみ	200	4,010.00	802,000	貸付株式数	100株
ニチレイ	40,400	4,278.00	172,831,200		
横浜冷凍	26,800	804.00	21,547,200		
東洋水産	46,000	10,745.00	494,270,000		
イトアアンドHLDGS	5,100	2,133.00	10,878,300	貸付株式数	1,900株
大冷	200	1,900.00	380,000		
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,400	1,333.00	7,198,200	貸付株式数	800株
日清食品HD	127,900	4,014.00	513,390,600	貸付株式数	50,500株
一正蒲鉾	500	734.00	367,000	貸付株式数	200株 (200株)
フジッコ	10,200	1,718.00	17,523,600	貸付株式数	3,800株
ロックフィールド	12,100	1,491.00	18,041,100	貸付株式数	4,700株
日本たばこ産業	603,000	4,221.00	2,545,263,000		
ケンコーマヨネーズ	6,200	2,129.00	13,199,800		
わらべや日洋HD	6,600	1,987.00	13,114,200	貸付株式数	400株
なとり	6,200	2,112.00	13,094,400		
イフジ産業	200	1,658.00	331,600	貸付株式数	100株
ファーマフーズ	13,200	984.00	12,988,800	貸付株式数	5,200株
北の達人コーポ	42,700	145.00	6,191,500	貸付株式数	16,800株 (1,300株)
ユーグレナ	61,700	400.00	24,680,000	貸付株式数	23,800株 (600株)
紀文食品	8,600	1,100.00	9,460,000	貸付株式数	1,700株
ピクルスホールディングス	5,800	1,032.00	5,985,600	貸付株式数	1,900株
スター・マイカ・HLDGS	10,300	674.00	6,942,200		
SREホールディングス	3,700	3,295.00	12,191,500	貸付株式数	1,600株
ADワークスグループ	2,700	210.00	567,000	貸付株式数	100株

片倉工業	9,300	1,992.00	18,525,600	貸付株式数	3,600株
グンゼ	7,200	5,180.00	37,296,000		
ヒューリック	231,500	1,390.00	321,785,000		
神栄	200	1,580.00	316,000		
ラサ商事	5,900	1,348.00	7,953,200	貸付株式数	900株
アルペン	8,800	2,006.00	17,652,800	貸付株式数	3,400株
ハブ	400	731.00	292,400	貸付株式数	300株
ラクーンホールディングス	7,500	690.00	5,175,000	貸付株式数	400株
クオールホールディングス	13,200	1,474.00	19,456,800		
アルコニックス	15,200	1,474.00	22,404,800		
神戸物産	82,500	3,708.00	305,910,000		
ソリトンシステムズ	5,200	1,158.00	6,021,600		
ジズホールディングス	8,100	6,010.00	48,681,000	貸付株式数	3,200株
ビックカメラ	63,800	1,664.00	106,163,200	貸付株式数	25,200株
DCMホールディングス	55,200	1,410.00	77,832,000	貸付株式数	11,200株
ペッパーフードサービス	31,500	197.00	6,205,500	貸付株式数	12,200株
ハイパー	300	287.00	86,100		
Monotaro	151,200	2,670.50	403,779,600		
東京一番フーズ	300	500.00	150,000		
DDグループ	800	1,300.00	1,040,000	貸付株式数	700株
あいホールディングス	17,100	2,098.00	35,875,800		
ディー・ブイエックス	200	883.00	176,600		
きちりホールディングス	400	889.00	355,600	貸付株式数	300株
J. フロントリテイリング	122,400	1,803.00	220,687,200		
ドトール・日レスHD	18,900	2,274.00	42,978,600		
マツキヨココカラ&カンパニー	188,000	2,124.50	399,406,000	貸付株式数	60,900株
ブロンコビリー	6,300	3,850.00	24,255,000	貸付株式数	2,400株
ZOZO	79,300	4,740.00	375,882,000		
トレジャー・ファクトリー	7,300	1,283.00	9,365,900	貸付株式数	2,800株
物語コーポレーション	19,000	3,585.00	68,115,000	貸付株式数	7,200株
三越伊勢丹HD	161,800	2,167.50	350,701,500	貸付株式数	66,400株
東洋紡	43,600	927.00	40,417,200	貸付株式数	17,200株
ユニチカ	32,700	194.00	6,343,800	貸付株式数	12,900株
富士紡ホールディングス	4,000	5,450.00	21,800,000		
日清紡ホールディングス	76,500	877.40	67,121,100		
倉敷紡績	7,200	5,670.00	40,824,000		
ダイワボウHD	47,200	3,084.00	145,564,800		
シキボウ	7,200	993.00	7,149,600	貸付株式数	1,800株

日東紡績	11,400	5,840.00	66,576,000	
トヨタ紡織	42,400	1,918.00	81,323,200	
マクニカホールディングス	82,600	1,784.00	147,358,400	貸付株式数 13,300株
H a m e e	4,300	1,072.00	4,609,600	
マーケットエンタープライズ	100	831.00	83,100	
ラクト・ジャパン	4,500	2,903.00	13,063,500	貸付株式数 1,700株
ウエルシアHD	55,300	1,924.00	106,397,200	
クリエイトSDH	15,100	2,874.00	43,397,400	貸付株式数 5,600株
グリムス	4,500	2,681.00	12,064,500	貸付株式数 1,700株
バイタルKSKHD	14,700	1,233.00	18,125,100	
八洲電機	8,600	1,591.00	13,682,600	貸付株式数 3,200株
メディアスホールディングス	6,200	785.00	4,867,000	貸付株式数 2,300株
レスター	9,100	2,380.00	21,658,000	
ジオリーブグループ	300	1,051.00	315,300	
丸善CHI HD	1,700	319.00	542,300	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
大光	600	585.00	351,000	貸付株式数 500株
OCHIホールディングス	300	1,306.00	391,800	
TOKAIホールディングス	57,900	918.00	53,152,200	貸付株式数 22,300株
黒谷	300	553.00	165,900	貸付株式数 100株
ミサワ	200	682.00	136,400	
ティーライフ	200	1,203.00	240,600	貸付株式数 100株
C o m i n i x	200	874.00	174,800	
エー・ピーホールディングス	300	929.00	278,700	貸付株式数 200株
三洋貿易	10,900	1,530.00	16,677,000	
チムニー	400	1,241.00	496,400	貸付株式数 300株
シュッピン	10,500	1,008.00	10,584,000	貸付株式数 3,700株
ビューティガレージ	3,400	1,393.00	4,736,200	貸付株式数 1,200株
オイシックス・ラ・大地	17,200	1,516.00	26,075,200	貸付株式数 6,800株
ウイン・パートナーズ	7,800	1,237.00	9,648,600	貸付株式数 2,300株
ネクステージ	24,400	1,396.00	34,062,400	貸付株式数 9,600株
ジョイフル本田	29,600	1,796.00	53,161,600	貸付株式数 11,600株
エターナルホスピタリティ グル	3,900	3,250.00	12,675,000	
ホットランド	8,200	2,134.00	17,498,800	貸付株式数 3,000株 (200株)
すかいらーくHD	145,800	2,305.00	336,069,000	貸付株式数 57,600株

SFPホールディングス	6,000	1,917.00	11,502,000	貸付株式数	2,300株
綿半ホールディングス	8,300	1,522.00	12,632,600	貸付株式数	3,200株
日本毛織	25,900	1,258.00	32,582,200		
ダイトウボウ	2,000	102.00	204,000	貸付株式数	1,800株
トーア紡コーポレーション	500	410.00	205,000	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	1,100	883.00	971,300	貸付株式数	1,000株
ヨシックスホールディングス	3,500	3,170.00	11,095,000		
ユナイテッド・スーパーマケ	45,258	850.00	38,469,300	貸付株式数	13,400株 (300株)
野村不動産HLDGS	62,200	3,745.00	232,939,000		
三重交通グループHD	21,200	499.00	10,578,800	貸付株式数	7,600株
地主	8,800	2,130.00	18,744,000	貸付株式数	3,400株
プレサンスコーポレーション	13,200	1,860.00	24,552,000	貸付株式数	4,900株
フィル・カンパニー	2,000	1,008.00	2,016,000	貸付株式数	700株
ハウスコム	200	1,330.00	266,000	貸付株式数	100株
J P M C	5,700	1,159.00	6,606,300		
サンセイランディック	400	953.00	381,200	貸付株式数	300株
エストラスト	100	690.00	69,000		
フージャースHD	15,300	1,012.00	15,483,600		
オープンハウスグループ	36,400	5,550.00	202,020,000	貸付株式数	13,600株
東急不動産HD	298,400	995.80	297,146,720	貸付株式数	6,700株
飯田GH D	95,100	2,258.00	214,735,800		
イーグランド	200	1,370.00	274,000	貸付株式数	100株
帝国繊維	11,400	2,456.00	27,998,400	貸付株式数	4,400株
日本コークス工業	102,600	95.00	9,747,000	貸付株式数	40,000株
ゴルフダイジェスト・オン	6,200	394.00	2,442,800	貸付株式数	2,400株
ミタチ産業	400	1,189.00	475,600	貸付株式数	300株
B E E N O S	6,700	3,655.00	24,488,500	貸付株式数	2,400株
あさひ	8,900	1,581.00	14,070,900		
日本調剤	7,000	1,437.00	10,059,000	貸付株式数	2,300株
コスモス薬品	18,100	7,442.00	134,700,200		
シップヘルスケアHD	42,200	2,204.00	93,008,800		
トーエル	500	771.00	385,500	貸付株式数	100株
ソフトクリエイイトHD	7,300	2,227.00	16,257,100		
セブン&アイ・HLDGS	1,178,000	2,606.00	3,069,868,000		
クリエイイト・レストランツ・ホール	80,200	1,176.00	94,315,200	貸付株式数	31,600株
明治電機工業	4,000	1,385.00	5,540,000		

ツルハホールディングス	22,400	8,248.00	184,755,200	
デリカフーズHLDGS	500	499.00	249,500	
スターティアホールディングス	400	2,181.00	872,400	貸付株式数 300株
サンマルクホールディングス	8,600	2,532.00	21,775,200	
フェリシモ	300	838.00	251,400	
トリドールホールディングス	30,000	3,717.00	111,510,000	貸付株式数 11,800株
帝人	97,000	1,321.00	128,137,000	
東レ	737,900	962.70	710,376,330	
クラレ	147,100	2,075.50	305,306,050	
旭化成	683,000	1,067.50	729,102,500	
TOKYO BASE	11,400	286.00	3,260,400	貸付株式数 4,400株
稲葉製作所	5,800	1,760.00	10,208,000	貸付株式数 700株
宮地エンジニアリングG	12,500	1,881.00	23,512,500	貸付株式数 3,300株
トーカロ	30,000	1,773.00	53,190,000	
アルファCO	400	1,048.00	419,200	
SUMCO	198,000	1,201.50	237,897,000	貸付株式数 78,200株
川田テクノロジーズ	6,700	2,702.00	18,103,400	
RS TECHNOLOGIES	8,000	3,275.00	26,200,000	
ジェイテックコーポレーション	200	1,360.00	272,000	
信和	800	749.00	599,200	貸付株式数 700株
ビーロッド	700	1,506.00	1,054,200	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	300	999.00	299,700	
AND DOホールディングス	6,000	988.00	5,928,000	貸付株式数 300株
シーアールイー	4,400	1,217.00	5,354,800	
ケイアイスター不動産	5,400	4,235.00	22,869,000	貸付株式数 300株
アグレ都市デザイン	300	1,590.00	477,000	貸付株式数 200株
ジェイ・エス・ビー	4,100	2,749.00	11,270,900	
ロードスターキャピタル	5,700	2,502.00	14,261,400	
イノベーションホールディングク	400	925.00	370,000	貸付株式数 200株
グローバルリンクマネジメント	200	2,860.00	572,000	貸付株式数 100株
フェイスネットワーク	400	1,650.00	660,000	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	4,100	12,360.00	50,676,000	貸付株式数 1,600株
SUMINOE	300	1,967.00	590,100	貸付株式数 200株 (200株)

日本フェルト	600	478.00	286,800	
イチカワ	100	1,535.00	153,500	
エコナックホールディングス	1,100	115.00	126,500	貸付株式数 1,000株
日東製網	200	1,466.00	293,200	貸付株式数 100株
芦森工業	200	2,472.00	494,400	
アツギ	800	995.00	796,000	
ウイルプラスHLDGS	200	973.00	194,600	
JMホールディングス	7,700	2,694.00	20,743,800	
コメダホールディングス	27,900	2,873.00	80,156,700	
サツドラホールディングス	500	778.00	389,000	貸付株式数 400株
アレンザホールディングス	8,000	1,068.00	8,544,000	貸付株式数 3,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,200	1,431.00	4,579,200	貸付株式数 1,200株 (300株)
バロックジャパン	12,400	785.00	9,734,000	貸付株式数 4,900株
クスリのアオキHLDGS	35,600	3,435.00	122,286,000	
ダイニック	400	749.00	299,600	
共和レザー	700	635.00	444,500	
ピーバンドットコム	200	429.00	85,800	貸付株式数 100株
力の源HD	8,000	1,016.00	8,128,000	貸付株式数 3,100株
FOOD&LIFE COMPAN	56,900	3,437.00	195,565,300	
アセンテック	4,100	850.00	3,485,000	
セーレン	19,500	2,774.00	54,093,000	
ソトー	300	677.00	203,100	貸付株式数 100株
東海染工	100	694.00	69,400	
小松マテーレ	14,600	794.00	11,592,400	
ワコールホールディングス	20,900	5,091.00	106,401,900	
ホギメディカル	13,600	4,785.00	65,076,000	貸付株式数 5,300株
クラウディアHLDGS	300	341.00	102,300	貸付株式数 200株
T S Iホールディングス	31,900	890.00	28,391,000	貸付株式数 12,600株
マツオカコーポレーション	300	1,914.00	574,200	
ワールド	15,600	2,239.00	34,928,400	貸付株式数 3,800株
T I S	106,800	3,690.00	394,092,000	貸付株式数 28,500株
テクミラホールディングス	600	315.00	189,000	貸付株式数 500株
グリー	33,900	428.00	14,509,200	
GMOペパボ	1,200	1,600.00	1,920,000	貸付株式数 200株
コーエーテクモHD	76,000	1,760.50	133,798,000	貸付株式数 29,900株
三菱総合研究所	5,000	4,370.00	21,850,000	

ボルテージ	300	229.00	68,700	貸付株式数	100株
電算	100	1,420.00	142,000		
A G S	500	803.00	401,500	貸付株式数	400株
ファインデックス	8,000	781.00	6,248,000	貸付株式数	3,000株
ブレインパッド	8,400	1,016.00	8,534,400		
K L a b	25,500	174.00	4,437,000	貸付株式数	6,100株
ポールトゥウィンホール ディン	14,400	466.00	6,710,400		
ネクソン	222,100	2,111.50	468,964,150		
アイスタイル	33,800	422.00	14,263,600	貸付株式数	13,200株
エムアップホールディング ス	12,400	1,623.00	20,125,200		
エイチーム	6,700	657.00	4,401,900	貸付株式数	400株
エニグモ	11,300	304.00	3,435,200	貸付株式数	4,600株
テクノスジャパン	1,000	747.00	747,000		
e n i s h	1,500	160.00	240,000	貸付株式数	800株
コロプラ	34,300	463.00	15,880,900	貸付株式数	13,300株
オルトプラス	1,100	88.00	96,800	貸付株式数	900株
ブロードリーフ	40,600	696.00	28,257,600		
クロス・マーケティングG	500	654.00	327,000	貸付株式数	400株
デジタルハーツHLDGS	7,200	809.00	5,824,800		
メディアドゥ	4,600	1,333.00	6,131,800	貸付株式数	1,500株
じげん	25,300	523.00	13,231,900		
ブイキューブ	13,900	222.00	3,085,800	貸付株式数	5,300株
エンカレッジ・テクノロジ	300	584.00	175,200	貸付株式数	200株
サイバーリンクス	500	743.00	371,500	貸付株式数	400株
ディー・エル・イー	4,300	124.00	533,200		
フィックスターズ	10,100	1,626.00	16,422,600	貸付株式数	4,000株
CARTA HOLDINGS	5,700	1,475.00	8,407,500	貸付株式数	2,200株
オブティム	10,400	720.00	7,488,000	貸付株式数	3,900株
セレス	4,600	2,456.00	11,297,600	貸付株式数	1,800株
S H I F T	6,700	17,435.00	116,814,500	貸付株式数	2,500株
特種東海製紙	4,900	3,530.00	17,297,000	貸付株式数	300株
セック	1,700	4,150.00	7,055,000		
テクマトリックス	21,800	2,441.00	53,213,800		
プロシップ	4,400	1,539.00	6,771,600	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エ ンター	25,100	2,984.00	74,898,400		
GMOペイメントゲートウェイ	23,100	7,926.00	183,090,600	貸付株式数	8,600株

ザッパラス	200	402.00	80,400	貸付株式数	100株
システムリサーチ	6,900	1,378.00	9,508,200	貸付株式数	700株
インターネットイニシア ティブ	55,200	3,061.00	168,967,200		
さくらインターネット	15,800	4,525.00	71,495,000	貸付株式数	3,300株
GMOグローバルサインHD	3,100	2,498.00	7,743,800	貸付株式数	200株
SRAホールディングス	5,700	4,330.00	24,681,000		
システムインテグレータ	400	306.00	122,400	貸付株式数	200株
朝日ネット	10,900	625.00	6,812,500		
e B A S E	14,200	681.00	9,670,200	貸付株式数	4,800株
アバントグループ	12,800	2,007.00	25,689,600		
アドソル日進	4,300	2,130.00	9,159,000		
ODKソリューションズ	300	549.00	164,700	貸付株式数	200株
フリービット	4,400	1,410.00	6,204,000		
コムチュア	13,400	2,186.00	29,292,400		
アステリア	7,900	505.00	3,989,500	貸付株式数	3,000株
アイル	5,700	3,270.00	18,639,000	貸付株式数	1,900株
王子ホールディングス	382,300	553.10	211,450,130		
日本製紙	52,600	861.00	45,288,600	貸付株式数	21,400株
三菱製紙	1,500	477.00	715,500	貸付株式数	1,400株
北越コーポレーション	56,700	1,518.00	86,070,600	貸付株式数	22,200株
中越パルプ	500	1,500.00	750,000	貸付株式数	300株
巴川コーポレーション	400	715.00	286,000	貸付株式数	300株
大王製紙	51,000	829.00	42,279,000		
阿波製紙	300	462.00	138,600	貸付株式数	200株
マークライنز	6,000	2,405.00	14,430,000		
メディカル・データ・ビジ	12,100	444.00	5,372,400	貸付株式数	4,700株
g u m i	16,400	358.00	5,871,200	貸付株式数	6,300株
ショーケース	300	369.00	110,700		
モバイルファクトリー	300	935.00	280,500	貸付株式数	200株
テラスカイ	3,900	1,975.00	7,702,500	貸付株式数	1,500株
デジタル・インフォメー ション	5,300	2,173.00	11,516,900		
PCIホールディングス	400	938.00	375,200		
アイビーシー	200	627.00	125,400		
ネオジャパン	2,700	1,875.00	5,062,500		
P R T I M E S	2,000	1,598.00	3,196,000	貸付株式数	700株
ラクス	47,800	2,069.00	98,898,200		
ランドコンピュータ	500	671.00	335,500		

ダブルスタンダード	3,600	1,674.00	6,026,400	貸付株式数	1,000株
オープンドア	7,100	691.00	4,906,100	貸付株式数	2,700株
マイネット	400	348.00	139,200	貸付株式数	100株
アカツキ	4,900	2,448.00	11,995,200		
ベネフィットジャパン	100	1,095.00	109,500		
UBICOMホールディングス	3,200	1,281.00	4,099,200		
カナミックネットワーク	12,700	493.00	6,261,100		
ノムラシステムコーポレーション	1,200	119.00	142,800		
レンゴー	91,900	885.50	81,377,450		
トーモク	5,800	2,199.00	12,754,200	貸付株式数	700株
ザ・パック	7,500	3,595.00	26,962,500	貸付株式数	1,100株
チェンジホールディングス	25,100	1,340.00	33,634,000		
シンクロ・フード	700	419.00	293,300	貸付株式数	200株
オークネット	4,700	2,687.00	12,628,900	貸付株式数	1,800株
キャピタル・アセット・プラン	200	750.00	150,000		
セグエグループ	1,000	628.00	628,000	貸付株式数	900株
エイトレッド	200	1,589.00	317,800		
マクロミル	19,400	1,196.00	23,202,400		
ビーグリー	200	1,317.00	263,400		
オロ	4,300	2,388.00	10,268,400	貸付株式数	1,600株
ユーザーローカル	4,300	2,020.00	8,686,000	貸付株式数	1,500株
テモナ	300	183.00	54,900	貸付株式数	200株
ニーズウェル	1,200	298.00	357,600	貸付株式数	900株
マネーフォワード	24,800	4,926.00	122,164,800		
サインポスト	500	445.00	222,500	貸付株式数	400株
レゾナック・ホールディング	90,600	4,055.00	367,383,000		
住友化学	812,000	370.00	300,440,000		
住友精化	4,700	4,690.00	22,043,000		
日産化学	51,900	5,195.00	269,620,500		
ラサ工業	3,600	2,684.00	9,662,400		
クレハ	20,900	2,813.00	58,791,700	貸付株式数	4,800株
多木化学	3,900	3,455.00	13,474,500	貸付株式数	1,500株
テイカ	7,400	1,628.00	12,047,200	貸付株式数	1,000株
石原産業	16,700	1,458.00	24,348,600		
片倉コープアグリ	300	965.00	289,500	貸付株式数	200株
日本曹達	21,400	2,702.00	57,822,800		
東ソー	134,800	2,071.00	279,170,800		

トクヤマ	32,600	2,680.50	87,384,300	
セントラル硝子	12,700	3,300.00	41,910,000	
東亜合成	48,500	1,530.00	74,205,000	
大阪ソーダ	35,300	1,469.00	51,855,700	貸付株式数 2,600株
関東電化	21,700	1,057.00	22,936,900	貸付株式数 8,400株
SUN ASTERISK	7,200	711.00	5,119,200	貸付株式数 2,700株
デンカ	36,700	2,126.50	78,042,550	
イビデン	58,400	4,344.00	253,689,600	貸付株式数 23,000株
信越化学	905,300	5,546.00	5,020,793,800	
日本カ-バイド	5,300	1,652.00	8,755,600	
電算システムHD	4,500	2,465.00	11,092,500	貸付株式数 1,600株
堺化学	7,000	2,641.00	18,487,000	
第一稀元素化学工	11,000	710.00	7,810,000	貸付株式数 4,200株
エア・ウォーター	95,300	1,861.00	177,353,300	
日本酸素HLDGS	97,900	4,361.00	426,941,900	
日本化学工業	3,700	2,403.00	8,891,100	
東邦アセチレン	1,100	359.00	394,900	
日本パ-カラライジング	45,000	1,279.00	57,555,000	
高压ガス	14,700	796.00	11,701,200	
チタン工業	200	846.00	169,200	貸付株式数 100株
四国化成ホールディング	11,400	2,049.00	23,358,600	
戸田工業	2,300	1,410.00	3,243,000	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	5,500	3,970.00	21,835,000	
保土谷化学	3,200	3,850.00	12,320,000	
日本触媒	64,700	1,824.00	118,012,800	
大日精化	7,000	2,883.00	20,181,000	
カネカ	24,900	3,496.00	87,050,400	
協和キリン	118,900	2,478.50	294,693,650	
APPIER GROUP	30,800	1,438.00	44,290,400	貸付株式数 12,100株
三菱瓦斯化学	81,900	2,832.00	231,940,800	貸付株式数 32,300株
三井化学	90,800	3,450.00	313,260,000	貸付株式数 21,600株
東京応化工業	48,200	3,547.00	170,965,400	
大阪有機化学	8,400	2,662.00	22,360,800	貸付株式数 3,300株
三菱ケミカルグループ	738,000	793.20	585,381,600	
KHネオケム	18,200	2,054.00	37,382,800	貸付株式数 7,100株
ビジョナル	12,000	7,884.00	94,608,000	貸付株式数 4,600株
ダイセル	114,800	1,372.00	157,505,600	
住友ベ-クライト	31,800	3,673.00	116,801,400	
積水化学	201,000	2,408.50	484,108,500	
日本ゼオン	77,900	1,405.50	109,488,450	

アイカ工業	25,500	3,259.00	83,104,500		
UBE	52,000	2,415.00	125,580,000	貸付株式数	12,000株
積水樹脂	13,800	2,108.00	29,090,400	貸付株式数	2,000株
旭有機材	6,700	4,285.00	28,709,500	貸付株式数	2,600株
ニチバン	6,300	1,925.00	12,127,500	貸付株式数	800株
リケンテクノス	18,900	1,073.00	20,279,700		
大倉工業	4,700	3,090.00	14,523,000	貸付株式数	1,800株
積水化成製品	14,200	363.00	5,154,600	貸付株式数	5,400株
群栄化学	2,400	2,686.00	6,446,400		
タイガース ポリマー	600	675.00	405,000		
ミライアル	400	1,423.00	569,200	貸付株式数	300株
ダイキアクシス	500	727.00	363,500	貸付株式数	300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	22,300	610.00	13,603,000		
竹本容器	400	838.00	335,200		
森六ホールディングス	5,600	1,974.00	11,054,400		
恵和	6,500	989.00	6,428,500	貸付株式数	2,500株
日本化薬	70,700	1,278.50	90,389,950	貸付株式数	15,900株
カーリット	10,000	1,319.00	13,190,000	貸付株式数	3,900株
ソルクシーズ	900	313.00	281,700	貸付株式数	600株
CLホールディングス	2,500	837.00	2,092,500	貸付株式数	900株
プレステージ・インター	48,500	673.00	32,640,500		
フェイス	300	1,216.00	364,800	貸付株式数	200株
プロトコーポレーション	11,100	1,322.00	14,674,200		
ハイマックス	3,200	1,379.00	4,412,800		
アミューズ	6,300	1,370.00	8,631,000	貸付株式数	2,400株
野村総合研究所	219,100	4,570.00	1,001,287,000	貸付株式数	86,400株
ドリームインキュベータ	2,500	3,140.00	7,850,000	貸付株式数	100株
クイック	7,200	2,011.00	14,479,200		
TAC	500	184.00	92,000	貸付株式数	300株
CEホールディングス	500	563.00	281,500		
日本システム技術	9,400	1,921.00	18,057,400		
電通グループ	110,200	3,890.00	428,678,000		
インテージホールディングス	11,400	1,627.00	18,547,800	貸付株式数	4,300株
テイクアンドギヴニーズ	5,000	923.00	4,615,000	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	4,700	1,434.00	6,739,800	貸付株式数	1,500株
ぴあ	3,500	3,100.00	10,850,000	貸付株式数	1,300株
イオンファンタジー	4,500	3,050.00	13,725,000	貸付株式数	1,700株

ソースネクスト	51,200	188.00	9,625,600	貸付株式数	20,100株
シーティーエス	14,200	886.00	12,581,200		
NEXYZ.GROUP	400	792.00	316,800		
メディカルシステムネット ワーク	10,400	420.00	4,368,000		
日本精化	6,700	2,484.00	16,642,800	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	9,400	3,410.00	32,054,000		
トリケミカル	11,000	2,801.00	30,811,000	貸付株式数	4,200株
シンプレクスHD	19,800	2,508.00	49,658,400		
HEROZ	4,000	1,014.00	4,056,000	貸付株式数	1,500株
ラクスル	24,500	1,124.00	27,538,000		
メルカリ	49,400	1,925.50	95,119,700	貸付株式数	19,400株
I P S	2,900	2,657.00	7,705,300		
F I G	1,300	301.00	391,300	貸付株式数	1,200株
システムサポート	3,900	1,810.00	7,059,000		
A D E K A	35,200	2,720.00	95,744,000		
日油	118,800	2,260.00	268,488,000		
ミヨシ油脂	400	1,600.00	640,000		
新日本理化	1,600	199.00	318,400	貸付株式数	1,500株
ハリマ化成グループ	7,900	855.00	6,754,500		
イーソル	6,800	645.00	4,386,000	貸付株式数	2,100株
東海ソフト	200	1,320.00	264,000		
ウイングアーク1ST	10,500	3,400.00	35,700,000		
ヒト・コミュニケーション ズHD	3,400	852.00	2,896,800	貸付株式数	1,200株
サーバーワークス	1,800	2,316.00	4,168,800	貸付株式数	600株
東名	200	2,403.00	480,600		
ヴィッツ	100	810.00	81,000		
トピラスシステムズ	300	763.00	228,900		
S a n s a n	33,300	2,135.00	71,095,500	貸付株式数	13,100株
LINK-Uグループ	200	470.00	94,000		
ギフトィ	8,900	1,395.00	12,415,500	貸付株式数	2,800株
花 王	245,800	6,530.00	1,605,074,000		
第一工業製薬	3,600	3,800.00	13,680,000		
石原ケミカル	4,400	2,588.00	11,387,200	貸付株式数	1,600株
日華化学	500	1,158.00	579,000		
ニイタカ	200	1,855.00	371,000	貸付株式数	100株
三洋化成	6,200	3,950.00	24,490,000		
メドレー	11,100	4,370.00	48,507,000	貸付株式数	4,300株
ベース	5,000	3,260.00	16,300,000	貸付株式数	1,000株

J M D C	12,300	4,150.00	51,045,000	貸付株式数	6,000株
武田薬品	899,400	4,119.00	3,704,628,600		
アステラス製薬	886,700	1,584.00	1,404,532,800		
住友ファーマ	90,000	571.00	51,390,000		
塩野義製薬	335,300	2,123.50	712,009,550		
わかもと製薬	1,300	239.00	310,700	貸付株式数	500株
日本新薬	26,500	4,345.00	115,142,500		
中外製薬	316,400	6,605.00	2,089,822,000		
科研製薬	17,300	4,317.00	74,684,100		
エーザイ	134,100	4,641.00	622,358,100		
理研ビタミン	8,600	2,487.00	21,388,200		
ロート製薬	106,800	2,908.00	310,574,400		
小野薬品	206,800	1,733.00	358,384,400		
久光製薬	22,500	4,234.00	95,265,000	貸付株式数	8,400株
有機合成薬品	900	262.00	235,800		
持田製薬	12,700	3,385.00	42,989,500		
参天製薬	192,100	1,705.00	327,530,500		
扶桑薬品	3,900	2,595.00	10,120,500		
日本ケミファ	100	1,533.00	153,300		
ツムラ	34,700	4,890.00	169,683,000		
テルモ	674,200	3,068.00	2,068,445,600	貸付株式数	86,500株
HUグループHD	30,300	2,448.50	74,189,550	貸付株式数	9,400株
キッセイ薬品工業	16,700	3,700.00	61,790,000		
生化学工業	19,300	801.00	15,459,300		
栄研化学	16,000	2,187.00	34,992,000	貸付株式数	3,800株
鳥居薬品	5,400	4,730.00	25,542,000		
J C R ファーマ	34,200	739.00	25,273,800		
東和薬品	13,600	2,797.00	38,039,200		
富士製薬工業	7,500	1,635.00	12,262,500	貸付株式数	2,900株
ゼリア新薬工業	16,000	2,323.00	37,168,000		
ネクセラファーマ	47,400	1,128.00	53,467,200	貸付株式数	17,800株
第一三共	954,000	4,871.00	4,646,934,000		
杏林製薬	21,900	1,472.00	32,236,800	貸付株式数	8,500株
大幸薬品	22,900	359.00	8,221,100	貸付株式数	8,800株
ダイト	7,500	2,090.00	15,675,000		
大塚ホールディングス	252,300	8,849.00	2,232,602,700		
ペプチドリーム	49,000	2,984.50	146,240,500	貸付株式数	1,200株
大日本塗料	11,200	1,137.00	12,734,400		
日本ペイントHOLD	446,700	1,042.50	465,684,750		
関西ペイント	84,500	2,142.50	181,041,250		

神東塗料	900	129.00	116,100	貸付株式数	800株
中国塗料	22,800	2,340.00	53,352,000		
日本特殊塗料	800	1,249.00	999,200		
藤倉化成	12,800	524.00	6,707,200		
太陽ホールディングス	17,600	4,255.00	74,888,000		
D I C	35,900	3,275.00	117,572,500		
サカティンクス	22,500	1,528.00	34,380,000		
ARTIENCE	18,100	3,170.00	57,377,000		
アルプス技研	9,000	2,565.00	23,085,000		
サニックス	14,800	262.00	3,877,600		
日本空調サービス	11,100	1,006.00	11,166,600		
オリエンタルランド	616,800	3,488.00	2,151,398,400	貸付株式数	61,900株
フォーカスシステムズ	6,800	1,097.00	7,459,600		
ダスキン	22,600	3,750.00	84,750,000		
パーク24	77,400	1,795.00	138,933,000		
明光ネットワークジャパン	12,600	720.00	9,072,000	貸付株式数	4,400株
ファルコホールディングス	4,200	2,250.00	9,450,000		
クレスコ	16,600	1,240.00	20,584,000		
フジ・メディア・HD	97,100	1,732.50	168,225,750		
秀英予備校	200	264.00	52,800		
田谷	200	333.00	66,600		
ラウンドワン	97,800	1,079.00	105,526,200		
リゾートトラスト	40,900	3,050.00	124,745,000	貸付株式数	11,000株
オービック	187,700	4,937.00	926,674,900		
ジャストシステム	14,500	3,500.00	50,750,000		
T D C ソフト	17,000	1,320.00	22,440,000		
L I N E ヤフー	1,617,100	418.30	676,432,930		
ビー・エム・エル	12,800	2,833.00	36,262,400		
トレンドマイクロ	53,100	8,315.00	441,526,500		
IDホールディングス	6,800	1,636.00	11,124,800		
リソー教育	64,800	292.00	18,921,600		
日本オラクル	19,300	15,250.00	294,325,000	貸付株式数	6,700株
早稲田アカデミー	5,700	1,835.00	10,459,500	貸付株式数	2,100株 (900株)
アルファシステムズ	3,200	3,460.00	11,072,000		
フューチャー	25,200	1,898.00	47,829,600		
CAC HOLDINGS	6,200	1,736.00	10,763,200		
トーセ	300	615.00	184,500	貸付株式数	200株
ユー・エス・エス	213,100	1,393.00	296,848,300		
オービックビジネスC	17,100	7,178.00	122,743,800	貸付株式数	5,500株

アイティフォー	11,900	1,400.00	16,660,000	
東京個別指導学院	12,300	390.00	4,797,000	貸付株式数 400株
東計電算	2,800	4,340.00	12,152,000	
サイバーエージェント	229,000	1,029.50	235,755,500	
楽天グループ	730,000	847.20	618,456,000	貸付株式数 297,500株
エックスネット	200	1,449.00	289,800	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	5,200	1,591.00	8,273,200	
SBIグローバルアセット	20,300	672.00	13,641,600	
テー・オー・ダブリュー	20,300	312.00	6,333,600	
大塚商会	114,600	3,763.00	431,239,800	貸付株式数 45,200株
サイボウズ	13,900	2,144.00	29,801,600	貸付株式数 5,200株
山田コンサルティングGP	5,200	2,031.00	10,561,200	
セントラルスポーツ	3,900	2,414.00	9,414,600	貸付株式数 1,400株
パラカ	3,100	1,779.00	5,514,900	
電通総研	9,800	5,400.00	52,920,000	
A C C E S S	10,500	947.00	9,943,500	貸付株式数 4,100株
デジタルガレージ	16,200	3,775.00	61,155,000	
イーエムシステムズ	16,900	724.00	12,235,600	
ウェザーニューズ	6,200	2,897.00	17,961,400	貸付株式数 1,800株
C I J	25,200	448.00	11,289,600	
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,855.00	9,252,000	貸付株式数 500株
日本エンタープライズ	1,100	105.00	115,500	
WOWOW	7,600	993.00	7,546,800	貸付株式数 2,900株
スカラ	9,400	443.00	4,164,200	貸付株式数 3,600株
インテリジェント ウェイブ	600	1,098.00	658,800	
フルキャストホールディングス	8,500	1,462.00	12,427,000	
エン・ジャパン	16,900	2,076.00	35,084,400	
セルソース	6,700	1,085.00	7,269,500	貸付株式数 2,500株
あすか製薬HD	9,200	2,000.00	18,400,000	
サワイグループHD	59,500	2,154.00	128,163,000	貸付株式数 14,200株
富士フイルムHLDGS	609,500	3,403.00	2,074,128,500	
コニカミノルタ	227,300	661.50	150,358,950	
資生堂	211,100	2,666.50	562,898,150	
ライオン	128,600	1,794.00	230,708,400	
高砂香料	6,800	5,460.00	37,128,000	
マンダム	20,000	1,286.00	25,720,000	
ミルボン	16,200	3,460.00	56,052,000	
コーセー	20,600	6,636.00	136,701,600	貸付株式数 8,100株

コタ	10,200	1,610.00	16,422,000	
シーボン	200	1,117.00	223,400	貸付株式数 100株
ポーラ・オルビスHD	51,800	1,382.00	71,587,600	貸付株式数 19,100株
ノエビアホールディングス	9,000	4,925.00	44,325,000	
アジュバンホールディング	300	821.00	246,300	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,800	1,929.00	11,188,200	貸付株式数 2,100株
アクシージア	6,700	557.00	3,731,900	貸付株式数 2,500株
エステー	8,200	1,491.00	12,226,200	
アグロカネショウ	3,400	1,896.00	6,446,400	
コニシ	31,800	1,357.00	43,152,600	貸付株式数 12,500株
長谷川香料	19,300	3,300.00	63,690,000	貸付株式数 1,700株
小林製薬	26,500	5,905.00	156,482,500	
荒川化学工業	9,300	1,114.00	10,360,200	
メック	8,300	3,365.00	27,929,500	貸付株式数 3,200株
日本高純度化学	2,500	3,250.00	8,125,000	
タカラバイオ	31,800	1,034.00	32,881,200	
JCU	11,200	3,995.00	44,744,000	
新田ゼラチン	800	749.00	599,200	貸付株式数 700株
OATアグリオ	4,200	2,017.00	8,471,400	貸付株式数 1,600株
デクセリアルズ	88,500	2,439.00	215,851,500	貸付株式数 14,700株
アース製薬	9,200	5,440.00	50,048,000	
北興化学	9,000	1,311.00	11,799,000	
大成ラミック	2,900	2,505.00	7,264,500	
クミアイ化学	40,200	789.00	31,717,800	貸付株式数 6,900株
日本農薬	15,400	675.00	10,395,000	
富士興産	300	1,392.00	417,600	
ニチレキグループ	10,700	2,410.00	25,787,000	
ユシロ化学	5,200	2,090.00	10,868,000	
ビーピー・カストロール	500	882.00	441,000	貸付株式数 400株
富士石油	26,500	292.00	7,738,000	
MORESCO	400	1,269.00	507,600	
出光興産	472,400	1,004.50	474,525,800	
ENEOSホールディングス	1,714,600	819.70	1,405,457,620	
コスモエネルギーHLDGS	33,300	6,557.00	218,348,100	
テスホールディングス	21,200	276.00	5,851,200	貸付株式数 8,000株
インフロニアHD	103,600	1,207.50	125,097,000	
横浜ゴム	51,100	3,047.00	155,701,700	
TOYO TIRE	58,100	2,353.50	136,738,350	
ブリヂストン	295,900	5,356.00	1,584,840,400	貸付株式数 116,800株

住友ゴム	99,100	1,643.00	162,821,300	
藤倉コンポジット	9,700	1,472.00	14,278,400	
オカモト	5,400	5,510.00	29,754,000	
アキレス	5,500	1,444.00	7,942,000	貸付株式数 2,100株
フコク	6,000	1,719.00	10,314,000	貸付株式数 2,100株
ニッタ	9,900	3,545.00	35,095,500	貸付株式数 1,000株
クリエートメディック	400	908.00	363,200	
住友理工	19,600	1,541.00	30,203,600	
三ツ星ベルト	14,100	4,100.00	57,810,000	貸付株式数 2,900株
バンドー化学	15,000	1,807.00	27,105,000	
A G C	98,300	4,709.00	462,894,700	
日本板硝子	51,700	334.00	17,267,800	貸付株式数 19,900株
石塚硝子	200	2,400.00	480,000	貸付株式数 100株
有沢製作所	15,200	1,441.00	21,903,200	
日本山村硝子	500	1,684.00	842,000	
日本電気硝子	37,500	3,419.00	128,212,500	
オハラ	4,800	1,205.00	5,784,000	貸付株式数 1,800株
住友大阪セメント	18,100	3,340.00	60,454,000	貸付株式数 6,100株
太平洋セメント	62,400	3,818.00	238,243,200	
リソルホールディングス	200	5,010.00	1,002,000	
日本ヒューム	8,800	1,303.00	11,466,400	貸付株式数 3,200株
日本コンクリート	19,600	381.00	7,467,600	貸付株式数 7,400株
三谷セキサン	4,200	5,670.00	23,814,000	貸付株式数 700株
アジアパイルHD	14,400	835.00	12,024,000	
東海カーボン	93,300	907.80	84,697,740	貸付株式数 36,600株
日本カーボン	5,800	4,420.00	25,636,000	
東洋炭素	7,100	4,415.00	31,346,500	貸付株式数 2,800株
ノリタケ	11,200	3,740.00	41,888,000	
TOTO	73,400	4,018.00	294,921,200	貸付株式数 25,000株
日本碍子	117,600	1,971.50	231,848,400	
日本特殊陶業	82,600	4,647.00	383,842,200	
ダントーホールディングス	400	309.00	123,600	貸付株式数 200株
MARUWA	4,200	43,490.00	182,658,000	貸付株式数 1,400株
品川リフラクトリーズ	12,400	1,666.00	20,658,400	貸付株式数 3,500株
黒崎播磨	6,900	2,350.00	16,215,000	
ヨータイ	5,200	1,550.00	8,060,000	
東京窯業	1,300	410.00	533,000	
ニッカトー	500	517.00	258,500	
フジインコーポレーテッド	27,200	2,372.00	64,518,400	

クニミネ工業	400	1,008.00	403,200	貸付株式数	300株
エーアンドエーマテリアル	300	1,243.00	372,900		
ニチアス	25,600	5,895.00	150,912,000		
日本製鉄	526,600	3,060.00	1,611,396,000		
神戸製鋼所	209,100	1,557.50	325,673,250	貸付株式数	60,300株
中山製鋼所	21,400	726.00	15,536,400	貸付株式数	8,400株
合同製鐵	5,800	3,815.00	22,127,000	貸付株式数	2,200株
J F Eホールディングス	313,300	1,711.50	536,212,950	貸付株式数	49,700株
東京製鐵	29,000	1,477.00	42,833,000	貸付株式数	11,400株
共英製鋼	10,200	1,733.00	17,676,600		
大和工業	19,600	7,730.00	151,508,000		
東京鐵鋼	4,600	6,370.00	29,302,000	貸付株式数	1,700株
大阪製鐵	4,800	3,380.00	16,224,000	貸付株式数	1,800株
淀川製鋼所	9,600	5,200.00	49,920,000	貸付株式数	3,700株
中部鋼鈹	6,800	2,174.00	14,783,200	貸付株式数	2,600株
丸一鋼管	31,700	3,235.00	102,549,500		
モリ工業	2,600	4,680.00	12,168,000		
大同特殊鋼	65,500	1,170.00	76,635,000		
日本高周波	500	374.00	187,000	貸付株式数	400株
日本冶金工	7,000	3,940.00	27,580,000		
山陽特殊製鋼	10,300	1,812.00	18,663,600		
愛知製鋼	6,000	4,800.00	28,800,000		
日本金属	300	651.00	195,300	貸付株式数	200株
ミガロホールディングス	400	1,625.00	650,000	貸付株式数	300株
大平洋金属	9,600	1,409.00	13,526,400	貸付株式数	2,200株
新日本電工	62,100	289.00	17,946,900		
栗本鉄工所	4,800	4,115.00	19,752,000		
虹 技	200	1,166.00	233,200	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	200	1,100.00	220,000	貸付株式数	100株
日本製鋼所	30,800	6,549.00	201,709,200		
三菱製鋼	7,700	1,389.00	10,695,300		
日亜鋼業	1,100	301.00	331,100		
日本精線	8,200	1,273.00	10,438,600		
エンビプロHD	10,200	414.00	4,222,800	貸付株式数	3,900株 (1,400株)
大紀アルミニウム	14,800	1,061.00	15,702,800	貸付株式数	4,900株
日本軽金属HD	30,400	1,529.00	46,481,600		
三井金属	26,000	4,811.00	125,086,000		
東邦亜鉛	8,200	826.00	6,773,200	貸付株式数	3,100株

三菱マテリアル	74,300	2,426.00	180,251,800	貸付株式数	26,200株
住友鉱山	131,500	3,707.00	487,470,500	貸付株式数	34,700株
DOWAホールディングス	28,000	4,499.00	125,972,000	貸付株式数	11,000株
古河機金	13,700	1,580.00	21,646,000		
エス・サイエンス	6,800	22.00	149,600	貸付株式数	6,400株
大阪チタニウム	18,000	2,001.00	36,018,000	貸付株式数	7,000株
東邦チタニウム	21,500	1,074.00	23,091,000	貸付株式数	8,200株
U A C J	14,600	5,450.00	79,570,000		
C Kサンエツ	2,500	3,725.00	9,312,500	貸付株式数	500株
古河電工	34,600	6,418.00	222,062,800		
住友電工	359,100	2,949.00	1,058,985,900		
フジクラ	111,500	5,662.00	631,313,000		
S W C C	13,900	7,900.00	109,810,000	貸付株式数	5,400株
カナレ電気	200	1,422.00	284,400		
平河ヒューテック	6,600	1,490.00	9,834,000	貸付株式数	1,500株
いよぎんホールディング	129,900	1,592.00	206,800,800		
しずおかフィナンシャル	218,600	1,367.00	298,826,200		
ちゅうぎんフィナンシャ	83,600	1,693.50	141,576,600		
楽天銀行	46,000	4,466.00	205,436,000	貸付株式数	9,300株
京都フィナンシャルG	124,900	2,369.00	295,888,100	貸付株式数	33,000株
リョービ	11,100	2,150.00	23,865,000		
アーレステイ	1,200	513.00	615,600		
AREホールディングス	42,100	1,723.00	72,538,300		
東洋製罐グループHD	66,300	2,389.00	158,390,700		
ホッカンホールディングス	5,600	1,703.00	9,536,800		
コロナ	5,800	940.00	5,452,000		
横河ブリッジHLDGS	17,900	2,758.00	49,368,200		
駒井ハルテック	200	1,552.00	310,400		
高田機工	300	1,002.00	300,600		
三和ホールディングス	102,700	4,553.00	467,593,100		
文化シヤッタ -	27,200	1,858.00	50,537,600		
三協立山	13,100	699.00	9,156,900	貸付株式数	3,500株
アルインコ	7,900	973.00	7,686,700	貸付株式数	1,100株
東洋シヤッタ -	300	781.00	234,300		
L I X I L	151,600	1,703.00	258,174,800		
日本フィルコン	800	499.00	399,200	貸付株式数	700株
ノーリツ	14,600	1,708.00	24,936,800		
長府製作所	11,600	1,896.00	21,993,600		
リンナイ	55,300	3,186.00	176,185,800	貸付株式数	20,800株
ユニプレス	18,100	969.00	17,538,900	貸付株式数	7,000株

ダイニチ工業	600	617.00	370,200	
日東精工	15,100	617.00	9,316,700	
三洋工業	100	2,869.00	286,900	
岡 部	18,600	788.00	14,656,800	
ジーテクト	11,600	1,577.00	18,293,200	
東 プ レ	18,300	1,892.00	34,623,600	貸付株式数 2,300株
高周波熱錬	15,400	974.00	14,999,600	貸付株式数 5,400株
東京製綱	6,100	1,241.00	7,570,100	貸付株式数 2,400株
サンコール	11,600	304.00	3,526,400	貸付株式数 4,400株
モリテックスチル	1,000	165.00	165,000	貸付株式数 400株
パイオラックス	14,000	2,442.00	34,188,000	貸付株式数 700株
エイチワン	10,700	1,019.00	10,903,300	
日本発条	92,000	1,740.00	160,080,000	貸付株式数 36,200株
中央発條	6,700	1,320.00	8,844,000	
アドバネクス	100	772.00	77,200	
三浦工業	47,200	3,841.00	181,295,200	
タ ク マ	34,400	1,643.00	56,519,200	
テクノプロ・ホールディング グ	60,200	2,788.50	167,867,700	
アトラグループ	400	131.00	52,400	貸付株式数 200株
アイ・アールジャパンHD	5,400	790.00	4,266,000	貸付株式数 2,000株
K e e P e r 技研	6,400	4,255.00	27,232,000	貸付株式数 2,500株
楽待	400	705.00	282,000	貸付株式数 300株
三機サービス	200	939.00	187,800	貸付株式数 100株
G u n o s y	8,200	699.00	5,731,800	貸付株式数 300株
デザインワン・ジャパン	600	113.00	67,800	貸付株式数 200株
イー・ガーディアン	4,900	1,835.00	8,991,500	
リブセンス	600	151.00	90,600	貸付株式数 500株
ジャパンマテリアル	31,700	1,655.00	52,463,500	
ベクトル	14,100	975.00	13,747,500	
ウチヤマホールディングス	600	314.00	188,400	貸付株式数 500株 (400株)
チャームケアコーポレー ション	8,600	1,290.00	11,094,000	
キャリアリンク	3,800	2,461.00	9,351,800	
I B J	7,900	622.00	4,913,800	貸付株式数 2,200株
アサンテ	5,100	1,641.00	8,369,100	貸付株式数 1,800株
バリューHR	9,300	1,932.00	17,967,600	貸付株式数 3,500株 (400株)
M&Aキャピタルパートナー	8,400	2,628.00	22,075,200	

ライドオンエクスプレスHD	4,100	997.00	4,087,700	
ERIホールディングス	400	2,135.00	854,000	貸付株式数 300株
アピスト	200	3,025.00	605,000	貸付株式数 100株
シグマクシス・ホールディング	30,200	920.00	27,784,000	
ウィルグループ	8,700	959.00	8,343,300	
エスクローA J	1,400	142.00	198,800	
メドピア	8,300	486.00	4,033,800	貸付株式数 3,200株
レアジョブ	300	392.00	117,600	
リクルートホールディングス	808,400	10,620.00	8,585,208,000	
エラン	13,700	676.00	9,261,200	
ツガミ	21,700	1,363.00	29,577,100	
オークマ	17,800	3,155.00	56,159,000	
芝浦機械	13,100	3,445.00	45,129,500	貸付株式数 3,700株
アマダ	141,400	1,455.00	205,737,000	
アイダエンジニア	22,800	783.00	17,852,400	
F U J I	44,200	2,171.00	95,958,200	
牧野フライス	11,300	6,640.00	75,032,000	
オーエスジー	44,900	1,769.00	79,428,100	
ダイジェット	200	700.00	140,000	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	25,400	806.00	20,472,400	
DMG森精機	64,200	2,573.50	165,218,700	
ソディック	26,800	719.00	19,269,200	
ディスコ	49,000	41,330.00	2,025,170,000	
日東工器	3,900	2,705.00	10,549,500	貸付株式数 1,700株
日進工具	8,500	740.00	6,290,000	
パンチ工業	1,200	398.00	477,600	貸付株式数 1,100株
富士ダイス	7,500	773.00	5,797,500	貸付株式数 1,900株
土木管理総合試験	500	307.00	153,500	
日本郵政	1,160,400	1,545.00	1,792,818,000	
ベルシステム24HLDGS	11,100	1,243.00	13,797,300	
鎌倉新書	8,800	535.00	4,708,000	貸付株式数 2,100株 (1,700株)
S M N	300	318.00	95,400	
一蔵	200	401.00	80,200	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	200	701.00	140,200	
エアトリ	7,600	1,085.00	8,246,000	貸付株式数 2,900株
アトラエ	7,300	880.00	6,424,000	貸付株式数 2,800株

ストライク	5,100	3,860.00	19,686,000	貸付株式数	1,800株
ソラスト	28,500	466.00	13,281,000		
セラク	3,100	1,317.00	4,082,700	貸付株式数	1,100株
インソース	22,500	1,073.00	24,142,500		
豊田自動織機	86,000	11,255.00	967,930,000		
豊和工業	700	1,095.00	766,500		
石川製作所	300	1,400.00	420,000	貸付株式数	200株
リケンNPR	12,800	2,400.00	30,720,000	貸付株式数	5,000株
東洋機械金属	1,000	640.00	640,000		
津田駒工業	300	350.00	105,000	貸付株式数	200株
エンシュウ	300	568.00	170,400		
島精機製作所	16,200	1,062.00	17,204,400	貸付株式数	6,200株
オプトラン	16,700	1,857.00	31,011,900		
イワキポンプ	6,800	2,631.00	17,890,800	貸付株式数	800株
フリュー	9,600	1,089.00	10,454,400		
ヤマシンフィルタ	21,500	599.00	12,878,500	貸付株式数	8,400株
日阪製作所	12,300	995.00	12,238,500		
やまびこ	16,600	2,514.00	41,732,400		
野村マイクロ・サイエンス	16,800	1,757.00	29,517,600	貸付株式数	6,600株 (100株)
平田機工	4,900	5,200.00	25,480,000	貸付株式数	600株
PEGASUS	11,200	433.00	4,849,600		
マルマエ	4,400	1,591.00	7,000,400	貸付株式数	1,700株
タツモ	7,300	2,562.00	18,702,600	貸付株式数	2,800株
ナプテスコ	63,900	2,434.50	155,564,550		
三井海洋開発	12,900	3,175.00	40,957,500		
レオン自動機	10,700	1,415.00	15,140,500		
S M C	30,500	64,590.00	1,969,995,000		
ホソカワミクロン	7,100	3,935.00	27,938,500		
ユニオンツール	4,500	5,320.00	23,940,000		
瑞光	6,500	1,252.00	8,138,000	貸付株式数	2,700株
オイレス工業	13,800	2,376.00	32,788,800		
日精エーエスビー	3,500	5,070.00	17,745,000		
サト - ホールディングス	12,700	2,230.00	28,321,000		
技研製作所	9,600	1,731.00	16,617,600	貸付株式数	3,600株
日本エアータック	4,800	1,229.00	5,899,200		
カワタ	400	798.00	319,200		
日精樹脂工業	6,700	910.00	6,097,000		
オカダアイヨン	400	1,830.00	732,000		

ワイエイシイホールディングス	5,100	1,914.00	9,761,400	貸付株式数	2,000株
小松製作所	501,800	4,066.00	2,040,318,800		
住友重機械	60,200	3,249.00	195,589,800		
日立建機	40,500	3,383.00	137,011,500	貸付株式数	16,000株
日工	15,100	707.00	10,675,700		
巴工業	4,000	3,810.00	15,240,000		
井関農機	9,500	946.00	8,987,000	貸付株式数	3,500株
TOWA	31,200	1,587.00	49,514,400	貸付株式数	12,600株
丸山製作所	200	2,026.00	405,200		
北川鉄工所	4,000	1,204.00	4,816,000		
シンニッタン	1,400	200.00	280,000		
ローツェ	53,200	1,663.00	88,471,600	貸付株式数	17,100株
タカキタ	400	389.00	155,600	貸付株式数	100株
クボタ	532,200	1,871.50	996,012,300		
荏原実業	4,900	4,330.00	21,217,000		
東洋エンジニア	14,500	713.00	10,338,500	貸付株式数	5,700株
三菱化工機	3,600	3,200.00	11,520,000		
月島ホールディングス	13,800	1,494.00	20,617,200		
帝国電機製作所	7,000	2,760.00	19,320,000		
東京機械	300	356.00	106,800		
新東工業	22,600	922.00	20,837,200	貸付株式数	4,500株
渋谷工業	9,500	3,895.00	37,002,500		
アイチ コーポレーション	16,900	1,382.00	23,355,800		
小森コーポレーション	25,100	1,132.00	28,413,200		
鶴見製作所	7,800	3,575.00	27,885,000		
日本ギア工業	500	460.00	230,000	貸付株式数	300株
酒井重工業	4,000	2,371.00	9,484,000		
荏原製作所	209,000	2,264.50	473,280,500		
西島製作所	8,800	2,400.00	21,120,000		
北越工業	10,200	1,689.00	17,227,800	貸付株式数	3,900株
ダイキン工業	132,600	18,170.00	2,409,342,000		
オルガノ	15,700	8,860.00	139,102,000	貸付株式数	600株
ト - ヨ - カネツ	3,800	4,160.00	15,808,000		
栗田工業	56,900	5,706.00	324,671,400	貸付株式数	3,000株
椿本チエイン	46,100	1,892.00	87,221,200		
大同工業	500	737.00	368,500		
日機装	26,100	953.00	24,873,300		
木村化工機	7,800	966.00	7,534,800		
レイズネクスト	14,300	1,524.00	21,793,200		

アネスト岩田	17,300	1,408.00	24,358,400	
ダイフク	171,800	3,221.00	553,367,800	
サムコ	2,400	2,855.00	6,852,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	700	1,327.00	928,900	
油研工業	200	2,539.00	507,800	
タダノ	58,600	1,153.50	67,595,100	貸付株式数 4,600株
フジテック	32,700	5,824.00	190,444,800	
C K D	28,200	2,486.00	70,105,200	
平和	33,900	2,095.00	71,020,500	
理想科学工業	8,100	3,450.00	27,945,000	貸付株式数 3,000株
S A N K Y O	117,600	2,130.50	250,546,800	
日本金銭機械	12,300	1,022.00	12,570,600	貸付株式数 4,700株
マースグループHLDGS	6,900	3,245.00	22,390,500	貸付株式数 2,200株
フクシマガリレイ	7,500	5,500.00	41,250,000	
オーイズミ	400	336.00	134,400	貸付株式数 100株
ダイコク電機	4,500	3,295.00	14,827,500	貸付株式数 1,700株
竹内製作所	18,500	4,850.00	89,725,000	貸付株式数 7,200株
ア マ ノ	28,900	4,312.00	124,616,800	
J U K I	15,800	385.00	6,083,000	貸付株式数 5,900株
サンデン	2,000	149.00	298,000	貸付株式数 1,700株
ジャノメ	8,800	1,076.00	9,468,800	
ブラザー工業	136,000	2,664.00	362,304,000	
マックス	12,500	3,440.00	43,000,000	貸付株式数 2,700株
モリタホールディングス	15,900	2,138.00	33,994,200	
グローリー	26,700	2,523.50	67,377,450	
新晃工業	30,900	1,439.00	44,465,100	貸付株式数 4,500株
大和冷機工業	15,600	1,487.00	23,197,200	
セガサミーホールディングス	90,900	2,635.00	239,521,500	貸付株式数 35,800株
T P R	12,900	2,331.00	30,069,900	貸付株式数 1,000株
ツバキ・ナカシマ	25,100	524.00	13,152,400	
ホシザキ	65,500	6,154.00	403,087,000	
大豊工業	8,800	611.00	5,376,800	貸付株式数 3,400株
日本精工	188,400	666.30	125,530,920	
N T N	240,800	239.60	57,695,680	貸付株式数 95,200株
ジェイテクト	90,600	1,058.00	95,854,800	
不二越	7,500	3,095.00	23,212,500	貸付株式数 2,900株
ミネベアミツミ	177,100	2,469.00	437,259,900	
日本トムソン	27,700	486.00	13,462,200	
T H K	58,700	3,682.00	216,133,400	

ユーシン精機	9,400	670.00	6,298,000	
前澤給装工業	7,300	1,348.00	9,840,400	
イーグル工業	11,300	1,916.00	21,650,800	貸付株式数 4,100株
前澤工業	700	1,184.00	828,800	
P I L L A R	9,400	4,395.00	41,313,000	
キット	34,100	1,111.00	37,885,100	
日立	2,621,200	3,946.00	10,343,255,200	
三菱電機	1,035,400	2,568.50	2,659,424,900	
富士電機	61,900	8,692.00	538,034,800	
東洋電機製造	400	1,078.00	431,200	
安川電機	110,600	3,963.00	438,307,800	貸付株式数 8,200株
シンフォニア テクノロジー	10,100	5,850.00	59,085,000	
明電舎	17,200	4,005.00	68,886,000	
オリジン	200	1,153.00	230,600	
山洋電気	4,400	8,320.00	36,608,000	
デンヨー	7,800	2,748.00	21,434,400	
PHCホールディングス	19,000	923.00	17,537,000	貸付株式数 7,100株
KOKUSAI ELECTRIC	71,300	2,500.00	178,250,000	貸付株式数 28,100株
ソシオネクスト	101,400	2,479.00	251,370,600	貸付株式数 10,900株
ベイカレント	76,100	5,633.00	428,671,300	
ORCHESTRA HLDGS	2,300	813.00	1,869,900	
アイモバイル	13,100	538.00	7,047,800	
ディスラプターズ	700	155.00	108,500	貸付株式数 200株
M S - J a p a n	5,700	1,054.00	6,007,800	貸付株式数 500株
船場	200	1,302.00	260,400	
ジャパンエレベーターSHD	40,300	2,770.00	111,631,000	
フルテック	200	1,187.00	237,400	貸付株式数 100株 (100株)
グリーンズ	400	1,811.00	724,400	
ツナググループHLDGS	300	641.00	192,300	貸付株式数 100株
GAMEWITH	500	220.00	110,000	貸付株式数 400株
MS&CONSULTING	100	452.00	45,200	
エル・ティー・エス	1,400	2,394.00	3,351,600	貸付株式数 500株
ミダックホールディングス	6,300	1,673.00	10,539,900	貸付株式数 2,400株
キュービーネットHLDGS	5,900	1,018.00	6,006,200	
オープングループ	16,400	197.00	3,230,800	貸付株式数 5,200株
三桜工業	14,000	728.00	10,192,000	貸付株式数 5,400株
マキタ	126,600	4,700.00	595,020,000	
東芝テック	15,200	3,635.00	55,252,000	

芝浦メカトロニクス	7,400	7,790.00	57,646,000	
マブチモーター	44,700	2,224.00	99,412,800	
ニデック	449,500	2,748.50	1,235,450,750	
ユーエムシーエレクトロニクス	6,400	324.00	2,073,600	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,800	1,287.00	6,177,600	
東光高岳	5,500	2,003.00	11,016,500	貸付株式数 2,100株
ダブル・スコープ	31,200	284.00	8,860,800	貸付株式数 12,000株
宮越ホールディングス	4,500	1,871.00	8,419,500	貸付株式数 1,700株
ダイヘン	9,700	7,050.00	68,385,000	
ヤーマン	19,800	766.00	15,166,800	貸付株式数 7,600株 (200株)
JVCケンウッド	80,400	1,499.00	120,519,600	
ミマキエンジニアリング	8,500	1,456.00	12,376,000	
I - P E X	5,400	2,944.00	15,897,600	
大崎電気	21,800	765.00	16,677,000	
オムロン	93,300	4,741.00	442,335,300	貸付株式数 9,300株
日東工業	13,700	2,829.00	38,757,300	貸付株式数 5,200株
I D E C	15,000	2,423.00	36,345,000	
正興電機製作所	400	1,216.00	486,400	貸付株式数 100株
不二電機工業	300	1,139.00	341,700	貸付株式数 200株
ジーエス・ユアサ コーポ	45,400	2,587.00	117,449,800	貸付株式数 17,900株
サクサ	300	2,830.00	849,000	
メルコホールディングス	2,300	2,196.00	5,050,800	
テクノメディカ	2,000	1,802.00	3,604,000	貸付株式数 900株
ダイヤモンドエレクトリック HD	4,100	529.00	2,168,900	貸付株式数 1,600株
日本電気	144,000	13,060.00	1,880,640,000	
富士通	936,700	2,863.00	2,681,772,100	
沖電気	49,300	938.00	46,243,400	
電気興業	4,100	1,677.00	6,875,700	
サンケン電気	10,400	6,300.00	65,520,000	貸付株式数 1,800株
ナカヨ	200	1,131.00	226,200	
アイホン	6,200	2,709.00	16,795,800	
ルネサスエレクトロニクス	775,500	2,017.50	1,564,571,250	
セイコーエプソン	130,600	2,750.00	359,150,000	貸付株式数 49,100株
ワコム	71,500	713.00	50,979,500	
アルバック	22,300	6,299.00	140,467,700	
アクセル	5,100	1,285.00	6,553,500	

E I Z O	13,300	2,183.00	29,033,900	
ジャパンディスプレイ	61,700	20.00	1,234,000	
日本信号	23,200	913.00	21,181,600	
京三製作所	23,700	529.00	12,537,300	
能美防災	13,800	2,962.00	40,875,600	
ホーチキ	6,500	2,373.00	15,424,500	
星和電機	500	537.00	268,500	
エレコム	24,300	1,446.00	35,137,800	
パナソニック ホールディング	1,202,600	1,453.00	1,747,377,800	
シャープ	147,100	951.90	140,024,490	貸付株式数 58,000株
アンリツ	71,700	1,159.50	83,136,150	貸付株式数 28,300株
富士通ゼネラル	28,900	2,053.00	59,331,700	
ソニーグループ	3,529,500	3,014.00	10,637,913,000	
T D K	879,200	2,009.50	1,766,752,400	
帝国通信工業	4,500	2,964.00	13,338,000	貸付株式数 1,600株
タムラ製作所	40,600	506.00	20,543,600	
アルプスアルパイン	82,600	1,539.50	127,162,700	貸付株式数 18,400株
池上通信機	400	633.00	253,200	
日本電波工業	9,600	925.00	8,880,000	貸付株式数 3,600株
鈴木	5,400	1,947.00	10,513,800	
メイコー	10,100	9,300.00	93,930,000	
日本トリム	2,300	3,675.00	8,452,500	
フオスタ - 電機	10,400	1,441.00	14,986,400	
S M K	2,400	2,468.00	5,923,200	
ヨコオ	9,000	1,676.00	15,084,000	
ティアック	1,700	83.00	141,100	貸付株式数 1,600株
ホシデン	25,500	2,363.00	60,256,500	
ヒロセ電機	14,800	18,045.00	267,066,000	
日本航空電子	26,500	2,615.00	69,297,500	
T O A	10,300	919.00	9,465,700	
マクセル	20,600	1,728.00	35,596,800	
古野電気	12,000	2,544.00	30,528,000	
スミダコーポレーション	13,700	982.00	13,453,400	
アイコム	3,900	2,676.00	10,436,400	貸付株式数 300株
リオン	4,200	2,571.00	10,798,200	
横河電機	111,400	3,415.00	380,431,000	
新電元工業	3,900	2,406.00	9,383,400	貸付株式数 1,500株
アズビル	277,300	1,218.00	337,751,400	
東亜ディーケーケー	500	722.00	361,000	

日本光電工業	90,200	2,103.50	189,735,700	貸付株式数	31,500株
チノー	4,200	2,051.00	8,614,200	貸付株式数	1,300株
共和電業	1,200	426.00	511,200		
日本電子材料	6,200	2,088.00	12,945,600		
堀場製作所	19,100	8,639.00	165,004,900		
アドバンテスト	317,600	8,421.00	2,674,509,600		
小野測器	500	570.00	285,000	貸付株式数	200株
エスペック	9,000	2,619.00	23,571,000		
キーエンス	100,800	65,260.00	6,578,208,000		
日置電機	5,300	7,570.00	40,121,000	貸付株式数	800株
シスメックス	260,900	3,149.00	821,574,100		
日本マイクロニクス	16,600	3,805.00	63,163,000		
メガチップス	7,800	6,170.00	48,126,000		
OBARA GROUP	6,300	4,155.00	26,176,500	貸付株式数	2,400株
IMAGICA GROUP	10,100	504.00	5,090,400	貸付株式数	3,400株
澤藤電機	100	926.00	92,600		
デンソー	1,069,100	2,167.50	2,317,274,250		
原田工業	600	534.00	320,400		
コーセル	10,800	1,196.00	12,916,800	貸付株式数	4,100株
イリソ電子工業	10,200	2,643.00	26,958,600		
オプテックスグループ	18,500	1,932.00	35,742,000		
千代田インテグレ	3,500	3,585.00	12,547,500		
レーザーテック	46,200	16,305.00	753,291,000		
スタンレー電気	63,100	2,539.00	160,210,900	貸付株式数	20,700株
ウシオ電機	44,600	2,039.50	90,961,700		
岡谷電機	900	222.00	199,800	貸付株式数	800株
ヘリオステクノH	1,200	952.00	1,142,400		
エノモト	400	1,457.00	582,800		
日本セラミック	9,200	2,631.00	24,205,200	貸付株式数	3,500株
遠藤照明	600	1,412.00	847,200		
古河電池	7,400	1,370.00	10,138,000	貸付株式数	2,400株
山一電機	8,200	2,304.00	18,892,800	貸付株式数	1,900株
図研	9,200	4,370.00	40,204,000		
日本電子	23,300	5,270.00	122,791,000	貸付株式数	9,500株
カシオ	80,600	1,152.50	92,891,500		
ファナック	487,700	3,930.00	1,916,661,000		
日本シイエムケイ	29,500	412.00	12,154,000	貸付株式数	11,300株
エンプラス	2,900	5,230.00	15,167,000	貸付株式数	200株 (100株)

大真空	12,300	526.00	6,469,800	貸付株式数	2,100株
ローム	182,600	1,412.50	257,922,500	貸付株式数	72,000株
浜松ホトニクス	161,800	1,824.00	295,123,200	貸付株式数	13,400株
三井ハイテック	44,600	770.00	34,342,000	貸付株式数	17,400株
新光電気工業	35,700	5,277.00	188,388,900		
京セラ	626,200	1,486.00	930,533,200		
協栄産業	100	2,225.00	222,500		
太陽誘電	44,200	2,170.50	95,936,100		
村田製作所	900,300	2,494.50	2,245,798,350		
双葉電子工業	19,200	458.00	8,793,600		
日東電工	319,600	2,407.50	769,437,000		
北陸電気工業	400	1,565.00	626,000		
東海理化電機	28,400	2,089.00	59,327,600		
ニチコン	26,500	1,042.00	27,613,000		
日本ケミコン	12,400	1,088.00	13,491,200	貸付株式数	4,700株
K O A	16,800	973.00	16,346,400	貸付株式数	6,400株
三井E & S	54,400	1,522.00	82,796,800	貸付株式数	21,500株
カナデビア	83,400	948.00	79,063,200		
三菱重工業	1,780,100	2,246.00	3,998,104,600		
川崎重工業	75,900	5,588.00	424,129,200		
I H I	81,600	7,960.00	649,536,000		
名村造船所	28,800	1,538.00	44,294,400	貸付株式数	11,300株
サノヤスホールディングス	1,600	167.00	267,200	貸付株式数	1,500株
スプリックス	300	820.00	246,000	貸付株式数	100株
マネジメントソリューションズ	5,100	1,749.00	8,919,900	貸付株式数	2,000株
プロレド・パートナーズ	2,500	527.00	1,317,500	貸付株式数	1,000株
AND FACTORY	300	227.00	68,100		
テノ.ホールディングス	100	499.00	49,900		
フロンティア・マネジメント	3,100	787.00	2,439,700		
ピアラ	200	256.00	51,200		
コプロ・ホールディングス	500	1,781.00	890,500		
ギークス	300	411.00	123,300		
アンビスホールディングス	22,200	883.00	19,602,600	貸付株式数	8,700株
カーブスホールディングス	28,300	813.00	23,007,900		
フォーラムエンジニアリング	12,100	977.00	11,821,700		
FAST FITNESS JAP	3,500	1,405.00	4,917,500		
日本車輛	3,900	2,244.00	8,751,600		

三菱ロジスネクスト	16,100	1,155.00	18,595,500	貸付株式数	6,300株
近畿車輛	200	1,440.00	288,000		
一家ホールディングス	300	665.00	199,500	貸付株式数	200株
フルサト・マルカHD	8,500	2,298.00	19,533,000	貸付株式数	3,200株
ヤマエグループHD	11,500	2,066.00	23,759,000	貸付株式数	4,500株
ジャパクラフトホール ディ	900	139.00	125,100	貸付株式数	800株
F P G	35,400	2,916.00	103,226,400		
島根銀行	300	496.00	148,800	貸付株式数	200株
じもとホールディングス	1,000	310.00	310,000	貸付株式数	900株
全国保証	26,000	5,383.00	139,958,000		
めぶきフィナンシャルG	498,300	670.60	334,159,980	貸付株式数	90,000株
ジャパンインベストメントA	16,100	1,080.00	17,388,000	貸付株式数	6,300株
東京きらぼしFG	12,700	4,395.00	55,816,500		
九州フィナンシャルG	174,600	751.40	131,194,440		
かんぽ生命保険	115,500	3,198.00	369,369,000		
ゆうちょ銀行	818,100	1,464.00	1,197,698,400		
あんしん保証	500	156.00	78,000	貸付株式数	100株
富山第一銀行	31,500	1,152.00	36,288,000	貸付株式数	12,400株
コンコルディア・フィナン シャル	528,100	931.90	492,136,390	貸付株式数	208,800株
ジェイリース	7,400	1,375.00	10,175,000		
西日本フィナンシャルHD	61,100	2,047.00	125,071,700		
イントラスト	400	797.00	318,800		
日本モーゲージサービス	600	428.00	256,800	貸付株式数	100株
C a s a	400	855.00	342,000	貸付株式数	300株
S B I アルヒ	10,100	822.00	8,302,200	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	16,800	2,647.00	44,469,600		
日産自動車	1,259,800	360.40	454,031,920	貸付株式数	499,000株
いすゞ自動車	311,300	2,027.50	631,160,750		
トヨタ自動車	5,357,700	2,611.00	13,988,954,700		
日野自動車	151,600	405.10	61,413,160		
三菱自動車工業	393,100	393.50	154,684,850	貸付株式数	155,200株
エフテック	800	493.00	394,400	貸付株式数	700株
レシップホールディングス	600	497.00	298,200		
G M B	300	1,024.00	307,200	貸付株式数	200株
ファルテック	200	432.00	86,400		
武蔵精密工業	24,700	3,340.00	82,498,000		
日産車体	15,300	1,111.00	16,998,300		
新明和工業	29,000	1,299.00	37,671,000		

極東開発工業	13,600	2,302.00	31,307,200	
トピー工業	8,200	1,906.00	15,629,200	貸付株式数 3,100株
ティラド	2,200	3,400.00	7,480,000	
タチエス	18,600	1,704.00	31,694,400	
N O K	39,200	2,255.00	88,396,000	貸付株式数 15,000株
フタバ産業	30,400	664.00	20,185,600	
カヤバ	17,200	2,475.00	42,570,000	
市光工業	18,200	402.00	7,316,400	
大同メタル工業	19,700	475.00	9,357,500	
プレス工業	39,400	530.00	20,882,000	貸付株式数 8,300株
ミクニ	1,400	314.00	439,600	
太平洋工業	23,100	1,297.00	29,960,700	貸付株式数 9,100株
河西工業	1,900	118.00	224,200	貸付株式数 1,700株
アイシン	213,400	1,596.00	340,586,400	
マ ッ ダ	309,600	971.50	300,776,400	
今仙電機製作所	700	498.00	348,600	貸付株式数 600株
本田技研	2,388,000	1,302.00	3,109,176,000	
スズキ	814,500	1,626.00	1,324,377,000	
SUBARU	303,900	2,470.50	750,784,950	
安永	600	491.00	294,600	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	425,500	1,312.00	558,256,000	貸付株式数 38,300株
小糸製作所	104,400	1,943.50	202,901,400	
T B K	1,300	265.00	344,500	貸付株式数 500株
エクセディ	16,500	4,460.00	73,590,000	
ミツバ	18,900	849.00	16,046,100	
豊田合成	28,900	2,480.50	71,686,450	貸付株式数 7,400株
愛三工業	19,100	1,332.00	25,441,200	
盟和産業	200	1,217.00	243,400	
日本プラスト	900	344.00	309,600	
ヨロズ	10,400	1,154.00	12,001,600	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	17,700	2,998.00	53,064,600	
新家工業	200	4,590.00	918,000	
シマノ	43,800	21,450.00	939,510,000	
テイ・エス テック	41,000	1,658.00	67,978,000	
3 3 F G	8,900	2,093.00	18,627,700	貸付株式数 3,500株
第四北越フィナンシャルG	31,200	2,867.00	89,450,400	貸付株式数 2,400株
ひろぎんHLDGS	139,700	1,163.00	162,471,100	貸付株式数 53,700株
マーキュリアホールディングス	500	895.00	447,500	貸付株式数 300株 (300株)

おきなわFG	7,800	2,474.00	19,297,200	
ダイレクトマーケティングミクス	12,500	262.00	3,275,000	
ポピンズ	1,900	1,280.00	2,432,000	
LITALICO	9,400	944.00	8,873,600	貸付株式数 700株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,589.00	317,800	貸付株式数 100株
十六FG	13,900	4,400.00	61,160,000	
北国FHD	9,700	5,300.00	51,410,000	
ネットプロHD	33,000	422.00	13,926,000	貸付株式数 300株
プロクリアホールディングス	11,300	1,797.00	20,306,100	貸付株式数 1,500株
あいちフィナンシャルグル	18,500	2,482.00	45,917,000	
ジャムコ	6,100	1,381.00	8,424,100	貸付株式数 2,300株
小野建	11,700	1,486.00	17,386,200	貸付株式数 2,400株
はるやまHLDGS	500	599.00	299,500	貸付株式数 400株
南陽	500	1,106.00	553,000	
ノジマ	34,800	2,341.00	81,466,800	貸付株式数 11,300株
佐鳥電機	7,400	1,820.00	13,468,000	
カップ・クリエイト	16,800	1,575.00	26,460,000	貸付株式数 6,400株
エコートレーディング	300	924.00	277,200	貸付株式数 100株
伯東	6,100	4,345.00	26,504,500	貸付株式数 2,300株
コンドーテック	8,200	1,379.00	11,307,800	貸付株式数 1,000株
中山福	600	363.00	217,800	
ライトオン	900	209.00	188,100	貸付株式数 800株
ナガイレーベン	13,500	2,125.00	28,687,500	貸付株式数 2,600株
三菱食品	9,800	4,790.00	46,942,000	
良品計画	127,000	3,119.00	396,113,000	
バリミキホールディングス	1,600	294.00	470,400	
松田産業	8,100	3,080.00	24,948,000	
第一興商	41,300	1,855.00	76,611,500	貸付株式数 16,300株
メディパルHD	115,700	2,429.50	281,093,150	
アドヴァングループ	9,100	967.00	8,799,700	貸付株式数 3,500株
SPK	4,300	2,024.00	8,703,200	
萩原電気HLDGS	4,600	3,155.00	14,513,000	
アルビス	3,500	2,602.00	9,107,000	
アズワン	33,100	2,704.50	89,518,950	
スズデン	4,600	1,838.00	8,454,800	
尾家産業	300	1,968.00	590,400	
シモジマ	7,100	1,285.00	9,123,500	

ドウシシャ	9,900	2,103.00	20,819,700		
小津産業	300	1,652.00	495,600	貸付株式数	200株
コナカ	1,400	241.00	337,400		
高速	6,300	2,425.00	15,277,500		
ハウス ローゼ	100	1,451.00	145,100		
G-7ホールディングス	11,600	1,439.00	16,692,400		
たけびし	4,500	2,093.00	9,418,500	貸付株式数	1,700株
イオン北海道	26,300	864.00	22,723,200	貸付株式数	10,100株
コジマ	20,600	1,089.00	22,433,400	貸付株式数	7,900株 (2,100株)
ヒマラヤ	400	848.00	339,200	貸付株式数	300株
コーナン商事	11,800	3,590.00	42,362,000		
ネットワンシステムズ	41,800	4,489.00	187,640,200		
エコス	4,000	2,008.00	8,032,000	貸付株式数	1,400株
ワタミ	12,900	1,015.00	13,093,500	貸付株式数	4,400株
マルシェ	400	203.00	81,200	貸付株式数	300株
リックス	2,400	2,760.00	6,624,000		
システムソフト	35,200	58.00	2,041,600	貸付株式数	1,500株
パンパシフィックHD	215,400	3,796.00	817,658,400		
丸文	9,500	1,058.00	10,051,000		
西松屋チェーン	23,600	2,340.00	55,224,000	貸付株式数	8,200株
ゼンショーホールディングス	60,600	9,099.00	551,399,400		
ハピネット	8,200	4,240.00	34,768,000	貸付株式数	3,400株
幸楽苑	7,900	1,308.00	10,333,200	貸付株式数	2,700株
ハークスレイ	400	677.00	270,800		
橋本総業HLDGS	4,200	1,187.00	4,985,400	貸付株式数	1,500株
日本ライフライン	28,600	1,315.00	37,609,000		
サイゼリヤ	15,800	5,240.00	82,792,000	貸付株式数	6,000株
タカショー	8,600	450.00	3,870,000	貸付株式数	3,300株
V Tホールディングス	41,600	474.00	19,718,400		
アルゴグラフィックス	9,300	5,230.00	48,639,000	貸付株式数	2,800株
魚力	3,700	2,397.00	8,868,900	貸付株式数	1,300株
I D O M	36,300	1,120.00	40,656,000		
日本エム・ディ・エム	8,000	611.00	4,888,000		
ポプラ	400	210.00	84,000	貸付株式数	300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,900	1,973.00	9,667,700		
ユナイテッドアローズ	11,400	2,568.00	29,275,200		

進和	6,500	2,812.00	18,278,000	貸付株式数	2,300株
エスケイジャパン	300	643.00	192,900		
ダイترون	4,600	2,729.00	12,553,400		
ハイデイ日高	17,300	2,801.00	48,457,300	貸付株式数	6,300株
シークス	15,200	1,133.00	17,221,600	貸付株式数	5,800株
京都きもの友禅HD	600	72.00	43,200		
コロワイド	60,200	1,689.50	101,707,900	貸付株式数	10,700株
田中商事	300	671.00	201,300		
オーハシテクニカ	5,100	1,944.00	9,914,400		
壱番屋	42,100	1,011.00	42,563,100	貸付株式数	6,600株
白銅	3,000	2,301.00	6,903,000	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	400	135.00	54,000	貸付株式数	200株
P L A N T	300	1,534.00	460,200	貸付株式数	200株
スギホールディングス	57,300	2,510.00	143,823,000		
ダイコー通産	100	1,231.00	123,100		
薬王堂ホールディングス	5,200	2,053.00	10,675,600		
島津製作所	145,100	4,233.00	614,208,300	貸付株式数	100株
J M S	9,300	438.00	4,073,400		
クボテック	400	212.00	84,800	貸付株式数	300株
長野計器	6,600	2,410.00	15,906,000	貸付株式数	2,600株
ブイ・テクノロジー	4,900	2,218.00	10,868,200		
スター精密	17,200	1,829.00	31,458,800		
東京計器	7,100	3,315.00	23,536,500	貸付株式数	600株
愛知時計	4,800	1,978.00	9,494,400		
インターアクション	6,100	997.00	6,081,700	貸付株式数	1,200株
オーバル	1,100	366.00	402,600	貸付株式数	1,000株
東京精密	20,700	7,245.00	149,971,500		
マニー	40,300	1,731.00	69,759,300	貸付株式数	15,900株
ニコン	159,000	1,782.00	283,338,000	貸付株式数	54,800株
トプコン	57,200	1,602.50	91,663,000		
オリンパス	577,000	2,344.00	1,352,488,000		
理研計器	14,300	3,755.00	53,696,500	貸付株式数	5,600株
SCREENホールディングス	42,100	9,784.00	411,906,400		
キヤノン電子	9,500	2,478.00	23,541,000		
タムロン	13,900	4,285.00	59,561,500		
H O Y A	196,900	19,525.00	3,844,472,500		
シード	900	480.00	432,000		
ノーリツ鋼機	9,500	4,360.00	41,420,000		
A&Dホロンホールディングス	12,600	1,915.00	24,129,000		

朝日インテック	122,900	2,609.00	320,646,100	貸付株式数	6,100株
キヤノン	502,700	4,904.00	2,465,240,800		
リコー	265,500	1,738.50	461,571,750		
シチズン時計	92,700	886.00	82,132,200		
リズム	300	3,730.00	1,119,000	貸付株式数	200株
大研医器	1,000	505.00	505,000		
メニコン	37,600	1,520.00	57,152,000	貸付株式数	9,800株
シンシア	100	533.00	53,300		
KYORITSU	1,600	152.00	243,200		
中本パックス	400	1,707.00	682,800		
パラマウントベッドHD	23,300	2,531.00	58,972,300		
トランザクション	6,600	2,242.00	14,797,200	貸付株式数	2,500株
粧美堂	300	515.00	154,500	貸付株式数	200株
ニホンフラッシュ	8,500	830.00	7,055,000		
前田工織	18,000	1,800.00	32,400,000		
永大産業	1,300	209.00	271,700		
アートネイチャー	10,400	811.00	8,434,400		
フルヤ金属	9,600	3,435.00	32,976,000		
バンダイナムコHLDGS	273,600	3,179.00	869,774,400		
アイフィスジャパン	300	568.00	170,400	貸付株式数	100株
SHOEI	28,300	2,396.00	67,806,800	貸付株式数	100株
フランスベッドHLDGS	14,500	1,249.00	18,110,500	貸付株式数	5,500株
マーベラス	18,800	572.00	10,753,600	貸付株式数	7,200株
パイロットコーポレーション	15,800	4,790.00	75,682,000		
萩原工業	6,700	1,371.00	9,185,700	貸付株式数	1,200株
エイベックス	19,000	1,509.00	28,671,000		
フジシールインターナショナル	22,700	2,504.00	56,840,800	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	42,300	4,225.00	178,717,500	貸付株式数	16,500株
広済堂ホールディングス	38,000	572.00	21,736,000	貸付株式数	14,900株
エステールホールディングス	200	601.00	120,200		
レック	12,900	1,267.00	16,344,300	貸付株式数	4,300株
タカノ	400	693.00	277,200		
三光合成	12,700	581.00	7,378,700		
プロネクサス	10,400	1,246.00	12,958,400		
ホクシン	900	100.00	90,000		
ウッドワン	400	807.00	322,800	貸付株式数	300株

きもと	1,800	288.00	518,400	
TOPPANホールディングス	132,100	4,034.00	532,891,400	
大日本印刷	209,000	2,251.00	470,459,000	
共同印刷	2,800	4,055.00	11,354,000	
N I S S H A	17,300	1,629.00	28,181,700	
光村印刷	100	1,448.00	144,800	
Z A C R O S	8,000	4,125.00	33,000,000	貸付株式数 3,000株
ヴィア・ホールディングス	2,300	128.00	294,400	
TAKARA & COMPANY	5,900	2,715.00	16,018,500	
前澤化成工業	7,100	1,784.00	12,666,400	貸付株式数 2,500株
未来工業	3,600	3,950.00	14,220,000	貸付株式数 1,300株
アシックス	372,100	3,134.00	1,166,161,400	
ツ ツ ミ	2,400	2,082.00	4,996,800	
ウェーブロックHLDGS	400	641.00	256,400	
ジェイ エス ピー	8,300	2,104.00	17,463,200	貸付株式数 2,300株
ニチハ	12,700	2,885.00	36,639,500	貸付株式数 4,300株
ローランド	7,400	3,810.00	28,194,000	
エフピコ	22,300	2,743.00	61,168,900	
小松ウオール工業	7,400	1,503.00	11,122,200	
ヤマハ	184,200	1,105.00	203,541,000	
河合楽器	3,100	2,861.00	8,869,100	
クリナップ	9,900	688.00	6,811,200	
ビジョン	64,200	1,477.00	94,823,400	
天馬	8,400	3,010.00	25,284,000	貸付株式数 2,100株
キングジム	8,900	848.00	7,547,200	貸付株式数 3,400株 (200株)
象印マホービン	30,100	1,534.00	46,173,400	
リンテック	20,200	3,020.00	61,004,000	貸付株式数 5,300株
信越ポリマー	21,800	1,670.00	36,406,000	
東リ	2,900	457.00	1,325,300	
イトーキ	20,100	1,572.00	31,597,200	
任天堂	636,300	8,855.00	5,634,436,500	
三菱鉛筆	14,000	2,400.00	33,600,000	貸付株式数 5,400株
松風	10,100	2,028.00	20,482,800	
タカラスタンダ - ド	23,200	1,635.00	37,932,000	
コクヨ	50,400	2,825.00	142,380,000	
ナカバヤシ	10,900	510.00	5,559,000	
ニフコ	37,800	3,568.00	134,870,400	
立川ブラインド	4,700	1,355.00	6,368,500	貸付株式数 1,800株

グローブライド	10,000	1,900.00	19,000,000	貸付株式数	3,000株
オカムラ	30,300	1,960.00	59,388,000		
バルカー	7,700	3,305.00	25,448,500		
MUTOHホールディングス	200	2,432.00	486,400		
伊藤忠	716,800	7,502.00	5,377,433,600		
丸紅	876,300	2,282.00	1,999,716,600		
スクロール	15,900	1,025.00	16,297,500		
高島	800	1,224.00	979,200	貸付株式数	600株
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,844.00	18,624,400	貸付株式数	3,800株
三陽商会	5,200	2,728.00	14,185,600		
長瀬産業	47,600	3,083.00	146,750,800		
ナイガイ	400	238.00	95,200	貸付株式数	300株
蝶理	5,700	3,925.00	22,372,500	貸付株式数	1,900株
豊田通商	320,300	2,648.50	848,314,550		
オンワードホールディングス	65,500	529.00	34,649,500		
三共生興	13,900	606.00	8,423,400		
兼松	44,600	2,524.50	112,592,700		
美津濃	10,000	8,380.00	83,800,000		
ツカモトコーポレーション	200	1,088.00	217,600		
ルックホールディングス	3,200	2,560.00	8,192,000		
三井物産	1,566,800	3,197.00	5,009,059,600		
日本紙パルプ	51,000	651.00	33,201,000		
東京エレクトロン	213,300	23,640.00	5,042,412,000		
カメイ	11,300	1,842.00	20,814,600		
東都水産	100	5,490.00	549,000		
OUGホールディングス	200	2,619.00	523,800		
スターゼン	7,400	2,837.00	20,993,800		
セイコーグループ	15,600	4,190.00	65,364,000		
山善	35,900	1,306.00	46,885,400	貸付株式数	13,600株
椿本興業	5,900	1,918.00	11,316,200	貸付株式数	2,400株
住友商事	639,000	3,264.00	2,085,696,000		
BIPROGY	34,100	4,630.00	157,883,000		
内田洋行	4,300	6,950.00	29,885,000		
三菱商事	1,970,800	2,565.00	5,055,102,000		
第一実業	10,000	2,430.00	24,300,000	貸付株式数	3,200株
キヤノンマーケティングJPN	20,900	4,843.00	101,218,700		
西華産業	5,100	4,840.00	24,684,000		
佐藤商事	7,400	1,383.00	10,234,200		

東京産業	10,800	720.00	7,776,000	貸付株式数	3,200株
ユアサ商事	9,200	4,325.00	39,790,000		
神鋼商事	2,300	6,000.00	13,800,000		
トルク	800	212.00	169,600		
阪和興業	17,600	4,840.00	85,184,000		
正栄食品	7,100	4,270.00	30,317,000	貸付株式数	2,800株 (1,100株)
カナデン	8,000	1,430.00	11,440,000		
R Y O D E N	8,600	2,318.00	19,934,800		
ニプロ	84,000	1,379.00	115,836,000	貸付株式数	32,100株
岩谷産業	105,900	1,863.00	197,291,700	貸付株式数	41,800株
ナイス	2,500	1,541.00	3,852,500		
ニチモウ	400	1,898.00	759,200		
極東貿易	6,400	1,580.00	10,112,000		
アステナホールディングス	20,100	486.00	9,768,600	貸付株式数	7,700株
三愛オブリ	24,900	1,911.00	47,583,900		
稲畑産業	28,900	3,250.00	93,925,000		
G S I クレオス	5,700	2,090.00	11,913,000	貸付株式数	2,100株
明和産業	15,200	633.00	9,621,600		
クワザワホールディングス	400	630.00	252,000	貸付株式数	300株
ゴ - ルドウィン	17,900	8,835.00	158,146,500	貸付株式数	3,100株
ユニ・チャ - ム	210,600	3,916.00	824,709,600		
キング	400	723.00	289,200		
ワキタ	15,700	1,572.00	24,680,400		
ヤマトインタ - ナショナル	800	323.00	258,400		
東邦ホールディングス	28,800	4,284.00	123,379,200	貸付株式数	10,100株
サンゲツ	26,800	2,899.00	77,693,200		
ミツウロコグループ	13,600	1,672.00	22,739,200		
シナネンホールディングス	3,000	6,390.00	19,170,000	貸付株式数	1,100株
伊藤忠エネクス	26,400	1,646.00	43,454,400		
サンリオ	86,600	5,018.00	434,558,800	貸付株式数	34,100株
サンワテクノス	4,800	2,197.00	10,545,600		
新光商事	14,300	1,000.00	14,300,000	貸付株式数	4,800株
トーホー	4,600	2,792.00	12,843,200	貸付株式数	100株 (100株)
三信電気	4,300	1,888.00	8,118,400		
東陽テクニカ	9,800	1,440.00	14,112,000		
モスフードサービス	15,700	3,615.00	56,755,500	貸付株式数	5,000株
加賀電子	21,600	2,633.00	56,872,800	貸付株式数	2,500株
都築電気	6,100	2,464.00	15,030,400		

ソーダニツカ	10,400	1,120.00	11,648,000		
立花エレテック	6,400	2,625.00	16,800,000		
木曽路	16,100	2,057.00	33,117,700	貸付株式数	6,200株
SRSホールディングス	17,600	1,124.00	19,782,400	貸付株式数	6,600株
千趣会	21,600	303.00	6,544,800	貸付株式数	900株
タカキュー	900	129.00	116,100	貸付株式数	700株
リテールパートナーズ	15,800	1,251.00	19,765,800	貸付株式数	5,500株
上新電機	10,600	2,295.00	24,327,000		
日本瓦斯	51,000	2,058.50	104,983,500		
ロイヤルホールディングス	18,800	2,435.00	45,778,000	貸付株式数	7,200株
東天紅	100	857.00	85,700		
チヨダ	10,200	1,426.00	14,545,200		
ライフコーポレーション	11,200	3,375.00	37,800,000	貸付株式数	1,800株
リンガーハット	13,800	2,209.00	30,484,200	貸付株式数	5,300株
MrMaxHD	13,400	684.00	9,165,600		
テナライド	1,900	268.00	509,200	貸付株式数	1,600株
AOKIホールディングス	22,900	1,244.00	28,487,600		
オークワ	17,000	922.00	15,674,000	貸付株式数	6,500株
コメリ	14,400	3,220.00	46,368,000		
青山商事	22,800	2,265.00	51,642,000		
しまむら	25,000	8,519.00	212,975,000	貸付株式数	3,100株
はせがわ	600	305.00	183,000		
高島屋	148,200	1,218.00	180,507,600	貸付株式数	58,500株
松屋	18,100	877.00	15,873,700	貸付株式数	7,000株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	51,900	2,093.50	108,652,650	貸付株式数	16,500株
近鉄百貨店	6,100	2,028.00	12,370,800	貸付株式数	1,600株
丸井グループ	70,800	2,443.00	172,964,400		
クレディセゾン	62,900	3,608.00	226,943,200	貸付株式数	12,900株
アクシアルリテイリング	29,100	900.00	26,190,000		
井筒屋	500	409.00	204,500	貸付株式数	200株
イオン	394,300	3,618.00	1,426,577,400	貸付株式数	89,000株
イズミ	16,200	3,137.00	50,819,400	貸付株式数	2,300株
フォーバル	4,200	1,356.00	5,695,200	貸付株式数	1,000株
平和堂	17,500	2,286.00	40,005,000	貸付株式数	6,500株
フジ	19,600	2,038.00	39,944,800	貸付株式数	7,500株
ヤオコー	12,600	9,175.00	115,605,000	貸付株式数	3,800株
ゼビオホールディングス	14,400	1,117.00	16,084,800		
ケーズホールディングス	71,600	1,412.50	101,135,000	貸付株式数	26,400株

PALTAC	16,600	4,337.00	71,994,200	貸付株式数	3,900株
三谷産業	18,600	317.00	5,896,200		
OLYMPICグループ	600	461.00	276,600	貸付株式数	500株
日産東京販売HD	1,700	430.00	731,000		
あおぞら銀行	68,500	2,480.50	169,914,250	貸付株式数	17,900株
三菱UFJフィナンシャルG	6,510,000	1,826.50	11,890,515,000		
りそなホールディングス	1,225,900	1,297.50	1,590,605,250		
三井住友トラストグルー	353,400	3,800.00	1,342,920,000		
三井住友フィナンシャルG	2,070,800	3,823.00	7,916,668,400		
千葉銀行	307,400	1,292.00	397,160,800		
群馬銀行	172,400	1,112.50	191,795,000	貸付株式数	46,700株
武蔵野銀行	15,100	2,977.00	44,952,700		
千葉興業銀行	23,500	1,429.00	33,581,500	貸付株式数	5,200株
筑波銀行	43,400	245.00	10,633,000	貸付株式数	17,200株
七十七銀行	31,800	4,525.00	143,895,000		
秋田銀行	6,700	2,144.00	14,364,800		
山形銀行	11,000	982.00	10,802,000		
岩手銀行	6,300	2,689.00	16,940,700		
東邦銀行	85,600	281.00	24,053,600	貸付株式数	32,900株
東北銀行	600	1,123.00	673,800		
ふくおかフィナンシャルG	86,400	4,266.00	368,582,400		
スルガ銀行	63,000	1,059.00	66,717,000		
八十二銀行	232,400	1,044.00	242,625,600		
山梨中央銀行	11,100	1,826.00	20,268,600		
大垣共立銀行	18,900	1,901.00	35,928,900		
福井銀行	8,900	1,883.00	16,758,700	貸付株式数	1,900株
清水銀行	4,000	1,500.00	6,000,000	貸付株式数	1,100株
富山銀行	200	1,535.00	307,000	貸付株式数	100株
滋賀銀行	15,000	3,895.00	58,425,000		
南都銀行	14,900	3,180.00	47,382,000		
百五銀行	93,400	628.00	58,655,200	貸付株式数	33,700株
紀陽銀行	35,500	2,112.00	74,976,000		
ほくほくフィナンシャルG	55,800	1,878.50	104,820,300	貸付株式数	22,000株
山陰合同銀行	62,100	1,257.00	78,059,700	貸付株式数	7,000株
鳥取銀行	400	1,232.00	492,800	貸付株式数	100株
百十四銀行	9,700	3,165.00	30,700,500		
四国銀行	14,600	1,113.00	16,249,800		
阿波銀行	13,900	2,885.00	40,101,500		
大分銀行	6,000	3,150.00	18,900,000		
宮崎銀行	6,500	3,075.00	19,987,500		

佐賀銀行	5,800	2,142.00	12,423,600	
琉球銀行	22,700	1,031.00	23,403,700	貸付株式数 8,900株
セブン銀行	355,500	329.70	117,208,350	貸付株式数 122,000株
みずほフィナンシャルG	1,339,800	3,879.00	5,197,084,200	
高知銀行	400	862.00	344,800	
山口フィナンシャルG	97,300	1,641.00	159,669,300	貸付株式数 12,200株
芙蓉総合リース	9,100	11,280.00	102,648,000	貸付株式数 3,300株
みずほリース	74,600	1,005.00	74,973,000	
東京センチュリー	74,200	1,521.50	112,895,300	貸付株式数 29,300株
SBIホールディングス	159,700	3,908.00	624,107,600	
日本証券金融	36,500	2,106.00	76,869,000	
アイフル	164,400	330.00	54,252,000	
日本アジア投資	700	215.00	150,500	貸付株式数 600株
名古屋銀行	6,200	6,460.00	40,052,000	
北洋銀行	135,400	466.00	63,096,400	
大光銀行	400	1,427.00	570,800	貸付株式数 200株
愛媛銀行	14,500	1,052.00	15,254,000	
トマト銀行	400	1,135.00	454,000	貸付株式数 100株
京葉銀行	44,600	816.00	36,393,600	
栃木銀行	45,500	282.00	12,831,000	
北日本銀行	3,500	2,848.00	9,968,000	
東和銀行	18,200	649.00	11,811,800	
福島銀行	1,200	221.00	265,200	貸付株式数 1,100株
大東銀行	500	708.00	354,000	貸付株式数 100株
リコーリース	9,400	5,180.00	48,692,000	貸付株式数 3,200株
イオンフィナンシャルサー ビス	57,000	1,282.00	73,074,000	
アコム	236,200	385.00	90,937,000	
ジャックス	11,900	3,755.00	44,684,500	貸付株式数 4,700株
オリコ	32,400	832.00	26,956,800	貸付株式数 5,600株
オリックス	595,300	3,419.00	2,035,330,700	
三菱HCキャピタル	497,600	1,020.00	507,552,000	
ジャフコグループ	29,600	2,116.50	62,648,400	貸付株式数 10,800株
九州リースサービス	400	1,045.00	418,000	
トモニホールディングス	94,800	459.00	43,513,200	
大和証券G本社	709,800	1,026.50	728,609,700	
野村ホールディングス	1,669,300	921.40	1,538,093,020	
岡三証券グループ	78,400	644.00	50,489,600	貸付株式数 17,200株
丸三証券	33,000	983.00	32,439,000	貸付株式数 8,000株

東洋証券	29,600	614.00	18,174,400	
東海東京HD	117,900	483.00	56,945,700	
光世証券	300	423.00	126,900	貸付株式数 200株
水戸証券	27,200	553.00	15,041,600	
いちよし証券	20,000	1,002.00	20,040,000	
松井証券	68,400	816.00	55,814,400	
SOMPOホールディングス	485,300	4,101.00	1,990,215,300	
日本取引所グループ	590,500	1,842.00	1,087,701,000	
マネックスG	97,200	1,050.00	102,060,000	
極東証券	12,400	1,387.00	17,198,800	貸付株式数 4,800株
岩井コスモホールディング	11,300	2,275.00	25,707,500	
アイザワ証券グループ	14,300	1,781.00	25,468,300	貸付株式数 5,500株
フィデアホール	10,300	1,412.00	14,543,600	貸付株式数 3,900株
池田泉州HD	137,700	404.00	55,630,800	
アニコムホールディングス	33,700	678.00	22,848,600	
MS&AD	727,400	3,438.00	2,500,801,200	
マネーパートナーズGP	1,100	474.00	521,400	
スパークス・グループ	11,100	1,451.00	16,106,100	
小林洋行	500	270.00	135,000	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	466,800	4,305.00	2,009,574,000	
東京海上HD	969,100	5,709.00	5,532,591,900	
アドバンテッジリスクマネ	600	683.00	409,800	
イー・ギャランティ	16,200	1,675.00	27,135,000	
アサックス	400	714.00	285,600	貸付株式数 300株
NECキャピタルソリューション	4,900	3,700.00	18,130,000	
T&Dホールディングス	266,500	2,902.00	773,383,000	
アドバンスクリエイト	7,800	622.00	4,851,600	貸付株式数 2,900株
三井不動産	1,377,600	1,266.00	1,744,041,600	
三菱地所	575,000	2,113.50	1,215,262,500	
平和不動産	16,100	4,265.00	68,666,500	
東京建物	86,700	2,581.00	223,772,700	
京阪神ビルディング	16,700	1,549.00	25,868,300	
住友不動産	161,500	4,674.00	754,851,000	
太平洋興発	400	713.00	285,200	貸付株式数 200株
テーオーシー	17,700	654.00	11,575,800	
スターツコーポレーション	16,300	3,740.00	60,962,000	
フジ住宅	12,500	784.00	9,800,000	
空港施設	14,000	579.00	8,106,000	
明和地所	8,000	1,013.00	8,104,000	貸付株式数 2,800株

ゴールドクレスト	6,700	3,160.00	21,172,000	貸付株式数	1,500株
リログループ	57,700	1,844.50	106,427,650		
エスリード	4,700	4,340.00	20,398,000	貸付株式数	1,200株
日神グループHLDGS	15,900	529.00	8,411,100	貸付株式数	5,200株
日本エスコン	26,000	978.00	25,428,000	貸付株式数	3,800株
MIRARTHホールディング	58,200	509.00	29,623,800		
A V A N T I A	600	770.00	462,000	貸付株式数	500株
イオンモール	60,000	2,030.00	121,800,000		
毎日コムネット	400	708.00	283,200	貸付株式数	100株
ファースト住建	500	988.00	494,000	貸付株式数	400株
ランド	640,600	9.00	5,765,400	貸付株式数	119,600株
カチタス	26,700	2,128.00	56,817,600		
東祥	8,700	627.00	5,454,900		
トーセイ	16,500	2,430.00	40,095,000	貸付株式数	6,200株
穴吹興産	300	1,994.00	598,200	貸付株式数	200株
サンフロンティア不動産	16,500	1,857.00	30,640,500		
インテリックス	300	714.00	214,200		
ランドビジネス	400	203.00	81,200	貸付株式数	300株
サンネクスタグループ	400	1,003.00	401,200	貸付株式数	100株
グランディハウス	9,300	550.00	5,115,000	貸付株式数	2,900株
東武鉄道	106,200	2,572.00	273,146,400		
相鉄ホールディングス	33,300	2,444.00	81,385,200	貸付株式数	13,000株
東急	282,600	1,725.50	487,626,300		
京浜急行	124,700	1,340.00	167,098,000		
小田急電鉄	166,700	1,584.50	264,136,150	貸付株式数	65,700株
京王電鉄	53,300	3,916.00	208,722,800		
京成電鉄	58,500	4,523.00	264,595,500	貸付株式数	24,400株
富士急行	12,400	2,300.00	28,520,000		
東日本旅客鉄道	555,800	2,935.50	1,631,550,900		
西日本旅客鉄道	257,500	2,842.00	731,815,000		
東海旅客鉄道	388,200	3,099.00	1,203,031,800		
東京地下鉄	168,500	1,677.50	282,658,750		
西武ホールディングス	109,700	3,042.00	333,707,400	貸付株式数	22,000株
鴻池運輸	17,200	3,000.00	51,600,000	貸付株式数	1,600株
西日本鉄道	29,200	2,277.50	66,503,000	貸付株式数	11,400株
ハマキョウレックス	34,400	1,293.00	44,479,200		
サカイ引越センター	12,800	2,369.00	30,323,200		
近鉄グループHLDGS	107,800	3,174.00	342,157,200		
阪急阪神HLDGS	134,200	4,150.00	556,930,000	貸付株式数	50,400株

南海電鉄	44,900	2,425.50	108,904,950	貸付株式数	7,900株
京阪ホールディングス	55,500	3,438.00	190,809,000	貸付株式数	7,500株
神戸電鉄	2,700	2,360.00	6,372,000	貸付株式数	1,000株
名古屋鉄道	111,200	1,732.50	192,654,000	貸付株式数	33,000株
山陽電鉄	7,600	2,020.00	15,352,000	貸付株式数	2,700株
トランコム	1,200	10,250.00	12,300,000		
ヤマトホールディングス	122,300	1,712.50	209,438,750		
山九	24,300	5,164.00	125,485,200		
日新	6,900	4,360.00	30,084,000		
丸運	700	471.00	329,700	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	6,200	6,490.00	40,238,000	貸付株式数	2,100株
センコーグループHLDGS	59,200	1,503.00	88,977,600	貸付株式数	23,300株
トナミホールディングス	2,200	5,440.00	11,968,000		
ニッコンホールディングス	57,200	1,996.00	114,171,200	貸付株式数	22,400株
日石輸送	100	2,898.00	289,800		
福山通運	10,800	3,795.00	40,986,000		
セイノーホールディングス	49,500	2,450.00	121,275,000	貸付株式数	21,800株
神奈川中央交通	2,800	3,800.00	10,640,000		
AZ-COM丸和ホールディ	31,200	1,008.00	31,449,600	貸付株式数	12,200株
日本郵船	208,500	4,835.00	1,008,097,500		
商船三井	191,300	5,153.00	985,768,900		
川崎汽船	229,000	2,012.00	460,748,000		
NSユニテッド海運	6,300	4,035.00	25,420,500	貸付株式数	2,400株
明海グループ	1,200	662.00	794,400	貸付株式数	900株
飯野海運	36,900	1,115.00	41,143,500	貸付株式数	600株
共栄タンカー	200	1,082.00	216,400	貸付株式数	100株
九州旅客鉄道	77,100	3,961.00	305,393,100		
SGホールディングス	169,000	1,462.50	247,162,500	貸付株式数	9,100株
NIPPON EXPRESS	36,100	7,728.00	278,980,800		
ID&Eホールディングス	6,000	6,480.00	38,880,000		
日本航空	230,700	2,519.50	581,248,650		
ANAホールディングス	273,800	2,924.00	800,591,200		
ピーウィズ	2,100	1,502.00	3,154,200	貸付株式数	800株
TREホールディングス	23,800	1,635.00	38,913,000		
人・夢・技術グループ	4,300	1,495.00	6,428,500		
西本WISMETTAC HD	6,300	1,927.00	12,140,100	貸付株式数	600株
シルバーライフ	2,900	736.00	2,134,400	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,330.00	233,000		
GENKY DRUGSTORES	9,300	3,100.00	28,830,000		

コア商事HLDGS	7,900	602.00	4,755,800	貸付株式数	2,100株
KPPグループホールディング	22,100	650.00	14,365,000		
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,274.00	254,800	貸付株式数	100株
ブックオフGHD	7,700	1,439.00	11,080,300	貸付株式数	2,900株
ギフトホールディングス	5,300	3,310.00	17,543,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	105,000	1,104.00	115,920,000		
三井倉庫HOLD	10,400	7,510.00	78,104,000		
住友倉庫	29,900	2,727.00	81,537,300		
渋沢倉庫	4,600	3,080.00	14,168,000		
ヤマタネ	4,300	3,685.00	15,845,500		
東陽倉庫	300	1,468.00	440,400		
乾汽船	12,800	1,544.00	19,763,200	貸付株式数	4,500株
日本トランスシティ	20,200	1,036.00	20,927,200		
ケイヒン	200	1,946.00	389,200		
中央倉庫	5,900	1,556.00	9,180,400	貸付株式数	2,100株
川西倉庫	200	1,049.00	209,800	貸付株式数	100株
安田倉庫	6,900	1,737.00	11,985,300	貸付株式数	2,400株
ファイズホールディングス	200	943.00	188,600		
N I S S O H D	9,000	766.00	6,894,000	貸付株式数	3,400株
大栄環境	22,600	3,080.00	69,608,000	貸付株式数	5,500株
日本管財ホールディング	10,900	2,568.00	27,991,200		
東洋埠頭	300	1,255.00	376,500		
上組	46,500	3,372.00	156,798,000		
サンリツ	300	780.00	234,000		
キムラユニティー	500	1,445.00	722,500		
キューソー流通システム	6,700	2,414.00	16,173,800	貸付株式数	1,800株
東海運	600	320.00	192,000	貸付株式数	500株
エーアイティー	6,300	1,740.00	10,962,000		
内外トランスライン	4,000	2,804.00	11,216,000	貸付株式数	1,500株
ショーエイコーポ	400	572.00	228,800	貸付株式数	300株
日本コンセプト	3,700	1,795.00	6,641,500		
TBSホールディングス	50,800	3,820.00	194,056,000	貸付株式数	19,100株
日本テレビHLDS	89,500	2,500.00	223,750,000	貸付株式数	7,700株
朝日放送グループHD	9,500	616.00	5,852,000	貸付株式数	3,100株
テレビ朝日HD	24,500	2,213.00	54,218,500		
スカパーJSATHD	78,500	886.00	69,551,000		
テレビ東京HD	6,200	3,045.00	18,879,000	貸付株式数	2,400株
日本BS放送	400	887.00	354,800	貸付株式数	300株

ビジョン	15,100	1,420.00	21,442,000	貸付株式数	5,800株
スマートバリュー	300	300.00	90,000	貸付株式数	200株
U-NEXT HOLDINGS	33,900	1,661.00	56,307,900	貸付株式数	12,500株
ワイヤレスゲート	500	215.00	107,500		
日本通信	81,400	138.00	11,233,200	貸付株式数	33,900株
クロップス	100	986.00	98,600		
日本電信電話	30,067,400	155.20	4,666,460,480	貸付株式数	5,224,500株
K D D I	743,500	4,957.00	3,685,529,500		
ソフトバンク	16,175,000	195.00	3,154,125,000		
光通信	11,700	33,060.00	386,802,000	貸付株式数	400株
エムティーアイ	6,900	1,280.00	8,832,000	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	32,900	2,606.00	85,737,400		
ファイバーゲート	5,400	937.00	5,059,800	貸付株式数	1,700株
アイドママーケティングコ ミュ	300	225.00	67,500	貸付株式数	200株
K A D O K A W A	53,400	4,384.00	234,105,600	貸付株式数	9,300株
学研ホールディングス	18,500	1,026.00	18,981,000		
ゼンリン	17,300	810.00	14,013,000		
昭文社ホールディングス	500	394.00	197,000		
インプレスホールディング ス	1,100	138.00	151,800	貸付株式数	1,000株
東京電力HD	847,900	542.30	459,816,170	貸付株式数	326,500株
中部電力	371,400	1,611.00	598,325,400		
関西電力	505,600	1,995.50	1,008,924,800	貸付株式数	167,500株
中国電力	175,100	961.30	168,323,630		
北陸電力	103,100	904.40	93,243,640	貸付株式数	38,700株
東北電力	265,300	1,256.00	333,216,800		
四国電力	93,900	1,255.00	117,844,500		
九州電力	232,300	1,529.50	355,302,850		
北海道電力	105,500	873.80	92,185,900	貸付株式数	41,500株
沖縄電力	25,700	956.00	24,569,200	貸付株式数	9,000株
電源開発	75,900	2,522.50	191,457,750		
エフオン	7,300	409.00	2,985,700		
イーレックス	19,600	626.00	12,269,600	貸付株式数	7,600株
レノバ	27,500	786.00	21,615,000	貸付株式数	10,700株
東京瓦斯	190,500	4,521.00	861,250,500		
大阪瓦斯	198,000	3,297.00	652,806,000		
東邦瓦斯	39,700	3,814.00	151,415,800	貸付株式数	15,600株
北海道瓦斯	30,100	540.00	16,254,000	貸付株式数	5,000株

広島ガス	21,300	375.00	7,987,500	
西部ガスHLDGS	10,500	1,735.00	18,217,500	貸付株式数 4,000株
静岡ガス	23,000	1,017.00	23,391,000	
メタウォーター	13,800	1,790.00	24,702,000	
アイネット	6,100	1,615.00	9,851,500	貸付株式数 2,300株
松竹	5,800	10,700.00	62,060,000	貸付株式数 1,500株
東宝	63,300	6,535.00	413,665,500	
エイチ・アイ・エス	33,100	1,790.00	59,249,000	貸付株式数 5,300株
東映	16,700	6,300.00	105,210,000	貸付株式数 6,500株
ラックランド	4,300	1,898.00	8,161,400	貸付株式数 1,200株
NTTデータグループ	264,300	2,879.50	761,051,850	
共立メンテナンス	32,500	2,747.00	89,277,500	貸付株式数 12,800株 (600株)
イチネンホールディングス	10,100	1,877.00	18,957,700	
建設技術研究所	5,300	4,855.00	25,731,500	貸付株式数 1,600株
スペース	7,500	1,143.00	8,572,500	
アインホールディングス	14,700	5,020.00	73,794,000	貸付株式数 4,300株
燦ホールディングス	8,700	1,037.00	9,021,900	
ピー・シー・エー	6,600	2,142.00	14,137,200	
スバル興業	4,000	2,935.00	11,740,000	貸付株式数 600株
東京テアトル	400	1,086.00	434,400	貸付株式数 200株
タナベコンサルティンググループ	4,500	1,198.00	5,391,000	貸付株式数 1,100株
ビジネスB太田昭和	4,300	2,095.00	9,008,500	
ナガワ	2,800	6,120.00	17,136,000	貸付株式数 700株
東京都競馬	7,600	4,285.00	32,566,000	貸付株式数 3,000株
カナモト	16,100	2,922.00	47,044,200	
D T S	18,300	4,240.00	77,592,000	
スクウェア・エニックス・HD	50,800	6,040.00	306,832,000	
シーイーシー	12,800	2,042.00	26,137,600	
カプコン	200,900	3,510.00	705,159,000	
ニシオホールディングス	8,600	3,720.00	31,992,000	
アイ・エス・ビー	4,700	1,388.00	6,523,600	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティーズ	7,200	45.00	324,000	貸付株式数 6,800株
日本空港ビルデング	35,100	5,099.00	178,974,900	貸付株式数 8,300株
トランス・コスモス	13,200	3,435.00	45,342,000	
乃村工藝社	45,200	775.00	35,030,000	
S C S K	82,500	3,043.00	251,047,500	

藤田観光	4,600	8,930.00	41,078,000	貸付株式数	1,000株
KNT-CTホールディングス	6,200	1,200.00	7,440,000	貸付株式数	1,000株
トーカイ	9,200	2,190.00	20,148,000		
白洋舎	200	2,244.00	448,800	貸付株式数	100株
セコム	211,000	5,256.00	1,109,016,000		
N S W	4,500	3,080.00	13,860,000		
セントラル警備保障	5,600	2,687.00	15,047,200		
アイネス	7,900	1,731.00	13,674,900		
丹青社	21,900	808.00	17,695,200		
メイテックグループホール デ	38,200	2,823.50	107,857,700		
T K C	18,000	3,875.00	69,750,000	貸付株式数	3,500株
富士ソフト	26,300	9,568.00	251,638,400		
応用地質	9,700	2,410.00	23,377,000		
船井総研ホールディン	20,700	2,401.00	49,700,700	貸付株式数	6,600株
N S D	38,900	3,430.00	133,427,000	貸付株式数	9,400株
進学会ホールディングス	400	201.00	80,400	貸付株式数	200株 (200株)
丸紅建材リース	100	2,900.00	290,000		
オオバ	800	989.00	791,200		
コナミグループ	37,900	14,960.00	566,984,000		
いであ	300	2,498.00	749,400		
学 究 社	4,100	1,916.00	7,855,600		
イオンディライト	11,100	4,495.00	49,894,500		
ナック	10,500	579.00	6,079,500	貸付株式数	2,400株
福井コンピュータHLDS	7,000	2,901.00	20,307,000		
ダイセキ	25,000	3,945.00	98,625,000	貸付株式数	2,600株
ステップ	3,800	2,027.00	7,702,600		
泉州電業	7,300	5,160.00	37,668,000	貸付株式数	2,800株
GENKI GLOBAL DIN	6,000	3,700.00	22,200,000	貸付株式数	200株
トラスコ中山	22,400	2,164.00	48,473,600		
ヤマダホールディングス	328,000	450.80	147,862,400		
オートバックスセブン	37,100	1,428.00	52,978,800		
モリト	8,500	1,485.00	12,622,500		
アーケランズ	31,700	1,676.00	53,129,200		
ニトリホールディングス	38,800	19,190.00	744,572,000		
グルメ杵屋	8,600	1,064.00	9,150,400	貸付株式数	2,500株
愛 眼	800	145.00	116,000		
ケーユーホールディングス	6,200	1,132.00	7,018,400		

吉野家ホールディングス	41,700	3,235.00	134,899,500	貸付株式数 16,400株 (4,400株)
加藤産業	13,200	4,495.00	59,334,000	
北恵	300	783.00	234,900	
イノテック	7,200	1,385.00	9,972,000	
イエローハット	18,800	2,551.00	47,958,800	貸付株式数 7,400株
松屋フーズHLDGS	5,000	6,470.00	32,350,000	
JBCCホールディングス	6,700	4,720.00	31,624,000	
JKホールディングス	8,200	1,048.00	8,593,600	
サガミホールディングス	17,100	1,739.00	29,736,900	貸付株式数 5,400株 (5,400株)
日伝	6,100	3,060.00	18,666,000	貸付株式数 2,300株
ミロク情報サービス	9,200	1,938.00	17,829,600	貸付株式数 900株
北沢産業	800	356.00	284,800	貸付株式数 700株
杉本商事	9,500	1,349.00	12,815,500	貸付株式数 1,500株
因幡電機産業	29,800	3,854.00	114,849,200	
王将フードサービス	21,100	3,015.00	63,616,500	貸付株式数 6,000株
ミニストップ	8,900	1,777.00	15,815,300	貸付株式数 3,400株 (1,200株)
アークス	17,900	2,532.00	45,322,800	
パローホールディングス	20,300	2,131.00	43,259,300	
東テック	10,500	2,469.00	25,924,500	貸付株式数 4,200株
ミスミグループ本社	161,100	2,452.50	395,097,750	
アルテック	600	212.00	127,200	
ベルク	5,300	6,700.00	35,510,000	
大庄	6,400	1,041.00	6,662,400	貸付株式数 2,300株 (200株)
タキヒヨー	300	1,221.00	366,300	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	60,000	50,430.00	3,025,800,000	
ソフトバンクグループ	498,600	8,906.00	4,440,531,600	
蔵王産業	200	2,410.00	482,000	
スズケン	35,200	4,699.00	165,404,800	貸付株式数 6,800株
サンドラッグ	36,000	3,687.00	132,732,000	
サクスパーホールディング グ	10,100	918.00	9,271,800	貸付株式数 3,000株
ジェコス	6,400	982.00	6,284,800	
ヤマザワ	200	1,173.00	234,600	
やまや	300	2,829.00	848,700	貸付株式数 100株
ベルーナ	25,700	752.00	19,326,400	貸付株式数 9,600株
合計			391,517,177,670	

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

リクルートホールディングス	35,000株
日立	80,000株
トヨタ自動車	60,000株
三菱商事	60,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	230,120,675
国債証券	109,744,947,020
地方債証券	6,513,334,100
特殊債券	3,916,027,200
社債券	8,798,639,100
未収入金	3,093,325,460
未収利息	283,026,681
前払費用	17,230,518
流動資産合計	132,596,650,754
資産合計	132,596,650,754
負債の部	

流動負債		
未払金		3,254,049,550
未払解約金		57,671,306
流動負債合計		3,311,720,856
負債合計		3,311,720,856
純資産の部		
元本等		
元本	1	98,770,541,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		30,514,387,947
元本等合計		129,284,929,898
純資産合計		129,284,929,898
負債純資産合計		132,596,650,754

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11日 至2024年12月2日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	82,847,069,539円
期中追加設定元本額	30,974,683,045円
期中一部解約元本額	15,051,210,633円
期末元本額の内訳	
ファンド名	

ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	32,289,249円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	201,615,694円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	37,897,876円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	468,187,324円
DCダイワ日本債券インデックス	10,539,428,229円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	21,258,385,545円
ダイワ・バランスファンド35VA	7,858,051,431円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,399,115,999円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	177,725,433円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	194,573,887円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	45,562,825円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	29,905,466,527円
ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)	16,966,813,386円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,716,727,168円
スタイル9(4資産分散・保守型)	5,455,841円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	10,801,798円
スタイル9(4資産分散・積極型)	1,135,449円
スタイル9(6資産分散・保守型)	2,608,902円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	22,010,458円
スタイル9(6資産分散・積極型)	1,749,661円
スタイル9(8資産分散・保守型)	3,959,704円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	17,084,008円
スタイル9(8資産分散・積極型)	3,408,991円
ダイワ国内債券インデックス(投資一任専用)	7,573,847円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	691,503,280円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,910,886,543円
ダイワライフスタイル25	451,762,455円
ダイワライフスタイル50	647,337,746円
ダイワライフスタイル75	191,422,695円
計	98,770,541,951円
2. 期末日における受益権の総数	98,770,541,951口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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。 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。

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)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	2024年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	3,457,056,460
地方債証券	138,447,100

特殊債券	95,478,000
社債券	86,820,300
合計	3,777,801,860

（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

2024年12月2日現在	
該当事項はありません。	

（1口当たり情報）

2024年12月2日現在	
1口当たり純資産額	1.3089円
（1万口当たり純資産額）	（13,089円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	456 2年国債	600,000,000	597,390,000	
	457 2年国債	160,000,000	159,220,800	
	458 2年国債	680,000,000	677,184,800	
	459 2年国債	550,000,000	547,464,500	
	460 2年国債	300,000,000	298,887,000	
	461 2年国債	700,000,000	698,180,000	
	462 2年国債	250,000,000	249,277,500	
	463 2年国債	150,000,000	149,518,500	
	464 2年国債	420,000,000	418,546,800	
	465 2年国債	250,000,000	249,072,500	
	466 2年国債	900,000,000	898,128,000	
	147 5年国債	1,430,000,000	1,420,161,600	
	148 5年国債	800,000,000	792,952,000	
	149 5年国債	1,480,000,000	1,464,341,600	
	150 5年国債	1,600,000,000	1,580,752,000	

151 5年国債	850,000,000	838,457,000	
152 5年国債	600,000,000	593,142,000	
153 5年国債	600,000,000	590,826,000	
154 5年国債	1,050,000,000	1,034,838,000	
155 5年国債	730,000,000	722,685,400	
156 5年国債	770,000,000	759,982,300	
157 5年国債	200,000,000	197,098,000	
158 5年国債	950,000,000	933,147,000	
161 5年国債	880,000,000	868,868,000	
162 5年国債	200,000,000	197,186,000	
163 5年国債	1,000,000,000	989,630,000	
164 5年国債	270,000,000	264,737,700	
165 5年国債	450,000,000	443,002,500	
166 5年国債	980,000,000	968,612,400	
167 5年国債	150,000,000	148,062,000	
168 5年国債	400,000,000	398,164,000	
170 5年国債	600,000,000	596,568,000	
172 5年国債	550,000,000	544,434,000	
173 5年国債	360,000,000	357,580,800	
1 40年国債	100,000,000	106,865,000	
2 40年国債	110,000,000	112,950,200	
3 40年国債	195,000,000	198,549,000	
4 40年国債	180,000,000	181,663,200	
5 40年国債	185,000,000	177,779,450	
6 40年国債	285,000,000	265,916,400	
7 40年国債	290,000,000	256,403,500	
8 40年国債	230,000,000	186,707,100	
9 40年国債	220,000,000	127,881,600	
10 40年国債	230,000,000	157,087,700	
11 40年国債	320,000,000	207,929,600	
12 40年国債	380,000,000	215,771,600	
13 40年国債	360,000,000	199,389,600	
14 40年国債	430,000,000	252,453,000	
15 40年国債	410,000,000	264,737,000	
16 40年国債	900,000,000	635,265,000	
17 40年国債	1,000,000,000	916,020,000	
2 CT5年国債	900,000,000	890,694,000	
2 CT10年国債	800,000,000	797,624,000	
342 10年国債	710,000,000	705,981,400	

343 10年国債	780,000,000	774,259,200	
344 10年国債	780,000,000	773,058,000	
345 10年国債	950,000,000	940,395,500	
346 10年国債	780,000,000	771,084,600	
347 10年国債	1,100,000,000	1,085,799,000	
348 10年国債	1,050,000,000	1,034,838,000	
349 10年国債	1,250,000,000	1,230,012,500	
350 10年国債	800,000,000	785,808,000	
351 10年国債	600,000,000	588,258,000	
352 10年国債	20,000,000	19,570,600	
353 10年国債	750,000,000	732,435,000	
354 10年国債	1,100,000,000	1,071,818,000	
355 10年国債	620,000,000	602,683,400	
356 10年国債	700,000,000	679,084,000	
357 10年国債	860,000,000	832,815,400	
358 10年国債	600,000,000	579,996,000	
359 10年国債	840,000,000	810,499,200	
360 10年国債	1,200,000,000	1,155,696,000	
361 10年国債	800,000,000	769,248,000	
362 10年国債	1,000,000,000	959,780,000	
363 10年国債	1,080,000,000	1,033,938,000	
364 10年国債	1,100,000,000	1,050,357,000	
365 10年国債	1,400,000,000	1,333,290,000	
366 10年国債	850,000,000	812,889,000	
367 10年国債	980,000,000	934,165,400	
368 10年国債	1,200,000,000	1,140,456,000	
369 10年国債	1,140,000,000	1,106,609,400	
370 10年国債	1,500,000,000	1,452,015,000	
371 10年国債	960,000,000	918,624,000	
372 10年国債	900,000,000	888,678,000	
373 10年国債	1,200,000,000	1,161,132,000	
374 10年国債	1,150,000,000	1,129,001,000	
375 10年国債	800,000,000	804,512,000	
376 10年国債	270,000,000	265,809,600	
1 30年国債	16,000,000	17,547,200	
2 30年国債	184,000,000	199,590,320	
3 30年国債	30,000,000	32,490,000	
4 30年国債	36,000,000	40,499,640	
5 30年国債	28,000,000	30,529,800	

6 30年国債	24,000,000	26,612,160	
7 30年国債	55,000,000	60,829,450	
8 30年国債	27,000,000	28,925,100	
9 30年国債	43,000,000	44,730,320	
10 30年国債	45,000,000	45,711,900	
11 30年国債	40,000,000	42,538,800	
12 30年国債	60,000,000	65,815,200	
13 30年国債	75,000,000	81,627,750	
14 30年国債	82,000,000	92,113,060	
15 30年国債	50,000,000	56,633,500	
16 30年国債	250,000,000	283,207,500	
17 30年国債	130,000,000	146,081,000	
18 30年国債	80,000,000	89,164,800	
19 30年国債	500,000,000	557,220,000	
21 30年国債	60,000,000	66,894,000	
22 30年国債	170,000,000	193,035,000	
24 30年国債	92,000,000	104,466,920	
25 30年国債	150,000,000	166,926,000	
26 30年国債	300,000,000	337,119,000	
27 30年国債	150,000,000	170,215,500	
28 30年国債	350,000,000	396,704,000	
29 30年国債	200,000,000	223,902,000	
30 30年国債	220,000,000	242,858,000	
31 30年国債	300,000,000	326,616,000	
32 30年国債	385,000,000	423,049,550	
33 30年国債	280,000,000	295,237,600	
34 30年国債	270,000,000	291,311,100	
35 30年国債	250,000,000	261,680,000	
36 30年国債	350,000,000	365,008,000	
37 30年国債	450,000,000	461,034,000	
38 30年国債	260,000,000	261,437,800	
39 30年国債	270,000,000	275,092,200	
40 30年国債	240,000,000	240,000,000	
41 30年国債	250,000,000	245,582,500	
42 30年国債	320,000,000	313,395,200	
43 30年国債	300,000,000	293,118,000	
44 30年国債	300,000,000	291,996,000	
45 30年国債	300,000,000	281,352,000	
46 30年国債	300,000,000	280,575,000	

47	30年国債	350,000,000	332,272,500	
48	30年国債	400,000,000	365,016,000	
49	30年国債	220,000,000	200,151,600	
50	30年国債	350,000,000	280,777,000	
51	30年国債	370,000,000	263,010,800	
52	30年国債	400,000,000	296,756,000	
53	30年国債	350,000,000	264,505,500	
54	30年国債	400,000,000	315,060,000	
55	30年国債	300,000,000	235,107,000	
56	30年国債	340,000,000	265,312,200	
57	30年国債	350,000,000	271,943,000	
58	30年国債	510,000,000	394,265,700	
59	30年国債	300,000,000	225,309,000	
60	30年国債	300,000,000	235,587,000	
61	30年国債	300,000,000	223,260,000	
62	30年国債	400,000,000	281,212,000	
63	30年国債	300,000,000	204,012,000	
64	30年国債	330,000,000	223,063,500	
65	30年国債	310,000,000	208,127,800	
66	30年国債	270,000,000	180,049,500	
67	30年国債	350,000,000	245,563,500	
68	30年国債	340,000,000	237,197,600	
69	30年国債	410,000,000	292,658,000	
70	30年国債	420,000,000	297,931,200	
71	30年国債	390,000,000	275,133,300	
72	30年国債	350,000,000	245,749,000	
73	30年国債	360,000,000	251,578,800	
74	30年国債	380,000,000	287,523,200	
75	30年国債	340,000,000	277,290,400	
76	30年国債	430,000,000	358,598,500	
77	30年国債	325,000,000	283,793,250	
78	30年国債	310,000,000	256,893,900	
79	30年国債	350,000,000	274,662,500	
80	30年国債	330,000,000	299,857,800	
81	30年国債	375,000,000	324,206,250	
82	30年国債	330,000,000	298,768,800	
83	30年国債	350,000,000	346,279,500	
84	30年国債	130,000,000	125,736,000	
85	20年国債	58,000,000	59,165,220	

86 20年国債	80,000,000	81,812,800	
87 20年国債	55,000,000	56,175,900	
89 20年国債	53,000,000	54,318,640	
90 20年国債	20,000,000	20,572,600	
91 20年国債	100,000,000	103,041,000	
92 20年国債	310,000,000	319,464,300	
93 20年国債	100,000,000	103,178,000	
94 20年国債	130,000,000	134,425,200	
95 20年国債	50,000,000	52,130,500	
96 20年国債	55,000,000	57,068,000	
97 20年国債	40,000,000	41,749,200	
98 20年国債	320,000,000	333,110,400	
99 20年国債	100,000,000	104,425,000	
100 20年国債	155,000,000	162,850,750	
101 20年国債	350,000,000	369,985,000	
108 20年国債	300,000,000	314,475,000	
109 20年国債	55,000,000	57,762,650	
110 20年国債	260,000,000	275,285,400	
111 20年国債	400,000,000	426,240,000	
112 20年国債	250,000,000	265,300,000	
113 20年国債	310,000,000	329,759,400	
114 20年国債	70,000,000	74,704,000	
115 20年国債	180,000,000	193,019,400	
116 20年国債	200,000,000	215,092,000	
117 20年国債	200,000,000	214,072,000	
118 20年国債	95,000,000	101,456,200	
119 20年国債	93,000,000	98,302,860	
120 20年国債	317,000,000	331,696,120	
121 20年国債	200,000,000	212,954,000	
122 20年国債	200,000,000	211,842,000	
123 20年国債	200,000,000	215,928,000	
124 20年国債	300,000,000	322,155,000	
125 20年国債	130,000,000	141,540,100	
126 20年国債	110,000,000	118,405,100	
127 20年国債	350,000,000	374,636,500	
128 20年国債	250,000,000	268,020,000	
129 20年国債	200,000,000	213,168,000	
130 20年国債	140,000,000	149,409,400	
131 20年国債	150,000,000	159,112,500	

132 20年国債	100,000,000	106,180,000	
133 20年国債	100,000,000	106,848,000	
134 20年国債	30,000,000	32,078,100	
135 20年国債	92,000,000	97,738,960	
136 20年国債	550,000,000	580,316,000	
138 20年国債	300,000,000	314,382,000	
139 20年国債	370,000,000	390,505,400	
140 20年国債	570,000,000	606,092,400	
141 20年国債	400,000,000	425,444,000	
142 20年国債	240,000,000	257,169,600	
143 20年国債	210,000,000	221,684,400	
144 20年国債	140,000,000	146,708,800	
145 20年国債	340,000,000	361,579,800	
146 20年国債	20,000,000	21,260,800	
147 20年国債	600,000,000	632,484,000	
148 20年国債	400,000,000	417,536,000	
149 20年国債	432,000,000	450,230,400	
150 20年国債	400,000,000	412,252,000	
151 20年国債	400,000,000	403,984,000	
152 20年国債	600,000,000	604,704,000	
153 20年国債	280,000,000	284,348,400	
154 20年国債	580,000,000	581,943,000	
155 20年国債	530,000,000	519,659,700	
156 20年国債	480,000,000	438,969,600	
157 20年国債	710,000,000	630,962,800	
158 20年国債	580,000,000	531,720,800	
159 20年国債	400,000,000	369,488,000	
160 20年国債	450,000,000	419,157,000	
161 20年国債	570,000,000	522,171,300	
162 20年国債	620,000,000	565,551,600	
163 20年国債	500,000,000	453,870,000	
164 20年国債	570,000,000	508,229,100	
165 20年国債	470,000,000	416,852,400	
166 20年国債	680,000,000	617,106,800	
167 20年国債	500,000,000	438,930,000	
168 20年国債	610,000,000	524,844,000	
169 20年国債	540,000,000	455,020,200	
170 20年国債	520,000,000	435,728,800	
171 20年国債	450,000,000	374,737,500	

172	20年国債	170,000,000	143,089,000	
173	20年国債	550,000,000	460,383,000	
174	20年国債	800,000,000	665,928,000	
175	20年国債	520,000,000	437,741,200	
176	20年国債	610,000,000	510,734,700	
177	20年国債	530,000,000	433,746,700	
178	20年国債	660,000,000	546,513,000	
179	20年国債	550,000,000	453,183,500	
180	20年国債	580,000,000	501,195,400	
181	20年国債	500,000,000	437,660,000	
182	20年国債	530,000,000	478,378,000	
183	20年国債	490,000,000	463,299,900	
184	20年国債	550,000,000	492,943,000	
185	20年国債	550,000,000	491,007,000	
186	20年国債	530,000,000	504,830,300	
187	20年国債	400,000,000	367,204,000	
188	20年国債	350,000,000	337,078,000	
189	20年国債	480,000,000	484,488,000	
190	20年国債	600,000,000	593,928,000	
27	メキシコ国債	100,000,000	97,793,700	
11	フィリピン共和国	100,000,000	98,470,500	
国債証券 合計			109,744,947,020	
地方債証券	796 東京都公債	100,000,000	96,331,000	
	808 東京都公債	100,000,000	95,803,700	
	827 東京都公債	100,000,000	95,643,100	
	16 東京都20年	100,000,000	104,877,500	
	3-5 北海道公債	100,000,000	95,281,900	
	37-2 宮城県公債	100,000,000	94,953,200	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,045,800	
	262 神奈川県公債	100,000,000	99,733,900	
	27 神奈川県20年	100,000,000	102,049,400	
	31 神奈川県20年	100,000,000	96,952,200	
	420 大阪府公債	200,000,000	197,285,600	
	7 大阪府20年	200,000,000	212,606,600	
	26-2 京都府15年	100,000,000	101,101,100	
	2-1 京都府公債	200,000,000	192,581,600	
	19兵庫県公債20年	100,000,000	104,299,700	
	2-1 静岡県公債	100,000,000	96,289,800	

8 静岡県20年	200,000,000	213,033,000	
21-5 愛知県公債	100,000,000	106,499,300	
26-4 愛知県20年	100,000,000	103,666,200	
27-12 愛知県15年	100,000,000	99,411,900	
29-5 広島県公債	100,000,000	98,443,900	
25-1 広島県20年	100,000,000	105,823,300	
2-7 埼玉県公債	100,000,000	95,795,600	
4 埼玉県30年	100,000,000	88,137,600	
9 埼玉県20年	100,000,000	106,945,200	
12 埼玉県20年	100,000,000	105,739,100	
29-1 福岡県公債	100,000,000	98,679,900	
5-1 福岡県公債	100,000,000	97,206,800	
13 千葉県20年	100,000,000	105,570,100	
16 千葉県20年	100,000,000	103,849,600	
28-2 新潟県公債	100,000,000	98,874,300	
153 共同発行地方	200,000,000	199,720,800	
168 共同発行地方	100,000,000	98,848,100	
170 共同発行地方	200,000,000	197,348,000	
195 共同発行地方	100,000,000	96,453,900	
196 共同発行地方	100,000,000	96,522,400	
206 共同発行地方	100,000,000	96,178,800	
244 共同発行地方	200,000,000	192,602,400	
255 共同発行地方	100,000,000	99,423,000	
4-3 長崎県公債	100,000,000	95,840,500	
6-1 大阪市5年	100,000,000	98,956,500	
6-2 大阪市公債	100,000,000	98,758,200	
11 名古屋市20年	200,000,000	212,776,600	
10 京都市20年	100,000,000	106,110,100	
20-1 神戸市20年	100,000,000	105,541,500	
14 横浜市20年	100,000,000	105,088,000	
19 横浜市20年	100,000,000	106,366,200	
26-5 札幌市15年	100,000,000	100,609,300	
2-4 札幌市公債	100,000,000	95,816,600	
4 川崎市公債30年	100,000,000	104,544,000	
1 北九州市15年	100,000,000	100,507,300	
17 北九州市20年	100,000,000	103,465,300	
23-4 福岡市20年	100,000,000	106,570,100	
1-5 千葉市公債	100,000,000	96,116,200	
3-2 徳島県公債	100,000,000	94,822,200	

	1-1 山梨県公債	100,000,000	96,256,800	
	2-2 岡山県公債	100,000,000	95,579,400	
地方債証券 合計			6,513,334,100	
特殊債券	47日本政策投資CO	100,000,000	100,588,900	
	174 日本政策投資	300,000,000	288,514,200	
	69 政保政策投資C	100,000,000	95,467,700	
	247 道路機構	200,000,000	162,019,600	
	86 政保道路機構	100,000,000	105,438,600	
	97 政保道路機構	100,000,000	106,383,200	
	160 政保道路機構	200,000,000	212,479,000	
	223 政保道路機構	100,000,000	102,596,500	
	235 政保道路機構	100,000,000	100,377,000	
	284 政保道路機構	200,000,000	174,273,600	
	298 政保道路機構	100,000,000	90,795,900	
	321 政保道路機構	200,000,000	196,952,600	
	403 政保道路機構	100,000,000	95,702,600	
	478 政保道路機構	100,000,000	99,618,200	
	F124地方公共団体	100,000,000	101,552,000	
	F143地方公共団体	100,000,000	101,484,900	
	1 地方公共団15年	100,000,000	101,612,600	
	31 地方公共団20	100,000,000	105,084,900	
	F192地方公共団体	100,000,000	101,194,500	
	F221地方公共団体	200,000,000	202,942,200	
	F226地方公共団体	100,000,000	100,907,800	
	97政保地方公共団	100,000,000	98,562,500	
	129 地方公共団体	200,000,000	191,647,400	
	F568地方公共団体	200,000,000	179,919,600	
	4 国際協力銀行CO	100,000,000	98,982,500	
	127 都市再生	100,000,000	98,778,100	
	80 住宅支援機構	100,000,000	101,476,200	
123 住宅支援機構	100,000,000	105,698,300		
33 沖縄振興開発	200,000,000	196,218,400		
19 利付商工債	100,000,000	98,757,700		
特殊債券 合計			3,916,027,200	
社債券	4 香港上海銀行	100,000,000	99,398,700	
	33 首都高速道路	100,000,000	98,588,700	
	30 阪神高速道路	100,000,000	98,861,000	
	20 成田国際空港	100,000,000	98,853,700	
	111 東日本高速道	100,000,000	98,723,800	

101 中日本高速道	400,000,000	393,908,000	
88 西日本高速道	100,000,000	99,251,500	
32大和ハウス工業	300,000,000	297,316,200	
22 積水ハウス	100,000,000	97,964,600	
12 アサヒグループHD	100,000,000	98,661,800	
11サントリーホールディング	100,000,000	98,227,600	
11 ヒューリック	100,000,000	99,227,800	
23 森ビル	100,000,000	85,639,000	
18 セブンアンドアイ	100,000,000	97,644,000	
35 東レ	300,000,000	296,916,000	
1 レゾナックHD	100,000,000	98,264,400	
4 アステラス製薬	300,000,000	294,897,000	
20 ZHD	100,000,000	96,767,600	
18 楽天グループ	100,000,000	83,261,500	
2 AGC	100,000,000	95,767,000	
7 日本製鉄	100,000,000	98,471,100	
32 住友電工	100,000,000	97,499,900	
16 クボタ	100,000,000	98,528,100	
62 日本電気	200,000,000	195,028,800	
17 パナソニック	100,000,000	99,185,900	
41 ソニーG	100,000,000	97,187,200	
15 デンソー	100,000,000	98,413,500	
31 トヨタ自動車	100,000,000	96,244,200	
6 楽天カード	100,000,000	97,125,000	
3 オリックス銀行	200,000,000	196,047,600	
1 日生2021基金	100,000,000	98,970,700	
7 凸版印刷	100,000,000	100,114,400	
31 豊田通商	200,000,000	195,549,600	
63 住友商事	100,000,000	95,556,000	
26 りそなホールデイン	100,000,000	98,164,800	
27 りそなホールデイン	200,000,000	196,714,600	
28 三井住友TB	300,000,000	294,892,200	
36 芙蓉総合リース	100,000,000	99,116,400	
33 NTTファイナンス	100,000,000	99,981,600	
38 NTTファイナンス	200,000,000	198,307,800	
56 日産フィナンシャル	100,000,000	98,518,500	
81 ホンダファイナンス	100,000,000	98,084,600	
78 トヨタファイナンス	100,000,000	98,399,000	
42 リコーリース	100,000,000	98,622,600	

22	イオンFS	200,000,000	197,147,000	
36	三井住友F&L	200,000,000	198,230,800	
1	SOMPOHD	100,000,000	98,507,100	
7	三井住友海上	100,000,000	98,735,400	
82	三井不動産	100,000,000	97,776,900	
143	三菱地所	100,000,000	96,885,500	
111	住友不動産	100,000,000	98,407,400	
13	NTTファイナンス	100,000,000	100,141,600	
107	東日本旅客鉄	100,000,000	87,897,800	
41	東海旅客鉄道	100,000,000	104,965,800	
67	阪急阪神HLDG	100,000,000	95,512,400	
68	名古屋鉄道	200,000,000	195,609,400	
34	KDDI	100,000,000	99,606,400	
15	ソフトバンク	100,000,000	96,402,500	
509	関西電力	100,000,000	98,991,800	
538	関西電力	100,000,000	95,896,000	
448	中国電力	100,000,000	96,348,200	
560	東北電力	200,000,000	191,472,200	
332	北海道電力	100,000,000	91,202,900	
34	沖縄電力	100,000,000	98,122,600	
85	電源開発	100,000,000	99,340,100	
87	電源開発	100,000,000	97,212,000	
11	東京電力パワー	100,000,000	98,885,300	
16	JERA	100,000,000	98,617,300	
65	東京瓦斯	100,000,000	95,603,900	
50	大阪瓦斯	100,000,000	98,256,800	
社債券 合計			8,798,639,100	
合計			128,972,947,420	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	935,612,287
コール・ローン	12,314,896,732
株式	640,051,843,230
投資証券	12,968,542,961
派生商品評価勘定	531,977,165
未収入金	272,143,851
未収配当金	705,868,948
差入委託証拠金	8,426,163,601
流動資産合計	676,207,048,775
資産合計	676,207,048,775
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,188,208
未払金	351,019,600
未払解約金	96,853,900
流動負債合計	550,061,708
負債合計	550,061,708
純資産の部	
元本等	
元本	1 96,924,210,803
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	578,732,776,264
元本等合計	675,656,987,067
純資産合計	675,656,987,067
負債純資産合計	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11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

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>
----------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	78,820,737,443円
期中追加設定元本額	25,740,968,536円
期中一部解約元本額	7,637,495,176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	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)	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)	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)	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)	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)	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)	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)	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	778,108,890円
エマージングプラス(為替ヘッジなし)	
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス	6,030,483,088円
(為替ヘッジなし)	

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)	574,681,998円
D - I ' s 外国株式インデックス	16,105,975円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	46,031,100円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	9,695,253,125円
i F r e e 8資産バランス	1,527,157,717円
i F r e e 年金バランス	349,136,994円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	17,731,066円
DCダイワ外国株式インデックス	51,273,187,597円
ダイワ・ライフ・バランス30	436,772,696円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,021,616,330円
ダイワ・ライフ・バランス70	999,681,626円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,115,631,309円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	9,608,677円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	11,191,152円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,834,175,288円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,783,392円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバランス70	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)	15,080,207円
ダイワ世界バランスファンド40VA	40,375,354円
ダイワ世界バランスファンド60VA	28,290,570円
ダイワ・バランスファンド35VA	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)	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)	123,320,896円
スタイル9(4資産分散・保守型)	310,032円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	2,230,984円
スタイル9(4資産分散・積極型)	3,205,873円
スタイル9(6資産分散・保守型)	132,574円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	4,088,861円
スタイル9(6資産分散・積極型)	4,740,611円
スタイル9(8資産分散・保守型)	182,587円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	2,951,492円
スタイル9(8資産分散・積極型)	9,224,499円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,222,019,164円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	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)	5,037,602,817円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,249,722,978円
ダイワライフスタイル25	6,740,978円
ダイワライフスタイル50	31,688,743円
ダイワライフスタイル75	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)	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)	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)	74,388,492円
計	96,924,210,803円
2. 期末日における受益権の総数	96,924,210,803口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。
----------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	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	123,657,362,007	
投資証券	1,822,195,992	
合計	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	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)
市場取引				

株価指数 先物取引				
買建	22,935,030,498	-	23,364,331,715	429,301,217
合計	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	2024年12月2日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	12,847,461,390	-	12,847,949,130	487,740
アメリカ・ドル	7,322,207,200	-	7,322,560,000	352,800
イギリス・ ポンド	1,062,272,960	-	1,062,247,760	25,200
オーストラリ ア・ドル	601,938,160	-	602,055,340	117,180
カナダ・ドル	1,642,414,620	-	1,642,630,220	215,600
スイス・フラン	1,240,881,010	-	1,240,759,830	121,180
ユーロ	977,747,440	-	977,695,980	51,460
合計	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。

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。

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)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	6.9710円
(1万口当たり純資産額)	(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	
AKAMA I 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 SOFTWARE	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	
	ASHTED 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	
	SEBICORP 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	97.8%	2.2%	79.0%
	投資証券 34銘柄			
イギリス・ポンド	株式 76銘柄	99.3%	0.7%	3.5%
	投資証券 2銘柄			
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%

オーストラリア・ドル	株式	46銘柄	91.3%	8.7%	1.8%
	投資証券	8銘柄			
カナダ・ドル	株式	83銘柄	99.9%	0.1%	3.0%
	投資証券	1銘柄			
シンガポール・ドル	投資証券	2銘柄	92.8%	7.2%	0.3%
	株式	13銘柄			
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	99.5%	0.5%	7.7%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	投資証券	2銘柄	94.8%	5.2%	0.5%
	株式	22銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,265,896,841
コール・ローン	1,275,014,429
国債証券	319,553,739,746
派生商品評価勘定	1,328,423
未収入金	4,518,890,574
未収利息	2,514,700,486
前払費用	140,302,704
流動資産合計	331,269,873,203

資産合計		331,269,873,203
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		4,073,361
未払金		5,914,536,798
未払解約金		62,601,463
流動負債合計		5,981,211,622
負債合計		5,981,211,622
純資産の部		
元本等		
元本	1	89,294,936,390
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		235,993,725,191
元本等合計		325,288,661,581
純資産合計		325,288,661,581
負債純資産合計		331,269,873,203

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11日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>
-----------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	82,533,998,623円
期中追加設定元本額	16,013,244,915円
期中一部解約元本額	9,252,307,148円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスVA	324,211,441円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,781,204円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	30,636,462円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	14,033,041円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	166,011,488円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	842,983,481円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	618,852,106円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	983,420,556円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	6,128,924,602円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券イン デックス エマージングプラス(為替ヘッジな し)	1,136,925,687円
D - I ' s 外国債券インデックス	1,834,882円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	21,719,854円
i F r e e 外国債券インデックス	1,372,465,220円
i F r e e 8資産バランス	2,783,422,183円
i F r e e 年金バランス	654,931,679円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	2,273,344円
DCダイワ外国債券インデックス	51,547,640,284円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,194,034,129円
ダイワ・ライフ・バランス50	928,965,590円
ダイワ・ライフ・バランス70	743,852,613円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安 定コース)	741,160,878円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6 分散コース)	608,421,588円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成 長コース)	292,249,850円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	36,879,849円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	22,326,311円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,472,851,337円
ダイワつみたてインデックスバランス30	5,041,201円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,514,030円
ダイワつみたてインデックスバランス70	8,864,908円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジな し)(ラップ専用)	2,502,295,766円
ダイワ世界バランスファンド40VA	87,623,017円
ダイワ世界バランスファンド60VA	26,313,609円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,422,802,891円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関 投資家専用)	150,695,281円
スタイル9(4資産分散・保守型)	220,791円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	2,520,283円
スタイル9(4資産分散・積極型)	2,277,327円
スタイル9(6資産分散・保守型)	50,244円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	1,709,577円
スタイル9(6資産分散・積極型)	599,353円

スタイル9(8資産分散・保守型)	76,963円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	1,684,869円
スタイル9(8資産分散・積極型)	1,889,635円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	2,705,214円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	132,221,944円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,212,649円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,076,068,144円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,022,461,217円
ダイワライフスタイル25	25,044,104円
ダイワライフスタイル50	58,177,404円
ダイワライフスタイル75	17,056,310円
計	89,294,936,390円
2. 期末日における受益権の総数	89,294,936,390口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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。 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。
----------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月2日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	8,215,890,678	
合計	8,215,890,678	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	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)
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
売建	476,962,250	-	475,765,323	1,196,927
オーストラリア・ドル	89,511,064	-	89,254,590	256,474
シンガポール・ドル	45,701,997	-	45,642,511	59,486
デンマーク・クローネ	128,416,184	-	128,048,469	367,715
ユーロ	213,333,005	-	212,819,753	513,252
買建	1,656,792,290	-	1,652,850,425	3,941,865
アメリカ・ドル	398,967,188	-	398,128,488	838,700
イギリス・ポンド	333,726,431	-	333,253,337	473,094
イスラエル・シケル	53,402,839	-	53,489,729	86,890
オフショア・人民元	483,104,282	-	482,482,694	621,588
カナダ・ドル	38,156,338	-	38,082,332	74,006
スウェーデン・クローナ	11,630,489	-	11,623,366	7,123
ニュージーランド・ドル	52,620,253	-	52,491,554	128,699
ノルウェー・クローネ	25,831,178	-	25,771,172	60,006
ポーランド・ズロチ	91,035,683	-	90,674,460	361,223
メキシコ・ペソ	108,926,260	-	108,144,361	781,899
ユーロ	59,391,349	-	58,708,932	682,417
合計	2,133,754,540	-	2,128,615,748	2,744,938

(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。

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。

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)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	3.6429円
(1万口当たり純資産額)	(36,429円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	873,562.050	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	749,072.680	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	769,128.840	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	788,355.960	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,559,661.140	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,217,383.440	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	912,473.100	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	555,661.040	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	532,276.020	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	962,740.730	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,114,161.900	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,080,701.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,216,400.900	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,042,663.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	678,000.000	681,071.340	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,032,904.250	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,452,091.810	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,312,110.360	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,367,265.900	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,403,164.320	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,228,976.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,369,519.860	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,115,156.130	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,133,588.510	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,282,695.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,182,862.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,832,471.160	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,863,577.580	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,883,700.390	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,818,887.690	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,131,785.030	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,577,999.160	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,195,509.380	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,863,000.000	2,829,183.940	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,462,898.700	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,459,179.380	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	523,384.390	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,715,445.960	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	830,819.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,444,572.800	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,036,286.360	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,161,212.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,904,077.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,085,297.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	769,490.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,495,237.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,839,887.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,138,496.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,566,480.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,621,107.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,829,684.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,216,585.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,863,375.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,092,634.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,338,290.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,025,446.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,241,235.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,416,121.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,502,712.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,568,687.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,508,593.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,956,980.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,473,330.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,225,780.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,452,675.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,645,226.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,446,625.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,435,350.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	3,137,856.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,630,549.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,728,460.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,908,050.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,700,460.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,406,725.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,213,456.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,458,402.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,667,532.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,388,075.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,860,710.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,801,625.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,061,665.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,903,420.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,381,250.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,394,400.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,143,995.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,741,024.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	280,710.000	

0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,476,560.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,652,364.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,201,232.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	511,540.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	4,000,000.000	2,542,400.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,200,435.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,191,895.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,592,800.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,531,600.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,265,974.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,150,050.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,173,905.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,603,400.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,151,934.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,606,680.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,826,700.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,331,932.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,903,344.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,512,750.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,499,600.000	

0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,792,650.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,305,740.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,541,357.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,990,675.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,777,300.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,548,900.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,319,892.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,863,350.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,645,360.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,818,960.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,477,389.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,284,900.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,455,140.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,325,248.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,840,538.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,444,520.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,178,108.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,526,550.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,744,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,574,544.000	

2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,405,871.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,894,810.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,655,660.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,474,500.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,484,550.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,710,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,496,450.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,296,405.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,341,200.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,933,666.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,833,040.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,412,480.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,608,140.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,777,480.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,065,648.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,593,120.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,769,840.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,641,246.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,915,236.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,509,771.000	

2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,874,500.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,569,700.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,757,000.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,795,190.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,819,900.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,544,003.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,756,050.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,283,085.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,851,920.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,905,410.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,669,160.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,928,740.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,858,400.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,936,580.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,928,567.500	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,624,385.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,011,280.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,736,400.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,151,411.200	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,435,400.000	

3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,353,070.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,475,175.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,500,805.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,001,500.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,691,692.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,450,657.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,987,220.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,474,750.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,979,960.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,364,975.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,487,820.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,493,085.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,948,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,489,995.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,860,400.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,487,820.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,630,240.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,318,925.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,922,875.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,632,549.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	3,980,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,989,140.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,510,250.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,758,960.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,643,908.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,986,320.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,912,610.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,961,120.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,965,000.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,357,584.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,886,840.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,314,500.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,641,318.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,473,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,994,540.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,946,420.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,486,910.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,020,400.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,500,735.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,753,930.000	

4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,015,300.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,771,750.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,275,873.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,982,810.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,100,279.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,025,710.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,020,790.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,538,895.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,274,298.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,007,500.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,162,720.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,231,600.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,830,248.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,386,503.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,221,675.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,609,785.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,517,395.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,039,720.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,038,480.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,007,340.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,986,520.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,411,215.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	3,000,000.000	2,997,060.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	5,995,020.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,779,456.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	986,460.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	996,600.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	8,078,230.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	3,996,160.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,298,844.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	3,008,880.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,623,904.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	5,018,550.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,228,132.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,010,350.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,002,800.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,999,600.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,213,780.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,038,950.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,520,400.000	

4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,617,470.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,032,640.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,552,075.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,644,400.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	7,278,880.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,566,150.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,692,624.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,043,750.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,364,009.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,553,325.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,023,040.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,517,275.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	100,609.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,213,574.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,209,492.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,266,385.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,998,200.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,233,300.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,933,360.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	4,500,000.000	4,402,260.000	

	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,910,200.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,713,924.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,464,135.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,901,350.000	
	3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	980,740.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,444,425.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	779,464.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,231,345.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,301,445.700	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,008,350.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	1,900,000.000	1,908,740.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,201,470.000	
	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,600,000.000	2,659,696.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,694,300.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,806,322.000	
	アメリカ・ドル 小計		1,005,944,295.080 (151,112,952,007)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	786,109.580	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,404,773.850	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	980,830.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,079,380.000	

1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	935,100.300	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,430,719.100	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,377,120.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	778,128.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	698,775.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,150,000.000	586,845.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,299,780.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	730,660.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,057,680.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	2,750,000.000	830,142.500	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,437,060.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,423,104.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	679,252.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,554,110.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,955,875.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,500,000.000	739,800.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,520,990.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	861,768.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,372,497.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,344,194.000	

0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	4,000,000.000	3,049,920.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	648,180.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,917,548.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	299,086.800	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,994,600.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	933,400.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,433,236.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,100,500.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	871,700.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,226,774.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	2,000,000.000	2,058,600.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,505,100.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,879,993.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,080,000.000	1,014,876.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	1,500,000.000	1,487,385.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,102,541.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,100,000.000	1,100,165.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	900,000.000	883,440.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	805,104.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,020,099.080	

	4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,050,212.800	
	4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,351,512.600	
	4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,809,850.560	
	4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,575,271.320	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,275,980.600	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,239,884.800	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,079,816.400	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,389,056.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,247,835.020	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,793,758.200	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,593,664.800	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,034,740.120	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,519,439.500	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,315,630.400	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	2,020,147.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,096,048.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,285,951.200	
	イギリス・ポンド 小計		87,875,741.930 (16,757,903,986)	
イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,864,134.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,395,030.000	

	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,710,198.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,040,288.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,114,152.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,027,472.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,204,110.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	190,668.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,853,202.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	820,000.000	556,329.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,938,440.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	958,100.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,464,825.000	
	イスラエル・シュケル 小計		21,316,948.000 (882,161,391)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,026,214.190	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,316,724.380	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,296,521.480	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,753,611.080	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,041,701.220	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,129,718.520	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	685,919.520	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,618,195.040	

2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,114,953.440	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	950,856.440	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,435,950.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,796,222.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,658,509.700	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,091,900.600	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,416,726.400	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,194,155.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,673,220.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	763,350.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,026,525.000	
0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,128,492.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,332,784.000	
3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,537,310.000	
3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,913,240.000	
3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,491,792.000	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	896,886.000	
4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,094,709.000	
4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	800,000.000	791,368.000	
オーストラリア・ドル 小計		40,177,555.010 (3,920,124,042)	

オフショア・人 民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,298,800.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,330,800.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,373,450.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,144,650.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,416,280.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,563,440.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,448,240.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	12,067,755.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,494,910.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,603,750.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,152,880.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	9,531,391.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,345,590.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	22,048,490.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,957,192.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,597,560.000	
	2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	18,000,000.000	18,386,280.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,108,150.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,836,270.000	
	3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,403,350.000	

3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,855,725.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,357,040.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	11,476,960.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	21,000,000.000	25,634,070.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,767,355.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	14,473,095.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,076,000.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,328,100.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,620,192.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,705,750.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,358,500.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,702,630.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,292,800.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,187,560.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,019,920.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	33,489,280.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,903,370.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,641,524.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	23,041,395.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,839,460.000	

2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,997,310.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,687,200.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,484,880.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,042,200.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,802,800.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,882,250.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	19,000,000.000	22,720,200.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,091,770.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	42,028,800.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,461,570.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,988,750.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	41,538,000.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,383,700.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,784,500.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,876,800.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	41,932,440.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,687,000.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	61,113,600.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	37,843,920.000	
2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,175,860.000	

2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	51,999,500.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,654,740.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,460,250.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,199,280.000	
1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,203,580.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	44,000,000.000	45,069,640.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,247,570.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,835,550.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,429,870.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,230,400.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,456,000.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,306,600.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,232,650.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	44,302,720.000	
1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,009,570.000	
1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	9,994,300.000	
1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,003,960.000	
1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	12,999,350.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,003,040.000	
オフショア・人民元 小計		1,702,042,074.000 (35,220,016,229)	

カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	755,000.000	708,567.500	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,102,178.920	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,338,020.790	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,209,572.760	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,018,086.300	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,016,622.680	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,252,220.830	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	948,554.100	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,184,857.200	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	631,260.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,948,114.400	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,190,366.200	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,152,782.500	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,730,420.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,028,033.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	289,968.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,099,168.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,966,035.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,119,370.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,899,366.000	

2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,396,245.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	96,958.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,194,300.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,182,241.800	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,323,322.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	599,514.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,662,090.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	835,920.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,214,040.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,014,910.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,877,382.000	
4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,031,820.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,690,616.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	1,012,800.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,552,425.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	820,216.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	710,661.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	1,100,000.000	1,116,753.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,707,344.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	1,500,000.000	1,486,320.000	

	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	800,000.000	799,800.000	
カナダ・ドル 小計			57,159,242.480 (6,118,896,907)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	784,738.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	814,905.700	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	397,600.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	594,582.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	629,206.250	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	681,959.360	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	445,770.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	712,500.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	548,350.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	615,979.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	458,190.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	559,080.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	421,000.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	194,350.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	237,720.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	668,670.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,350.000	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	402,200.000		

	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	607,080.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	315,198.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	110,704.000	
シンガポール・ドル 小計			10,300,132.710 (1,152,481,849)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,261,949.300	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,090,034.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,894,813.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,390,849.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,102,976.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,492,650.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,971,660.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	1,200,000.000	1,228,632.000	
スウェーデン・クローナ 小計			33,433,564.400 (459,377,175)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,945,583.480	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,938,126.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,864,641.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,180,080.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	444,095.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	2,067,620.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,587.000	

デンマーク・クローネ 小計			31,490,732.480 (667,918,436)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	609,462.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,412,925.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	404,220.600	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	577,776.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	450,754.400	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	228,861.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	972,807.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	476,760.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	376,688.400	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	257,465.200	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	197,858.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	511,085.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	702,849.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	501,380.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,266,213.000	
ニュージーランド・ドル 小計			8,947,105.100 (792,802,983)	
ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,219,868.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,273,913.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,332,420.000	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,567,063.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,290,576.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,040,380.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,552,780.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,537,030.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,444,605.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,534,685.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		32,793,321.800 (444,677,444)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,218,377.520	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,988,168.800	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,348,740.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,405,850.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,022,526.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,409,202.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	487,340.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,407,900.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,187,000.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,877,000.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,966,940.000	
5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,328,190.000		

	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	1,985,220.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	904,870.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	847,666.730	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,403,917.000	
ポーランド・ズロチ 小計			43,788,908.050 (1,612,036,103)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,375,206.890	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,518,119.440	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,534,938.620	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,334,554.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,098.010	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,429,925.350	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,899,202.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,445,236.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,262,590.200	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,013,039.700	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,565,236.500	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,203,958.700	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,108,496.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,338,028.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,193,420.000	

	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	655,466.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,339,152.200	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,342,968.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,003,600.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,703,835.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,620,823.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,685,916.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,380,470.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,053,292.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,765.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,464,554.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,000,370.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,216,176.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	813,352.000	
	マレーシア・リングgit 小計		46,758,789.610 (1,578,815,207)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	35,501,198.700	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	16,861,080.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,412,210.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	28,982,840.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	25,715,700.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	21,957,410.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,381,300.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,531,600.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,624,137.600	

	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	8,871,249.060	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,182,021.600	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	16,539,618.660	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,136,949.750	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	23,595,391.260	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	6,835,573.680	
メキシコ・ペソ 小計			300,128,280.310 (2,209,184,246)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	329,918.680	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	794,382.610	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	276,825.600	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	767,016.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	414,901.900	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	470,140.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	461,335.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	233,616.000	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	272,544.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	438,275.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	202,436.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	516,612.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	192,790.000	
	0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	302,742.000	

1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	746,296.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	265,572.000	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	400,732.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	311,526.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,027,090.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	410,596.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	103,796.000	
2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	505,965.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	611,126.240	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	620,347.840	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	157,226.400	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,233,920.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	445,845.600	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,149,192.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,193,932.800	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	872,817.400	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	752,700.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	261,216.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	167,716.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,039,524.000	

0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	453,954.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	149,622.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,656,990.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,352,085.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	251,814.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	299,550.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,342,081.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	528,580.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,029,690.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	850,128.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	515,485.000	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	528,640.000	
2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	809,944.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,623,068.080	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	674,180.360	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,439,240.880	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	941,372.120	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	571,576.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,065,262.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	463,565.000	

1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	512,376.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,421,594.100	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	588,386.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,413,075.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	521,101.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	194,814.400	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	585,058.000	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,129,968.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,354,448.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	237,031.900	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,190,980.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	531,984.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	783,800.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,546,170.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	604,338.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	736,386.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,115,158.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	1,040,650.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,915.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,301,496.750	

5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,404,489.920	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,044,325.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,354,622.880	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,662,873.040	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,838,261.750	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	771,000.000	915,431.430	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,425,000.000	3,008,455.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,291,254.230	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,330,118.520	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,785,096.760	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,764,031.460	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,092,350.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,343,528.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,125,750.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,187,239.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,807,125.900	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,823,069.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,872,696.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,404,088.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,754,030.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,596,199.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,590,925.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,682,478.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,894,600.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,621,152.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,081,056.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,692,615.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,871,088.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,861,060.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	954,074.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,409,616.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	616,847.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,308,242.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,366,128.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,649,240.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	2,096,364.500	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,226,432.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,452,152.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,737,723.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	893,800.000	

2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,506,224.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,537,200.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,426,688.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,800,000.000	1,865,520.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	500,000.000	518,230.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,654,595.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,123,752.000	
3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	302,784.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	804,416.000	
2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	810,560.000	
2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,012,590.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	100,111.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,142,866.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,704,660.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,966,576.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,955,450.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	423,653.200	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	101,079.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,900.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,761.000	

2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,108,646.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,262.300	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,739,637.740	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,227,000.000	2,701,751.860	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,091,486.350	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	3,280,258.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,612,681.960	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,687,167.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,913,819.710	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,711,081.100	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,168,397.390	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,088,000.000	1,086,694.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,085,626.510	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,790,784.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,282,545.530	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,470,358.980	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	903,061.830	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,901,527.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,340,677.700	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,301,400.000	

2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,011,746.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,116,554.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,470,251.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,643,892.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,965,958.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	6,350,000.000	5,832,221.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,718,974.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,503,362.100	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,921,610.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,488,190.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,299,700.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	561,467.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,000,000.000	1,831,230.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,835,388.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,800,000.000	4,573,776.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,378,858.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,950,560.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,390,970.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,092,009.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,882,577.000	

2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	896,610.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,940,883.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,218,336.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,670,242.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,351,557.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,367,136.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	665,238.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,118,972.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,158,540.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	1,010,580.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	2,700,000.000	2,722,329.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,258,287.470	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,044,820.700	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,031,817.060	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,496,391.120	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,027,301.840	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	134,783.220	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,132,394.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,290,316.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,105,188.000	

0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	906,432.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,244,586.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,207,333.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	661,287.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,128,725.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	653,661.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	827,424.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	97,700.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	528,852.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	1,087,956.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	915,507.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,324,986.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	670,698.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	1,014,300.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,213,973.700	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,670,596.240	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,403,490.720	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,899,201.150	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,882,500.460	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,366,246.000	

1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,364,478.280	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,082,420.200	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,048,220.640	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	774,758.160	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,432,815.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,508,142.700	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,572,400.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,683,044.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,226,212.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,077,572.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,584,119.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,284,312.900	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,464,964.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,957,797.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,095,947.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,179,700.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,776,538.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,283,542.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,220,330.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,240,695.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,813,540.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,968,939.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,120,096.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,665,337.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,167,405.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,689,708.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	799,032.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	531,153.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,772,396.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,556,820.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,527,922.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,067,704.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	660,000.000	437,943.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	747,520.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,669,929.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,987,904.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	868,430.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,389,322.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	580,616.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	292,191.000	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	807,736.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,546,208.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,244,892.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	201,736.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,608,855.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,340,953.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,083,220.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	316,701.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,546,680.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,753,408.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	885,768.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	509,805.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	965,754.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,258,284.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,303,553.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	732,340.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	923,931.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,276,799.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,597,635.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	636,408.000	

2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,678.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,036,990.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,127,620.000	
3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	100,927.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	412,732.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	737,709.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	53,278.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	500,000.000	516,780.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,541,445.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,280.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	525,335.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	203,090.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	744,198.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,317,290.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	806,968.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,408,630.740	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,385,010.860	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,156,577.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,644,952.040	

4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,924,867.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,796,737.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,610,493.120	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,125,517.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,606,439.100	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,072,132.090	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,418,578.020	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,541,187.300	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,291,768.640	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,104,000.000	1,278,763.200	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,031,070.040	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	856,689.600	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	705,718.220	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	769,312.890	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	973,329.630	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	839,063.750	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,056,604.560	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	500,885.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	770,960.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	692,385.000	

1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	714,172.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	909,549.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	476,502.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	284,140.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	479,075.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	714,376.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	685,992.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	290,984.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	86,325.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	212,086.000	
2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	305,151.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	911,550.750	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,586,144.520	
4.85% Austria Government Bond 20260315	300,000.000	310,194.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	413,008.960	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	760,364.640	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	763,482.750	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	397,441.300	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	398,599.520	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,040,624.080	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,002,382.640	

1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,724,719.010	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,837,495.680	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,050,000.000	1,044,141.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,590,181.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,870,854.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,706,512.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,006,048.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,333,760.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,980,044.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,813,116.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,542,336.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	2,046,577.500	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,492,124.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,316,185.600	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	843,822.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	400,000.000	385,596.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,243,208.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	982,774.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	486,995.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,893,298.000	

1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	358,416.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,329,650.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	542,059.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,659,783.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	424,200.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	859,023.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,839,411.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,178,592.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,355,164.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,692,758.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,023,580.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,694,796.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,318,607.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,290,197.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,598,055.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	629,124.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,704,260.000	
2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,338.000	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,101,780.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,688,704.000	

3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	400,000.000	413,960.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	202,892.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,656,397.110	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,976,091.480	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,255,407.620	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,358,760.960	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,082,624.900	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,957,389.900	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,655,705.400	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	550,000.000	628,177.000	
4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	714,863.600	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	851,482.800	
3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	684,967.500	
2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,306,084.000	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	470,000.000	545,298.700	
2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	706,543.200	
1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	995,420.000	
0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	818,505.000	
0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	599,056.400	
0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	550,000.000	460,938.500	

	1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	530,000.000	332,961.900	
	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	658,860.000	
	1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	394,903.600	
	1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	543,751.500	
	3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	539,100.000	
	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	648,043.200	
	3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	261,084.000	
	ユーロ 小計		610,542,093.650 (96,624,391,741)	
国債証券 合計			319,553,739,746 [319,553,739,746]	
合計			319,553,739,746 [319,553,739,746]	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 282銘柄	100%	47.5%
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 79銘柄	100%	11.0%
カナダ・ドル	国債証券 41銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.1%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 15銘柄	100%	0.2%

ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券	29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	401銘柄	100%	30.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【スタイル9(4資産分散・バランス型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（4資産分散・バランス型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		652,501
親投資信託受益証券		50,927,484
流動資産合計		51,579,985
資産合計		51,579,985
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		3,775
未払委託者報酬		133,786
その他未払費用		1,351
流動負債合計		138,912
負債合計		138,912
純資産の部		
元本等		
元本		1 44,803,053
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,638,020
（分配準備積立金）		1,362,625
元本等合計		51,441,073
純資産合計		51,441,073
負債純資産合計		51,579,985

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	389
有価証券売買等損益	1,546,684
営業収益合計	1,547,073
営業費用	
受託者報酬	4,727
委託者報酬	168,422
その他費用	1,696
営業費用合計	174,845
営業利益又は営業損失（ ）	1,372,228
経常利益又は経常損失（ ）	1,372,228
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,372,228
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（ ）	9,603
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,480,918
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,480,918
剰余金減少額又は欠損金増加額	205,523
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	205,523
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,638,020

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	45,660,575円
期中一部解約元本額	1,857,522円
2. 計算期間末日における受益権の総数	44,803,053口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(337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(1,362,288円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,275,395円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は6,638,020円(1万口当たり1,481.60円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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	<p>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ぬ。</p>

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1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）
親投資信託受益証券	1,524,829
合計	1,524,829

(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1期 2024年12月2日現在
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1期 自2023年12月11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1期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.1482円
(1万口当たり純資産額)	(11,482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	トピックス・インデックス・マザーファンド	6,046,890	12,055,684	
	日本債券インデックスマザーファンド	10,801,798	14,138,473	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,230,984	15,552,189	
	外国債券インデックスマザーファンド	2,520,283	9,181,138	
親投資信託受益証券 合計			50,927,484	
合計			50,927,484	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載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

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

【スタイル9(4資産分散・積極型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（4資産分散・積極型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		630,306
親投資信託受益証券		49,197,685
流動資産合計		49,827,991
資産合計		49,827,991
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		3,631
未払委託者報酬		128,834
その他未払費用		1,288
流動負債合計		133,753
負債合計		133,753
純資産の部		
元本等		
元本		1 40,697,282
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,996,956
（分配準備積立金）		2,068,238
元本等合計		49,694,238
純資産合計		49,694,238
負債純資産合計		49,827,991

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	380
有価証券売買等損益	2,244,885
営業収益合計	2,245,265
営業費用	
受託者報酬	4,528
委託者報酬	162,067
その他費用	1,625
営業費用合計	168,220
営業利益又は営業損失()	2,077,045
経常利益又は経常損失()	2,077,045
当期純利益又は当期純損失()	2,077,045
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()	8,807
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,348,910
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,348,910
剰余金減少額又は欠損金増加額	420,192
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	420,192
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	8,996,956

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	42,415,564円
期中一部解約元本額	2,718,282円
2. 計算期間末日における受益権の総数	40,697,282口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(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(2,067,892円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,928,718円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は8,996,956円(1万口当たり2,210.70円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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ぬ。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1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）
親投資信託受益証券	2,253,556
合計	2,253,556

(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1期 2024年12月2日現在
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1期 自2023年12月11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1期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.2211円
(1万口当たり純資産額)	(12,211円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	8,560,607	17,067,282	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,135,449	1,486,189	
	外国株式インデックスマザーファンド	3,205,873	22,348,140	
	外国債券インデックスマザーファンド	2,277,327	8,296,074	
親投資信託受益証券 合計			49,197,685	
合計			49,197,685	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載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

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(6資産分散・保守型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（6資産分散・保守型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		75,993
親投資信託受益証券		5,616,059
流動資産合計		5,692,052
資産合計		5,692,052
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		403
未払委託者報酬		15,775
その他未払費用		175
流動負債合計		16,353
負債合計		16,353
純資産の部		
元本等		
元本		5,337,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		337,990
（分配準備積立金）		98,012
元本等合計		5,675,699
純資産合計		5,675,699
負債純資産合計		5,692,052

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
有価証券売買等損益	122,359
営業収益合計	122,359
営業費用	
受託者報酬	571
委託者報酬	22,718
その他費用	357
営業費用合計	23,646
営業利益又は営業損失（ ）	98,713
経常利益又は経常損失（ ）	98,713
当期純利益又は当期純損失（ ）	98,713
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（ ）	701
剰余金増加額又は欠損金減少額	241,623
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	241,623
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,645
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,645
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	337,990

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	4,394,036円
期中一部解約元本額	56,327円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,337,709口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(98,012円)、投資信託約款に規定される収益調整金(239,978円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は337,990円(1万口当たり633.21円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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	<p>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ぬ。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p>

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してあります。

(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1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）	
親投資信託受益証券		117,337
合計		117,337

(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1期 2024年12月2日現在	
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1期 自2023年12月11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1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)	1.0633円 (10,633円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	362,454	722,624	
	日本債券インデックスマザーファンド	2,608,902	3,414,791	
	外国株式インデックスマザーファンド	132,574	924,173	
	外国債券インデックスマザーファンド	50,244	183,033	
	ダイワJ-REITマザーファンド	73,264	227,697	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	34,142	143,741	
親投資信託受益証券 合計			5,616,059	
合計			5,616,059	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載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

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,060,487,249
投資証券	2 265,597,237,527
未収入金	597,306,501
未収配当金	2,174,967,845
前払金	385,784,000
差入委託証拠金	501,289,457
流動資産合計	276,317,072,579
資産合計	276,317,072,579
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	420,000,000
未払金	89,365,335
未払解約金	936,294,800
流動負債合計	1,445,660,135
負債合計	1,445,660,135

純資産の部		
元本等		
元本	1	88,442,480,672
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		186,428,931,772
元本等合計		274,871,412,444
純資産合計		274,871,412,444
負債純資産合計		276,317,072,579

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11日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	128,388,251,898円
期中追加設定元本額	6,758,909,572円

期中一部解約元本額	46,704,680,798円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ-REITオープン	3,447,380,821円
ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)	68,080,584,803円
ダイワJ-REITオープン(年1回決算型)	733,610,640円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	25,489,842円
iFree J-REITインデックス	608,076,523円
iFree 8資産バランス	3,271,469,481円
ダイワJ-REITオープン(奇数月決算型)	105,330,975円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	372,978円
DC・ダイワJ-REITオープン	5,229,181,761円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	9,857,945円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,759,137円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	5,620,035円
ダイワ・ノーロード J-REITファンド	85,920,670円
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	4,295,944,821円
ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	1,203,034,471円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	627,169,597円
スタイル9(6資産分散・保守型)	73,264円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	2,749,656円
スタイル9(6資産分散・積極型)	1,481,277円
スタイル9(8資産分散・保守型)	98,681円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	2,036,590円
スタイル9(8資産分散・積極型)	1,088,616円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	695,148,088円
計	88,442,480,672円
2. 期末日における受益権の総数	88,442,480,672口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 706,000,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月2日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
投資証券		16,135,828,789
合計		16,135,828,789

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2024年12月2日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	9,695,784,000	-	9,276,400,000	419,384,000
合計	9,695,784,000	-	9,276,400,000	419,384,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	3.1079円
(1万口当たり純資産額)	(31,079円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	6,118	691,945,800	
	サンケイリアルエステート	8,856	663,314,400	
	SOSILA物流リート投	13,793	1,467,575,200	
	東海道リート投資法	4,723	494,025,800	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	9,546	5,498,496,000	
	森ヒルズリート	32,508	4,056,998,400	
	産業ファンド	50,616	5,765,162,400	
	アドバンス・レジデンス	27,169	7,965,950,800	
	A P I 投資法人	13,437	4,313,277,000	
	G L P 投資法人	92,858	11,811,537,600	
	コンフォリア・レジデンシャル	13,997	3,997,543,200	
	日本プロロジスリート	48,158	11,346,024,800	
	星野リゾート・リート	11,692	2,580,424,400	
	O n e リート投資法人	4,822	1,094,111,800	
	イオンリート投資	33,911	4,269,394,900	
	ヒューリックリート投資法	24,428	3,234,267,200	
	日本リート投資法人	8,979	2,828,385,000	
	積水ハウス・リート投資	83,070	6,055,803,000	
	トーセイ・リート投資法人	6,010	742,836,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	6,816	712,953,600	
	サムティ・レジデンシャル	7,532	692,944,000	
	野村不動産マスターF	88,492	12,495,070,400	
	いちごホテルリート投資	4,575	664,747,500	
	ラサールロジポート投資	35,393	5,022,266,700	
スターアジア不動産投	50,944	2,562,483,200		
マリモ地方創生リート	5,020	555,714,000		
三井不ロジパーク	60,259.944	6,104,332,327		
日本ホテル&レジデンシャル投資法 人	5,836	384,008,800		

投資法人みらい	38,067	1,526,486,700	
三菱地所物流REIT	9,546	3,298,143,000	
CREロジスティクスファンド	11,901	1,674,470,700	
ザイマックス・リート	4,733	527,256,200	
タカラレーベン不動産投	18,054	1,534,590,000	
日本ビルファンド	161,249	20,220,624,600	
ジャパンリアルエステイト	28,396	15,731,384,000	
日本都市ファンド投資法人	143,348	12,958,659,200	
オリックス不動産投資	55,082	9,143,612,000	
日本プライムリアルティ	18,906	6,220,074,000	
NTT都市開発リート投資法人	28,099	3,192,046,400	
東急リアル・エステート	18,535	2,915,555,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	20,020	1,951,950,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	61,839	8,465,759,100	
森トラストリート投資法人	53,286	3,255,774,600	
インヴィンシブル投資法人	152,312	9,702,274,400	
フロンティア不動産投資	10,257	4,031,001,000	
平和不動産リート	20,270	2,373,617,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	18,574	4,877,532,400	
福岡リート投資法人	15,598	2,213,356,200	
KDX不動産投資法人	77,341	11,345,924,700	
いちごオフィスリート投資法人	20,171	1,587,457,700	
大和証券オフィス投資法人	11,454	3,381,220,800	
阪急阪神リート投資法人	13,181	1,552,721,800	
スタートプロシード投資法人	4,792	817,994,400	
大和ハウスリート投資法人	41,459	9,606,050,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	101,560	6,967,016,000	
大和証券リビング投資法人	40,830	3,682,866,000	
ジャパンエクセレント投資法人	23,738	2,770,224,600	
投資証券 合計		265,597,237,527	
合計		265,597,237,527	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターF

5,000口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	542,559,096
コール・ローン	414,916,867
投資信託受益証券	2,335,702,280
投資証券	45,631,535,219
派生商品評価勘定	12,193,806
未収入金	2,391,344
未収配当金	54,028,433
差入委託証拠金	550,543,477
流動資産合計	49,543,870,522
資産合計	49,543,870,522
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,352,151
未払金	96,147,875
未払解約金	5,011,800
流動負債合計	146,511,826
負債合計	146,511,826
純資産の部	
元本等	
元本	1 11,733,194,875
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	37,664,163,821
元本等合計	49,397,358,696
純資産合計	49,397,358,696

負債純資産合計	49,543,870,522
---------	----------------

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11日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>

	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	10,448,984,136円
期中追加設定元本額	2,174,731,394円
期中一部解約元本額	890,520,655円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	82,616,918円
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	2,204,202,511円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	348,914,091円
D-I's グローバルREITインデックス	1,445,976円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	19,067,880円

i F r e e 外国REITインデックス	642,354,449円
i F r e e 8資産バランス	2,473,326,927円
グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型)	396,610,437円
グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型)	232,186,406円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,633,741円
DCダイワ・グローバルREITインデックス ファンド	4,434,965,999円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,257,662円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,063,452円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジ なし)(投資一任専用)	4,337,231円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資 家専用)	130,015,618円
スタイル9(6資産分散・保守型)	34,142円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	1,707,350円
スタイル9(6資産分散・積極型)	1,422,835円
スタイル9(8資産分散・保守型)	42,365円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	1,125,932円
スタイル9(8資産分散・積極型)	1,150,162円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルRE IT	194,322,966円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファン ド	61,954,074円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジ なし)(ダイワSMA専用)	241,636,478円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資 家専用)	82,346,237円
ダイワバランスファンド2024-01(適格機関投資 家専用)	79,777,774円
ダイワバランスファンド2024-05(適格機関投資 家専用)	78,675,262円
計	11,733,194,875円
2. 期末日における受益権の総数	11,733,194,875口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p>

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	2024年12月2日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		129,301,399
投資証券		7,363,524,623
合計		7,492,826,022

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種類	2024年12月2日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	1,519,101,970	-	1,485,938,206	33,163,764
合計	1,519,101,970	-	1,485,938,206	33,163,764

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年12月2日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	452,331,868	-	452,337,287	5,419
アメリカ・ドル	289,899,632	-	289,913,600	13,968
ユーロ	162,432,236	-	162,423,687	8,549
合計	452,331,868	-	452,337,287	5,419

(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。

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。

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)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	4.2101円
(1万口当たり純資産額)	(42,101円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	158,400	15,548,544.000	
	アメリカ・ドル	小計		15,548,544.000 (2,335,702,280)	
投資信託受益証券 合計				2,335,702,280 [2,335,702,280]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,085	319,727.250	
		URBAN EDGE PROPERTIES	23,660	544,416.600	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,880	305,754.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,697	6,518,488.950	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	59,930	11,003,148.000	
		BXP INC	28,362	2,325,400.380	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,900	220,116.000	
		VORNADO REALTY TRUST	32,400	1,394,820.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18,648	229,743.360	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,656	615,885.600	
		UNITI GROUP INC	46,942	277,427.220	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,188	197,129.160	
		EQUITY RESIDENTIAL	66,657	5,109,925.620	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,798	705,585.780	
		EPR PROPERTIES	14,806	671,748.220	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	43,500.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	37,994	281,535.540	
		EQUINIX INC	18,506	18,163,268.880	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18,098	537,691.580	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,953	82,457.130	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,643	1,365,025.320	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	24,893	433,138.200			
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,748	89,737.200			
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	37,080.000			

HOST HOTELS & RESORTS INC	137,386	2,530,650.120	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	61,489	2,354,413.810	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,116	104,396.600	
RLJ LODGING TRUST	29,435	300,531.350	
FARMLAND PARTNERS INC	7,936	100,866.560	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	13,053	144,235.650	
KIMCO REALTY CORP	131,785	3,369,742.450	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,995	106,635.550	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	71,003	1,300,774.960	
WHITESTONE REIT	8,817	129,786.240	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	53,636	2,768,153.960	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU- A	23,773	226,318.960	
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,784	634,191.200	
INVITATION HOMES INC	111,425	3,816,306.250	
OUTFRONT MEDIA INC	26,900	516,749.000	
LAMAR ADVERTISING CO-A	17,100	2,291,742.000	
JBG SMITH PROPERTIES	16,561	283,027.490	
ALEXANDER & BALDWIN INC	13,894	273,433.920	
GLADSTONE LAND CORP	6,132	73,645.320	
AMERICOLD REALTY TRUST	51,043	1,217,885.980	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	43,262.730	
VICI PROPERTIES INC	204,800	6,678,528.000	
BRT APARTMENTS CORP	2,049	41,102.940	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,539	603,861.780	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	34,295	1,169,459.500	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,517	140,868.580	
BROADSTONE NET LEASE INC	36,819	644,700.690	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,816	136,969.280	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,128	259,600.320	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	43,931	959,453.040	
PARAMOUNT GROUP INC	35,039	170,289.540	

EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,774	282,483.040	
NETSTREIT CORP	14,791	239,762.110	
CTO REALTY GROWTH INC	3,700	75,517.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	42,824	1,802,033.920	
STAG INDUSTRIAL INC	35,577	1,308,877.830	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	36,960.740	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,925	55,617.250	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	23,963	946,538.500	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	38,273.040	
DIGITAL CORE REIT UNITS	169,000	103,935.000	
VENTAS INC	80,745	5,173,332.150	
CARETRUST REIT INC	32,800	977,112.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	14,800	458,356.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	58,891	1,770,852.370	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	12,802.350	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	45,776	857,384.480	
UMH PROPERTIES INC	13,139	252,268.800	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,816	87,014.400	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	6,019	34,850.010	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,900	94,737.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,829	92,621.460	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	29,100	867,471.000	
LINEAGE INC	11,600	735,672.000	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	25,632.000	
CURLINE PROPERTIES	18,444	447,451.440	
IRON MOUNTAIN INC	57,313	7,087,898.710	
TERRENO REALTY CORP	18,927	1,147,544.010	
SUN COMMUNITIES INC	22,907	2,893,841.310	
ACADIA REALTY TRUST	20,544	531,062.400	
ALEXANDER'S INC	393	87,878.730	

PROLOGIS INC	181,100	21,148,858.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30,360	3,346,582.800	
BRANDYWINE REALTY TRUST	33,041	185,029.600	
SAUL CENTERS INC	2,261	92,949.710	
VERIS RESIDENTIAL INC	15,496	282,802.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	20,768	2,612,614.400	
COUSINS PROPERTIES INC	29,716	943,185.840	
SITE CENTERS CORP	9,022	140,021.440	
EASTGROUP PROPERTIES INC	9,442	1,626,006.820	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,467	3,870,504.820	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,842	1,381,254.900	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,663	1,710,438.950	
GETTY REALTY CORP	9,698	318,870.240	
WELLTOWER INC	113,135	15,632,994.300	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	137,640	3,026,703.600	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,674	671,078.040	
SERVICE PROPERTIES TRUST	30,381	84,459.180	
EQUITY COMMONWEALTH	20,957	426,265.380	
KILROY REALTY CORP	20,667	858,300.510	
LTC PROPERTIES INC	8,490	327,629.100	
LXP INDUSTRIAL TRUST	57,532	537,924.200	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,791	3,741,370.560	
MACERICH CO/THE	46,000	975,660.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,466	2,601,119.780	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,456	648,152.400	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	35,842	1,576,331.160	
REALTY INCOME CORP	170,316	9,859,593.240	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	21,964	723,713.800	
PUBLIC STORAGE	30,803	10,720,984.150	
REGENCY CENTERS CORP	31,907	2,411,850.130	
SAFEHOLD INC	8,705	185,938.800	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	21,335	788,754.950	
SL GREEN REALTY CORP	13,762	1,076,050.780	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,467	105,214.200	
UDR INC	58,660	2,690,147.600	

	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,429	102,479.510	
	WP CAREY INC	42,776	2,440,798.560	
	ELME	16,897	286,235.180	
	AGREE REALTY CORP	19,586	1,504,204.800	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,353	2,044,835.330	
	CUBESMART	44,011	2,181,185.160	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,752	427,334.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	60,204	11,781,320.760	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	41,421	7,081,334.160	
	CENTERSPACE	2,959	214,527.500	
	KITE REALTY GROUP TRUST	42,907	1,182,945.990	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,892	86,962.440	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,128	143,134.080	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	40,119	372,304.320	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,379	515,293.810	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	30,569.550	
	DOUGLAS EMMETT INC	32,658	632,258.880	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	35,191.180	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	29,766.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	155,920	25,726.800	
	アメリカ・ドル 小計		241,837,878.600 (36,328,886,123)	
イギリス・ポ ンド	WAREHOUSE REIT PLC	77,771	65,094.320	
	HELICAL PLC	20,666	40,918.680	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	22,394.700	
	HAMMERSON REIT PLC	91,676	268,243.970	
	ASSURA PLC	601,321	237,882.580	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	121,852	107,229.760	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	47,109.310	
	CLS HOLDINGS PLC	29,656	24,110.320	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	112,420	77,232.540	
	REGIONAL REIT LTD	31,830	39,978.480	

	NEWRIVER REIT PLC	59,545	45,313.740	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	400,976	547,733.210	
	CUSTODIAN REIT PLC	90,504	73,036.720	
	PRS REIT PLC/THE	102,467	106,360.740	
	CARE REIT PLC	78,863	64,431.070	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	38,514.990	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	125,239	105,200.760	
	AEW UK REIT PLC	27,617	26,733.250	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	255,846	182,418.190	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	95,301	104,068.690	
	HOME REIT PLC	117,587	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,922	922,119.660	
	SEGR0 PLC	277,633	2,165,537.400	
	UNITE GROUP PLC/THE	85,276	752,134.320	
	BRITISH LAND CO PLC	204,758	796,099.100	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	82,018	247,694.360	
	DERWENT LONDON PLC	23,052	487,319.280	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	269,866	257,047.360	
	WORKSPACE GROUP PLC	28,401	159,897.630	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	44,854	333,938.030	
	BIG YELLOW GROUP PLC	40,322	432,251.840	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	419,254	813,352.760	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	46,805.700	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	509,269	708,393.170	
	イギリス・ポンド 小計		10,346,596.630 (1,973,095,977)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	156,103	317,981.810	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	46,479	426,677.220	
	REIT 1 LTD	40,686	770,592.840	
	イスラエル・シュケル 小計		1,515,251.870 (62,705,820)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	228,654	1,664,601.120	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	100,621.150	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	106,601	128,987.210	

	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	71,065	189,743.550	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	274,625	104,357.500	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	111,495	327,795.300	
	RURAL FUNDS GROUP	79,145	148,001.150	
	WAYPOINT REIT	142,830	358,503.300	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	139,043	561,733.720	
	CENTURIA OFFICE REIT	86,351	104,052.950	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	175,165	338,944.270	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	373,987	467,483.750	
	REGION GROUP	242,880	531,907.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	55,242	142,524.360	
	NATIONAL STORAGE REIT	291,323	728,307.500	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	43,255	116,355.950	
	SCENTRE GROUP	1,104,418	4,064,258.240	
	ARENA REIT	82,725	342,481.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	41,492	153,520.400	
	BWP TRUST	116,344	394,406.160	
	GPT GROUP	407,232	1,938,424.320	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	109,971	377,200.530	
	MIRVAC GROUP	838,850	1,811,916.000	
	STOCKLAND	507,488	2,649,087.360	
	ABACUS GROUP UNIT	90,924	110,018.040	
	GOODMAN GROUP	371,447	14,081,555.770	
	VICINITY CENTRES	822,602	1,776,820.320	
	CHARTER HALL GROUP	100,554	1,580,708.880	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	79,716	402,565.800	
	オーストラリア・ドル 小計		35,696,883.300 (3,482,944,904)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	55,580.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	9,941	160,248.920	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	76,244.000	
	SLATE GROCERY REIT	5,500	82,280.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,400	230,020.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	57,564.000	

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	25,600	129,024.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,500	494,000.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	28,200	358,422.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,800	161,172.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,700	389,298.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	33,500	468,330.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	70,604.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,200	172,368.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,800	380,508.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17,400	797,790.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,766	265,786.380	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,200	593,112.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	31,647.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,100	364,140.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	11,000	158,180.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,100	238,027.000	
	カナダ・ドル 小計		5,734,345.300 (613,861,664)	
シンガポール・ ドル	KEPPEL DC REIT	24,155	0.000	
	KEPPEL DC REIT	280,883	623,560.260	
	AIMS APAC REIT	134,700	171,069.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	623,090	567,011.900	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	101,600	71,120.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	363,740	203,694.400	

	EC WORLD REIT	36,500	5,110.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	747,777	1,959,175.740	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,149,022	2,252,083.120	
	SUNTEC REIT	465,200	530,328.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	716,900	917,632.000	
	KEPPEL REIT	496,600	424,593.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	530,956	472,550.840	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,271,302	330,538.520	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	131,700	112,603.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	250,276	533,087.880	
	STARHILL GLOBAL REIT	293,700	146,850.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	242,242	173,203.030	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	82,300	312,740.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	440,069	1,020,960.080	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	492,084	605,263.320	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	217,000	133,455.000	
	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	469,400	129,085.000	
	シンガポール・ドル 小計		11,695,714.590 (1,308,633,505)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	218,742	454,983.360	
	ニュージーランド・ドル 小計		454,983.360 (40,316,076)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,680	181,632.000	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,201	200,758.600	
	HAMBORNER REIT AG	12,056	78,002.320	
	WERELDHAVE NV	6,098	84,762.200	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,650	1,368,934.000	
	NSI NV	3,090	60,996.600	
	ICADE	5,324	118,512.240	
	CARMILA	9,521	157,096.500	
	ALTAREA	837	80,686.800	
	GECINA SA	9,170	874,359.500	
	KLEPIERRE	38,853	1,111,972.860	

	COVIVIO	9,424	490,048.000	
	MERCIALYS	15,523	162,681.040	
	AEDIFICA	8,364	485,530.200	
	COFINIMMO	6,701	380,616.800	
	RETAIL ESTATES	2,180	128,184.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,099	650,591.080	
	CARE PROPERTY INVEST	6,301	77,124.240	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,912	181,794.000	
	MONTEA NV	3,565	237,785.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	17,290.350	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,412	69,399.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	59,589	325,355.940	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	69,411	721,874.400	
	CROMWELL REIT EUR	59,320	96,098.400	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	88,042	80,118.220	
ユーロ 小計			8,422,204.790 (1,332,898,130)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	29,133	136,051,110.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,401	120,915,650.000	
	LOTTE REIT CO LTD	29,483	90,807,640.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	55,585,080.000	
	JR REIT XXVII	37,352	111,308,960.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	43,237,765.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	33,975	163,080,000.000	
韓国・ウォン 小計			720,986,205.000 (77,433,918)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	501,000	490,980.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	327,610.000	
	FORTUNE REIT	313,000	1,252,000.000	
	LINK REIT	547,700	18,539,645.000	
	CHAMPION REIT	398,000	672,620.000	
	香港・ドル 小計			21,282,855.000 (410,759,102)

投資証券 合計		45,631,535,219	
		[45,631,535,219]	
合計		47,967,237,499	
		[47,967,237,499]	

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

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 141銘柄	6.0%	94%	80.5%
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-%	100%	4.1%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	7.3%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券 23銘柄	-%	100%	2.7%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	2.8%
韓国・ウォン	投資証券 7銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【スタイル9(6資産分散・バランス型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（6資産分散・バランス型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,682,794
親投資信託受益証券		101,297,298
流動資産合計		102,980,092
資産合計		102,980,092
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		7,530
未払委託者報酬		265,502
その他未払費用		2,747
流動負債合計		275,779
負債合計		275,779
純資産の部		
元本等		
元本		1,90,282,489
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,421,824
（分配準備積立金）		2,760,170
元本等合計		102,704,313
純資産合計		102,704,313
負債純資産合計		102,980,092

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	909
有価証券売買等損益	3,148,598
営業収益合計	3,149,507
営業費用	
受託者報酬	9,440
委託者報酬	334,314
その他費用	3,440
営業費用合計	347,194
営業利益又は営業損失()	2,802,313
経常利益又は経常損失()	2,802,313
当期純利益又は当期純損失()	2,802,313
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()	42,143
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,942,158
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,942,158
剰余金減少額又は欠損金増加額	280,504
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	280,504
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	12,421,824

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	92,313,825円
期中一部解約元本額	3,031,336円
2. 計算期間末日における受益権の総数	90,282,489口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(805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(2,759,365円)、投資信託約款に規定される収益調整金(9,661,654円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は12,421,824円(1万口当たり1,375.88円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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	<p>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ぬ。</p>

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1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）
親投資信託受益証券	3,096,857
合計	3,096,857

(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1期 2024年12月2日現在
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1期 自2023年12月11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1期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.1376円
(1万口当たり純資産額)	(11,376円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	11,046,182	22,022,773	
	日本債券インデックスマザーファンド	22,010,458	28,809,488	
	外国株式インデックスマザーファンド	4,088,861	28,503,450	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,709,577	6,227,818	
	ダイワJ-REITマザーファンド	2,749,656	8,545,655	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,707,350	7,188,114	
親投資信託受益証券 合計			101,297,298	
合計			101,297,298	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載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

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(6資産分散・積極型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（6資産分散・積極型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期
		2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,037,025
親投資信託受益証券		73,407,827
流動資産合計		74,444,852
資産合計		74,444,852
負債の部		
流動負債		
未払解約金		94,481
未払受託者報酬		5,501
未払委託者報酬		194,662
その他未払費用		1,985
流動負債合計		296,629
負債合計		296,629
純資産の部		
元本等		
元本		1 60,374,954
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,773,269
（分配準備積立金）		3,604,698
元本等合計		74,148,223
純資産合計		74,148,223
負債純資産合計		74,444,852

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	659
有価証券売買等損益	4,072,127
営業収益合計	4,072,786
営業費用	
受託者報酬	6,962
委託者報酬	247,096
その他費用	2,510
営業費用合計	256,568
営業利益又は営業損失（ ）	3,816,218
経常利益又は経常損失（ ）	3,816,218
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,816,218
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（ ）	211,520
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,650,563
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,650,563
剰余金減少額又は欠損金増加額	481,992
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	481,992
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,773,269

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	62,571,812円
期中一部解約元本額	3,196,858円
2. 計算期間末日における受益権の総数	60,374,954口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(608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(3,604,090円)、投資信託約款に規定される収益調整金(10,168,571円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は13,773,269円(1万口当たり2,281.29円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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	<p>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ぬ。</p>

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1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）
親投資信託受益証券	3,949,191
合計	3,949,191

(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1期 2024年12月2日現在
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1期 自2023年12月11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1期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.2281円
(1万口当たり純資産額)	(12,281円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	12,686,752	25,293,577	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,749,661	2,290,131	
	外国株式インデックスマザーファンド	4,740,611	33,046,799	
	外国債券インデックスマザーファンド	599,353	2,183,383	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,481,277	4,603,660	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,422,835	5,990,277	
親投資信託受益証券 合計			73,407,827	
合計			73,407,827	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載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

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(8資産分散・保守型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（8資産分散・保守型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		114,261
親投資信託受益証券		8,605,809
流動資産合計		8,720,070
資産合計		8,720,070
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		646
未払委託者報酬		23,968
その他未払費用		175
流動負債合計		24,789
負債合計		24,789
純資産の部		
元本等		
元本		1 8,175,182
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		520,099
（分配準備積立金）		122,663
元本等合計		8,695,281
純資産合計		8,695,281
負債純資産合計		8,720,070

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	4
有価証券売買等損益	160,209
営業収益合計	160,213
営業費用	
受託者報酬	842
委託者報酬	32,317
その他費用	357
営業費用合計	33,516
営業利益又は営業損失（ ）	126,697
経常利益又は経常損失（ ）	126,697
当期純利益又は当期純損失（ ）	126,697
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（ ）	4,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	405,331
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	405,331
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,895
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,895
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	520,099

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	7,362,985円
期中一部解約元本額	187,803円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,175,182口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11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(4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(122,659円)、投資信託約款に規定される収益調整金(397,436円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は520,099円(1万口当たり636.19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)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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あります。

(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1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）	
親投資信託受益証券		149,428
合計		149,428

(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1期 2024年12月2日現在	
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1期 自2023年12月11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1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)	1.0636円 (10,636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	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	63,261	117,298	
	新興国株式インデックス・マザーファンド	132,029	150,895	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	560,029	1,116,529	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,959,704	5,182,856	
	外国株式インデックスマザーファンド	182,587	1,272,813	
	外国債券インデックスマザーファンド	76,963	280,368	
	ダイワJ - R E I Tマザーファンド	98,681	306,690	
	ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド	42,365	178,360	
親投資信託受益証券 合計			8,605,809	
合計			8,605,809	

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、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「新興国株式インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワJ - R E I Tマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルR E I T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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	205,148,165
コール・ローン	164,155,576
国債証券	48,270,386,284
派生商品評価勘定	1,849,481
未収入金	340,435,330
未収利息	825,961,196
前払費用	54,311,547
流動資産合計	49,862,247,579
資産合計	49,862,247,579
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,165,649
未払金	223,566,323
未払解約金	412,940
流動負債合計	226,144,912
負債合計	226,144,912
純資産の部	
元本等	
元本	1 26,769,377,774
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,866,724,893
元本等合計	49,636,102,667
純資産合計	49,636,102,667
負債純資産合計	49,862,247,579

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11日 至2024年12月2日
----	-----------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	22,947,548,923円
期中追加設定元本額	4,801,668,201円
期中一部解約元本額	979,839,350円
期末元本額の内訳	

ファンド名	
新興国債券インデックスファンド（F0Fs用） （適格機関投資家専用）	630,148,422円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	478,992,594円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券イン デックス エマージングプラス（為替ヘッジな し）	552,210,261円
D - I ' s 新興国債券インデックス	69,589,528円
i F r e e 新興国債券インデックス	9,664,720,039円
i F r e e 8資産バランス	5,399,710,158円
ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジな し）（投資一任専用）	5,572,809円
D Cダイワ新興国債券インデックスファンド	9,809,644,218円
スタイル9（8資産分散・保守型）	63,261円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,499,302円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,801,503円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	117,579,630円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	37,846,049円
計	26,769,377,774円
2. 期末日における受益権の総数	26,769,377,774口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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。

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	617,584,420
合計	617,584,420

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年12月2日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	303,863,042	-	302,783,303	1,079,739
タイ・パーツ	212,926,140	-	211,830,390	1,095,750
チェコ・コルナ	6,907,450	-	6,891,720	15,730
トルコ・リラ	25,046,720	-	25,068,760	22,040
ハンガリー・	58,982,000	-	58,991,702	9,702
フォリント				
ユーロ	732	-	731	1
買建	439,103,607	-	437,707,700	1,395,907
インド・ルピー	364,162,000	-	364,900,000	738,000
オフショア・	21,327,900	-	20,685,900	642,000
人民元				
ポーランド・	18,803,763	-	18,392,800	410,963
ズロチ				
メキシコ・ペソ	15,111,530	-	14,703,400	408,130
南アフリカ・	19,698,414	-	19,025,600	672,814
ランド				
合計	742,966,649	-	740,491,003	316,168

(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。

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。

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)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.8542円
(1万口当たり純資産額)	(18,542円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インド・ルピー	5.85% India Government Bond 20301201	48,000,000.000	45,852,960.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822	57,000,000.000	58,806,900.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814	74,000,000.000	75,526,620.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114	46,000,000.000	47,102,160.000	
		7.72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615	33,000,000.000	36,028,410.000	
		6.45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007	36,000,000.000	35,604,000.000	
		7.16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920	38,000,000.000	38,870,960.000	
		5.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511	37,000,000.000	35,427,500.000	
		5.77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803	48,000,000.000	45,896,640.000	

6.67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217	66,000,000.000	63,783,720.000	
6.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712	58,000,000.000	56,008,860.000	
6.99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215	58,000,000.000	58,397,300.000	
6.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117	53,000,000.000	52,387,850.000	
7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418	51,000,000.000	51,610,980.000	
7.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523	57,000,000.000	59,879,070.000	
7.38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620	42,000,000.000	42,824,460.000	
7.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912	70,000,000.000	72,934,400.000	
7.41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219	70,000,000.000	72,794,400.000	
7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206	54,000,000.000	55,687,500.000	
7.06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410	39,000,000.000	39,544,440.000	
7.17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417	40,000,000.000	40,638,000.000	
7.3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619	85,000,000.000	88,696,650.000	
7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724	65,000,000.000	67,028,650.000	
7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023	27,000,000.000	27,546,480.000	
7.32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113	24,000,000.000	24,769,200.000	
7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123	8,000,000.000	8,396,880.000	
7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408	66,000,000.000	67,215,720.000	
7.04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603	29,000,000.000	29,298,700.000	
7.02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618	18,000,000.000	18,186,840.000	

	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341007	30,000,000.000	30,240,000.000	
インド・ルピー 小計			1,446,986,250.000 (2,575,635,525)	
インドネシア・ ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	15,250,000,000.000	16,697,530,000.000	
	8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	10,000,000,000.000	10,954,200,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	7,000,000,000.000	7,250,250,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	9,000,000,000.000	9,337,500,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,700,000,000.000	8,610,602,000.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	17,000,000,000.000	17,959,310,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20300915	24,300,000,000.000	24,505,821,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	22,000,000,000.000	22,781,880,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	19,000,000,000.000	19,793,630,000.000	
	5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	20,600,000,000.000	20,283,584,000.000	
	6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	26,300,000,000.000	25,865,787,000.000	
	6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	6,927,992,000.000	
	6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	36,300,000,000.000	35,290,134,000.000	
	5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	15,700,000,000.000	15,165,729,000.000	
	7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	15,000,000,000.000	15,085,200,000.000	
	6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,593,134,000.000	
	7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	19,800,000,000.000	19,919,592,000.000	
	6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	16,100,000,000.000	15,941,898,000.000	

	7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	18,000,000,000.000	18,160,920,000.000	
	7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	13,000,000,000.000	13,171,080,000.000	
	6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	20,000,000,000.000	19,688,200,000.000	
	6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	26,000,000,000.000	26,142,220,000.000	
	6.75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715	5,500,000,000.000	5,419,700,000.000	
	6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20300715	7,500,000,000.000	7,411,425,000.000	
	11% Indonesia Treasury Bond 20250915	2,900,000,000.000	2,998,339,000.000	
	10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,085,450,400.000	
	9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	5,100,000,000.000	5,821,905,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	22,024,000,000.000	22,688,464,080.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,117,222,500.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	16,030,000,000.000	16,152,789,800.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	16,450,000,000.000	16,160,973,500.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	14,075,000,000.000	13,815,316,250.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	29,432,982,000.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	13,020,000,000.000	14,094,280,200.000	
	インドネシア・ルピア 小計		515,325,040,730.000 (4,895,587,887)	
ウルグアイ・ペ ン	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,753,072.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	11,250,000.000	
	9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	11,082,500.000	

ウルグアイ・ペソ 小計			25,085,572.000 (87,325,385)	
オフショア・人 民元	3.22% China Government Bond 20251206	2,200,000.000	2,241,800.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,117,568.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,340,671.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	3,400,000.000	3,498,362.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,345,698.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,101,451.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,965,504.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,197,480.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	4,000,000.000	4,060,720.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	3,700,000.000	3,903,463.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,856,290.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,985,176.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	7,572,886.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,246,850.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,593,940.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,512,680.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,597,560.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,887,498.000		
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,517,060.000		

2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,735,375.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,854,040.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,175,080.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,664,675.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,252,580.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,437,320.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,646,400.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,768,804.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,791,279.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,161,040.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	1,900,000.000	1,909,215.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,674,464.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,440,118.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,282,144.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,417,932.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,928,364.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	3,000,000.000	3,026,370.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,157,470.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,309,952.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	2,600,000.000	2,633,176.000	

2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,673,700.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,898,024.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,416,457.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,630,760.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	2,000,000.000	2,026,220.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,362,304.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,132,870.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,084,750.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	1,000,000.000	1,038,450.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	4,500,000.000	4,557,555.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	1,200,000.000	1,237,656.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,906,048.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,000,000.000	2,329,580.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,137,400.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	3,000,000.000	3,055,680.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	2,400,000.000	2,522,928.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,300,000.000	4,471,957.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,052,600.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,637,005.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	800,000.000	819,448.000	

	2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	2,200,000.000	2,237,598.000	
	1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	1,500,000.000	1,514,745.000	
	2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	1,700,000.000	1,766,878.000	
	2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	3,900,000.000	3,979,833.000	
	2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	600,000.000	609,120.000	
	2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520	2,300,000.000	2,470,384.000	
	2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725	1,700,000.000	1,782,348.000	
	1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	1,000,000.000	1,005,170.000	
	2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	3,000,000.000	3,020,640.000	
	2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815	500,000.000	507,060.000	
	1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	1,000,000.000	1,000,290.000	
	2.17% CHINA GOVERNMENT BOND 20340829	3,300,000.000	3,326,862.000	
	2.25% CHINA GOVERNMENT BOND 20390829	1,000,000.000	1,008,530.000	
	2.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20540925	1,100,000.000	1,095,490.000	
	1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	500,000.000	501,980.000	
	オフショア・人民元 小計		235,626,775.000 (4,875,777,729)	
コロンビア・ペ ソ	6% Colombian TES 20280428	6,320,000,000.000	5,678,393,600.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	5,410,000,000.000	5,334,368,200.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	4,900,000,000.000	4,393,095,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,344,410,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	600,000,000.000	591,282,000.000	

	7.25% Colombian TES 20341018	5,900,000,000.000	4,650,262,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	4,400,000,000.000	4,014,868,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	6,410,000,000.000	4,149,449,400.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	3,000,000,000.000	2,072,940,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	5,400,000,000.000	4,587,462,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	9,300,000,000.000	7,722,441,000.000	
	13.25% COLOMBIAN TES 20330209	5,200,000,000.000	5,900,752,000.000	
	11.5% COLOMBIAN TES 20460725	2,400,000,000.000	2,364,576,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			55,804,299,200.000 (1,890,538,048)	
セルビア・ディ ナール	4.5% Serbia Treasury Bonds 20260111	24,000,000.000	24,072,000.000	
	5.875% Serbia Treasury Bonds 20280208	25,000,000.000	26,443,750.000	
	4.5% Serbia Treasury Bonds 20320820	35,000,000.000	34,168,750.000	
	7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026	29,000,000.000	32,770,000.000	
セルビア・ディナール 小計			117,454,500.000 (159,521,299)	
タイ・パーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	53,850,115.500	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	31,000,000.000	31,586,520.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	42,713,496.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	37,918,486.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	43,400,000.000	43,508,066.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	48,500,000.000	53,646,335.000	

2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	34,796,347.000	
2.875% Thailand Government Bond 20281217	39,000,000.000	40,231,230.000	
3.3% Thailand Government Bond 20380617	48,000,000.000	52,326,720.000	
1.6% Thailand Government Bond 20291217	38,500,000.000	37,564,835.000	
1.6% Thailand Government Bond 20350617	20,500,000.000	19,053,315.000	
1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	37,910,210.000	
2% Thailand Government Bond 20311217	60,000,000.000	59,374,200.000	
2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	26,304,740.000	
1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	59,466,460.000	
2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	56,000,000.000	57,169,280.000	
3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	53,446,515.000	
2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	43,500,000.000	43,720,980.000	
3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	47,000,000.000	52,184,570.000	
3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	49,000,000.000	53,083,660.000	
2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	50,282,500.000	
2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	37,000,000.000	37,475,820.000	
2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	21,000,000.000	21,893,760.000	
2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117	21,000,000.000	21,235,410.000	
2.5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117	1,000,000.000	1,020,060.000	
タイ・パーツ 小計		1,021,763,630.500 (4,444,671,793)	

チェコ・コルナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	25,646,656.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	15,980,699.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	27,400,000.000	26,348,662.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	23,912,350.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	27,000,000.000	25,152,660.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	29,500,000.000	28,470,155.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	25,390,945.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	28,700,000.000	24,727,059.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	13,031,780.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	15,300,000.000	15,561,018.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	25,676,210.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	11,694,210.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	15,700,000.000	15,097,434.000	
	6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	19,500,000.000	20,123,610.000	
	5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	27,818,700.000	
	5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	22,021,715.000	
	1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	14,000,000.000	11,125,100.000	
	4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	16,000,000.000	17,190,400.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	12,000,000.000	13,068,600.000	
	6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	9,165,520.000	

	4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	14,300,000.000	14,919,619.000	
	3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20330303	4,000,000.000	3,757,960.000	
	3.6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20360603	4,000,000.000	3,850,960.000	
チェコ・コルナ 小計			419,732,022.000 (2,629,998,877)	
チリ・ペソ	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	496,845,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	928,028,100.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	689,793,300.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	1,035,000,000.000	991,633,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	720,000,000.000	708,840,000.000	
	7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	242,864,600.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	850,000,000.000	871,292,500.000	
	6.2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001	200,000,000.000	218,716,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001	510,000,000.000	516,145,500.000	
チリ・ペソ 小計			5,664,158,500.000 (873,866,374)	
ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,778,838.000	
	11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	13,670,875.000	
	10.75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601	20,000,000.000	21,220,000.000	
ドミニカ・ペソ 小計			48,669,713.000 (121,036,709)	
トルコ・リラ	10.6% Turkey Government Bond 20260211	5,570,000.000	4,179,505.200	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,029,995.000	

	10.5% Turkey Government Bond 20270811	9,000,000.000	5,554,440.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	15,000,000.000	9,376,950.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	9,100,000.000	7,508,319.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	13,900,000.000	7,882,829.000	
	16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	6,444,955.000	
	17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	7,901,880.000	
	17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	23,000,000.000	16,645,790.000	
	26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	52,000,000.000	49,832,640.000	
	31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	39,500,000.000	39,650,495.000	
	トルコ・リラ 小計		157,007,798.200 (680,142,081)	
ハンガリー・ フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	248,537,700.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	170,000,000.000	159,378,400.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	373,000,000.000	382,119,850.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	194,598,000.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	332,000,000.000	282,870,640.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	243,000,000.000	232,998,120.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	137,085,280.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	224,000,000.000	211,449,280.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	265,000,000.000	226,135,100.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	236,243,700.000	

	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	93,051,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	130,000,000.000	83,613,400.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	54,106,500.000	
	4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	95,338,000.000	
	4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	235,000,000.000	215,100,200.000	
	9.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021	190,000,000.000	201,014,300.000	
	7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	90,000,000.000	94,626,900.000	
ハンガリー・フォリント 小計			3,148,266,370.000 (1,206,393,636)	
ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	19,350,000.000	18,071,158.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	21,400,000.000	19,067,828.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	11,300,000.000	9,720,147.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	10,400,000.000	8,737,040.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	3,850,000.000	3,177,828.500	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	17,300,000.000	16,127,406.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	28,200,000.000	24,476,754.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	31,500,000.000	25,597,845.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	15,900,000.000	11,351,964.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	7,150,000.000	3,718,500.500	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	9,200,000.000	6,155,076.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280701	1,400,000.000	878,948.000	

ブラジル・リアル 小計			147,080,495.500 (3,699,309,790)	
ペルー・ソル	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,270,000.000	1,331,163.200	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,333,417.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,300,000.000	2,366,631.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,850,000.000	2,617,240.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	2,100,000.000	1,775,571.000	
	7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	3,900,000.000	4,128,033.000	
	7.6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812	1,800,000.000	1,899,342.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	175,000.000	185,473.750	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,466,250.200	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	3,370,000.000	3,551,474.500	
ペルー・ソル 小計			25,654,596.650 (1,024,683,072)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	8,190,000.000	7,893,194.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	6,540,000.000	6,164,865.600	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	9,748,725.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	9,400,000.000	7,538,330.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	5,791,779.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	8,150,000.000	6,380,553.500	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	5,994,282.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	10,166,852.000	

	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	4,350,000.000	4,179,436.500	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	9,900,000.000	10,270,260.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	7,000,000.000	6,884,290.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	3,680,000.000	3,539,497.600	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	600,000.000	595,566.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,481,431.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	5,750,000.000	5,699,802.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		97,328,865.100 (3,583,045,374)	
マレーシア・リ ンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	4,650,000.000	4,707,706.500	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,837,350.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,530,108.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	4,200,000.000	4,290,132.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,221,840.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,041,197.000	
	3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	3,850,000.000	3,848,883.500	
	3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,700,000.000	3,531,206.000	
	4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,450,744.000	
	3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	3,800,000.000	3,823,864.000	
	3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008	1,100,000.000	1,102,387.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	4,850,000.000	4,854,510.500	

3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,876,950.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	2,350,000.000	2,362,713.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,208,221.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,700,000.000	3,736,371.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,864,808.600	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,649,504.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	4,200,000.000	4,463,508.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	4,880,359.500	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,100,000.000	3,126,071.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	4,350,000.000	4,404,897.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,077,635.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	3,000,000.000	3,005,400.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,283,928.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	4,300,000.000	4,252,657.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	5,400,000.000	5,057,748.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	3,100,000.000	3,056,755.000	
4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	3,400,000.000	3,488,332.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	4,100,000.000	4,430,788.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,500,000.000	1,556,295.000	
3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	3,900,000.000	3,906,903.000	

	4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	4,500,000.000	4,622,535.000	
	4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,503,222.000	
	4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,703,212.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,650,000.000	2,772,191.500	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,300,000.000	2,300,851.000	
	4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,900,000.000	5,173,077.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	500,000.000	506,740.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	700,000.000	711,683.000	
	4.119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130	3,800,000.000	3,896,634.000	
	マレーシア・リングット 小計		145,119,918.600 (4,899,988,563)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	65,500,000.000	62,357,965.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	44,700,000.000	35,384,520.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	68,700,000.000	62,931,261.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	54,800,000.000	42,925,936.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	55,400,000.000	47,488,326.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	52,000,000.000	49,642,840.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	47,500,000.000	45,275,100.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	57,530,000.000	54,765,683.500	
	10% Mexican Bonos 20361120	16,890,000.000	16,884,764.100	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	54,730,000.000	52,206,947.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	36,600,000.000	32,039,274.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	67,850,000.000	61,176,952.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	62,620,000.000	49,826,107.800	
7.75% Mexican Bonos 20341123	40,830,000.000	35,132,990.100		
	メキシコ・ペソ 小計		648,038,667.000 (4,770,083,020)	

ルーマニア・レイ	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,742,040.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,417,480.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,442,050.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,371,388.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,260,486.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,413,060.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	2,750,000.000	2,611,015.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,144,825.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,222,478.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,040,514.000	
	4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,092,632.000	
	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	2,909,430.000	
	4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,767,205.000	
	3.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20251125	2,000,000.000	1,947,740.000	
	8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	2,500,000.000	2,638,350.000	
	8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,700,000.000	2,846,772.000	
	8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	2,700,000.000	2,791,071.000	
	7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,600,000.000	2,706,158.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028	1,400,000.000	1,407,602.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	2,700,000.000	2,671,974.000	

	7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	2,500,000.000	2,510,925.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	1,800,000.000	1,810,908.000	
	7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731	1,400,000.000	1,373,302.000	
	6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425	1,500,000.000	1,449,585.000	
	ルーマニア・レイ 小計		54,588,990.000 (1,736,120,944)	
南アフリカ・ランド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	58,650,000.000	61,204,207.500	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	12,980,254.400	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	11,106,541.600	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	35,040,000.000	31,311,043.200	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	78,020,000.000	64,191,735.200	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	58,800,000.000	50,697,360.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	63,000,000.000	60,663,330.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	47,700,000.000	39,450,762.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	59,800,000.000	55,829,878.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	61,700,000.000	56,800,403.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	49,400,000.000	42,789,786.000	
	11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	9,500,000.000	10,155,880.000	
	南アフリカ・ランド 小計		497,181,180.900 (4,116,660,178)	
	国債証券 合計		48,270,386,284 [48,270,386,284]	
	合計		48,270,386,284 [48,270,386,284]	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インド・ルピー	国債証券 30銘柄	100%	5.3%
インドネシア・ルピア	国債証券 34銘柄	100%	10.1%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.2%
オフショア・人民元	国債証券 74銘柄	100%	10.1%
コロンビア・ペソ	国債証券 13銘柄	100%	3.9%
セルビア・ディナール	国債証券 4銘柄	100%	0.3%
タイ・バーツ	国債証券 25銘柄	100%	9.2%
チェコ・コルナ	国債証券 23銘柄	100%	5.4%
チリ・ペソ	国債証券 9銘柄	100%	1.8%
ドミニカ・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.3%
トルコ・リラ	国債証券 11銘柄	100%	1.4%
ハンガリー・フォリント	国債証券 17銘柄	100%	2.5%
ブラジル・レアル	国債証券 12銘柄	100%	7.7%
ペルー・ソル	国債証券 10銘柄	100%	2.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	7.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 41銘柄	100%	10.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.9%
ルーマニア・レイ	国債証券 24銘柄	100%	3.6%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	100%	8.5%

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。

「新興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

	2024年12月2日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	914,932
コール・ローン	2,169,463
投資証券	46,503,155
差入委託証拠金	5,325,996
流動資産合計	54,913,546
資産合計	54,913,546
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	126,315
未払解約金	1,700
流動負債合計	128,015
負債合計	128,015
純資産の部	
元本等	
元本	1 47,934,133
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,851,398
元本等合計	54,785,531
純資産合計	54,785,531
負債純資産合計	54,913,546

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11日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	39,985,483円
期中追加設定元本額	8,143,182円
期中一部解約元本額	194,532円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
スタイル9(8資産分散・保守型)	132,029円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	2,223,084円
スタイル9(8資産分散・積極型)	5,710,453円
新興国株式インデックス資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用)	39,868,567円
計	47,934,133円
2. 期末日における受益権の総数	47,934,133口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月11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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従ってデリバティブ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等を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月2日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
投資証券		3,361,909
合計		3,361,909

（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	2024年12月2日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価	評価損益
			（円）	（円）
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	8,301,157	-	8,191,497	109,660
合計	8,301,157	-	8,191,497	109,660

（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	2024年12月2日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価	評価損益
			（円）	（円）
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
買建	2,058,544	-	2,041,889	16,655
アメリカ・ドル	2,058,544	-	2,041,889	16,655
合計	2,058,544	-	2,041,889	16,655

(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。

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。

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)

	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.1429円
(1万口当たり純資産額)	(11,429円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING	5,700	309,567.000	

	アメリカ・ドル 小計		309,567,000 (46,503,155)	
投資証券	合計		46,503,155 [46,503,155]	
合計			46,503,155 [46,503,155]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	100%

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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載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

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(8資産分散・バランス型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（8資産分散・バランス型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,135,768
親投資信託受益証券		83,365,834
流動資産合計		84,501,602
資産合計		84,501,602
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		6,205
未払委託者報酬		218,997
その他未払費用		2,264
流動負債合計		227,466
負債合計		227,466
純資産の部		
元本等		
元本		1,74,481,202
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,792,934
（分配準備積立金）		1,935,005
元本等合計		84,274,136
純資産合計		84,274,136
負債純資産合計		84,501,602

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	740
有価証券売買等損益	2,267,134
営業収益合計	2,267,874
営業費用	
受託者報酬	7,759
委託者報酬	275,284
その他費用	2,838
営業費用合計	285,881
営業利益又は営業損失（ ）	1,981,993
経常利益又は経常損失（ ）	1,981,993
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,981,993
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（ ）	46,988
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,075,836
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,075,836
剰余金減少額又は欠損金増加額	217,907
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	217,907
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,792,934

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	75,863,991円
期中一部解約元本額	2,382,789円
2. 計算期間末日における受益権の総数	74,481,202口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(654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(1,934,351円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,857,929円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は9,792,934円(1万口当たり1,314.82円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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ぬ。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1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）
親投資信託受益証券	2,217,965
合計	2,217,965

(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1期 2024年12月2日現在
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1期 自2023年12月11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1期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.1315円
(1万口当たり純資産額)	(11,315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	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	1,499,302	2,780,005	
	新興国株式インデックス・マザーファンド	2,223,084	2,540,762	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	8,978,957	17,901,346	
	日本債券インデックスマザーファンド	17,084,008	22,361,258	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,951,492	20,574,850	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,684,869	6,137,809	
	ダイワJ-REITマザーファンド	2,036,590	6,329,518	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,125,932	4,740,286	
親投資信託受益証券 合計			83,365,834	
合計			83,365,834	

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、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「新興国株式インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルR E I T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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「新興国株式インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載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

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(8資産分散・積極型)】

(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1期計算期間(2023年12月11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】

スタイル9（8資産分散・積極型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年12月2日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,884,920
親投資信託受益証券		147,668,402
流動資産合計		149,553,322
資産合計		149,553,322
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		10,878
未払委託者報酬		383,055
その他未払費用		4,002
流動負債合計		397,935
負債合計		397,935
純資産の部		
元本等		
元本		121,638,233
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,517,154
（分配準備積立金）		6,452,348
元本等合計		149,155,387
純資産合計		149,155,387
負債純資産合計		149,553,322

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期
	自 2023年12月11日
	至 2024年12月2日
営業収益	
受取利息	1,408
有価証券売買等損益	7,118,802
営業収益合計	7,120,210
営業費用	
受託者報酬	13,483
委託者報酬	476,075
その他費用	4,965
営業費用合計	494,523
営業利益又は営業損失（ ）	6,625,687
経常利益又は経常損失（ ）	6,625,687
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,625,687
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（ ）	173,339
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,641,184
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,641,184
剰余金減少額又は欠損金増加額	576,378
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	576,378
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,517,154

(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1期 自2023年12月11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	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2023年12月11日から2024年12月2日までとなっております。 (2)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358日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期 2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	124,547,432円
期中一部解約元本額	3,909,199円
2. 計算期間末日における受益権の総数	121,638,233口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
----	------------------------------------

1 分配金の計算過程	<p>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(1,309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(6,451,039円)、投資信託約款に規定される収益調整金(21,064,806円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は27,517,154円(1万口当たり2,262.21円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自2023年12月11日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1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	<p>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ぬ。</p>

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1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）
親投資信託受益証券	7,066,644
合計	7,066,644

(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1期 2024年12月2日現在
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1期 自2023年12月11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1期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.2262円
(1万口当たり純資産額)	(12,262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	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	1,801,503	3,340,346	
	新興国株式インデックス・マザーファンド	5,710,453	6,526,476	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	27,048,309	53,926,213	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,408,991	4,462,028	
	外国株式インデックスマザーファンド	9,224,499	64,303,982	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,889,635	6,883,751	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,088,616	3,383,309	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,150,162	4,842,297	
親投資信託受益証券 合計			147,668,402	
合計			147,668,402	

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、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「新興国株式インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルR E I T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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「新興国株式インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載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

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

2【ファンドの現況】

スタイル9（4資産分散・保守型）

【純資産額計算書】

2024年12月30日

資産総額	13,387,274円
負債総額	7,850円
純資産総額（ - ）	13,379,424円
発行済数量	12,310,399口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0868円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	431,783,605,199円
負債総額	14,239,153,946円
純資産総額（ - ）	417,544,451,253円
発行済数量	203,873,244,351口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0481円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	127,422,852,267円
負債総額	202,257,530円
純資産総額（ - ）	127,220,594,737円
発行済数量	97,130,194,657口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3098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

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

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	337,607,885,211円
負債総額	45,678,812円
純資産総額(-)	337,562,206,399円
発行済数量	89,726,141,857口
1単位当たり純資産額(/)	3.7621円

スタイル9(4資産分散・バランス型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	57,940,435円
負債総額	33,454円
純資産総額(-)	57,906,981円
発行済数量	49,273,168口
1単位当たり純資産額(/)	1.1752円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

スタイル9(4資産分散・積極型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	57,609,449円
負債総額	32,972円
純資産総額(-)	57,576,477円
発行済数量	45,706,858口
1単位当たり純資産額(/)	1.2597円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

スタイル9(6資産分散・保守型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	6,033,917円
負債総額	3,577円
純資産総額(-)	6,030,340円
発行済数量	5,614,541口
1単位当たり純資産額(/)	1.0741円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	266,271,638,575円
負債総額	847,027,900円
純資産総額(-)	265,424,610,675円
発行済数量	85,086,675,514口
1単位当たり純資産額(/)	3.1195円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

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

スタイル9(6資産分散・バランス型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	113,906,537円
負債総額	66,367円
純資産総額(-)	113,840,170円
発行済数量	98,441,079口
1単位当たり純資産額(/)	1.1564円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ - R E I Tマザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

スタイル9（6資産分散・積極型）

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	82,991,473円
負債総額	48,274円
純資産総額（ - ）	82,943,199円
発行済数量	65,902,554口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2586円

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

スタイル9(8資産分散・保守型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	9,395,939円
負債総額	5,609円
純資産総額(-)	9,390,330円
発行済数量	8,733,799口
1単位当たり純資産額(/)	1.0752円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ - R E I Tマザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考）新興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

資産総額	58,030,664円
負債総額	141,589円
純資産総額（ - ）	57,889,075円
発行済数量	48,594,434口

1 単位当たり純資産額 (/) 1.1913円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	51,951,373,006円
負債総額	192,381,856円
純資産総額 (-)	51,758,991,150円
発行済数量	26,822,126,026口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.9297円

スタイル9 (8資産分散・バランス型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	93,133,836円
負債総額	54,240円
純資産総額 (-)	93,079,596円
発行済数量	80,764,969口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.1525円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9 (4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9 (4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9 (4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 新興国株式インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」の記載と同じ。

スタイル9(8資産分散・積極型)

純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	166,329,638円
負債総額	97,245円
純資産総額(-)	166,232,393円
発行済数量	131,707,800口
1単位当たり純資産額(/)	1.2621円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) 新興国株式インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

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

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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、）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

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

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。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
----	--------

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	10,316百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,955円
基準日	2023年3月31日
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。

剰余金の配当の総額	11,858百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,546円
基準日	2024年3月31日
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係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

市場リスクの管理

（ ）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。

（ ）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。

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いません。

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いません。

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	(株)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	(株)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(株)	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)	13,072	未払手数料	2,663
							不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)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(株)	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	(株)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）
資金の用途	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		
ソフトウェア		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

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

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

純資産合計	37,257
-------	--------

負債・純資産合計

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

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
	其他有価 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）其他有価証券

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いましたが、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いません。

(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)

(株式会社かんぼ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、株式会社かんぼ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
資金の用途	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。

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。）。

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。）。

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。

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。

上記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、株式会社かんぼ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、かんぼ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】

	名 称	資本金の額 (2024年03月末日現在)	事業の内容	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)	
	株式会社SBI証券	54,323百万円	(注1)	
	木村証券株式会社	500百万円	(注1)	
	静岡東海証券株式会社	600百万円	(注1)	

(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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【参考情報】

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

(提出年月日)

2024年9月3日

(書類名)

半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

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」に掲げられているスタイル9（4資産分散・保守型）の2023年12月11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、スタイル9（4資産分散・保守型）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を検討すること、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」に掲げられているスタイル9（4資産分散・バランス型）の2023年12月11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、スタイル9（4資産分散・バランス型）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

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」に掲げられているスタイル9（4資産分散・積極型）の2023年12月11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、スタイル9（4資産分散・積極型）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を検討すること、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」に掲げられているスタイル9（6資産分散・保守型）の2023年12月11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、スタイル9（6資産分散・保守型）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を検討すること、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」に掲げられているスタイル9（6資産分散・バランス型）の2023年12月11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、スタイル9（6資産分散・バランス型）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

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」に掲げられているスタイル9（6資産分散・積極型）の2023年12月11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、スタイル9（6資産分散・積極型）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を検討すること、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」に掲げられているスタイル9（8資産分散・保守型）の2023年12月11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、スタイル9（8資産分散・保守型）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を検討すること、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」に掲げられているスタイル9（8資産分散・バランス型）の2023年12月11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、スタイル9（8資産分散・バランス型）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

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」に掲げられているスタイル9（8資産分散・積極型）の2023年12月11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、スタイル9（8資産分散・積極型）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を検討すること、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ぼ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。