

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2025年9月11日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 佐野 径
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	佐竹 優子 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券に係るファンドの名称】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040
【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2025年9月12日から2026年3月11日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信		目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産		目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合		目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合 分固定型	資産配	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 分変更型	資産配	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
	T O P I X	目論見書等において、T O P I Xに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

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

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

- ◆2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

〈2025年6月時点の基本配分比率〉

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	29%	16%	6%	6%	24%	19%

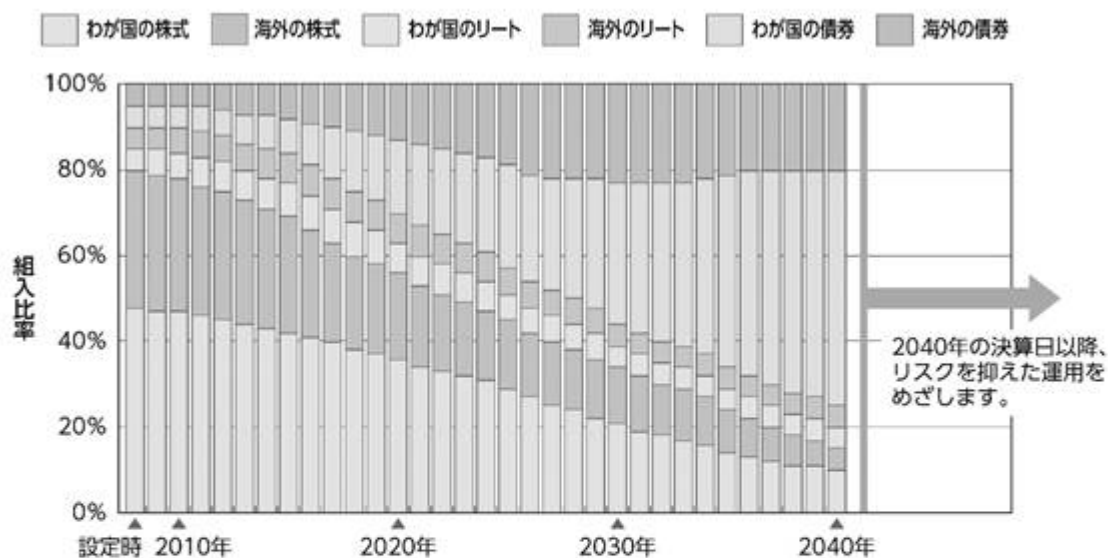
〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	48%	32%	5%	5%	5%	5%

※上記基本配分比率における「わが国の債券」の比率には、「わが国の短期債券および短期金融資産」の比率を含みます。

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2025年6月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2024年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。
- (注4) 投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

2

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

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

- (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
- (b) ポートフォリオは、東証株価指数（配当込み）における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。
- (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス



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

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

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

3

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

運用プロセス



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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

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

4

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

運用プロセス



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

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

東証REIT指数とは

東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。

5

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

運用プロセス



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

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

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

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

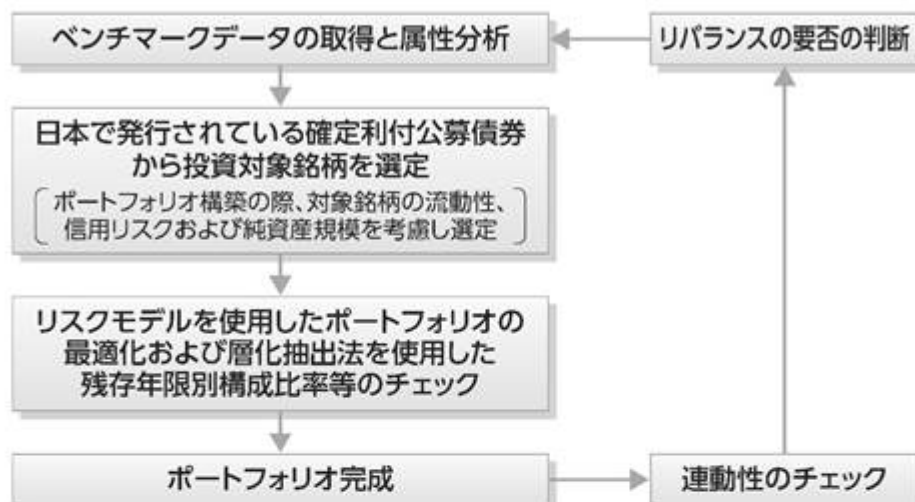
S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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。

6

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

運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

NOMURA－BPI総合指数とは

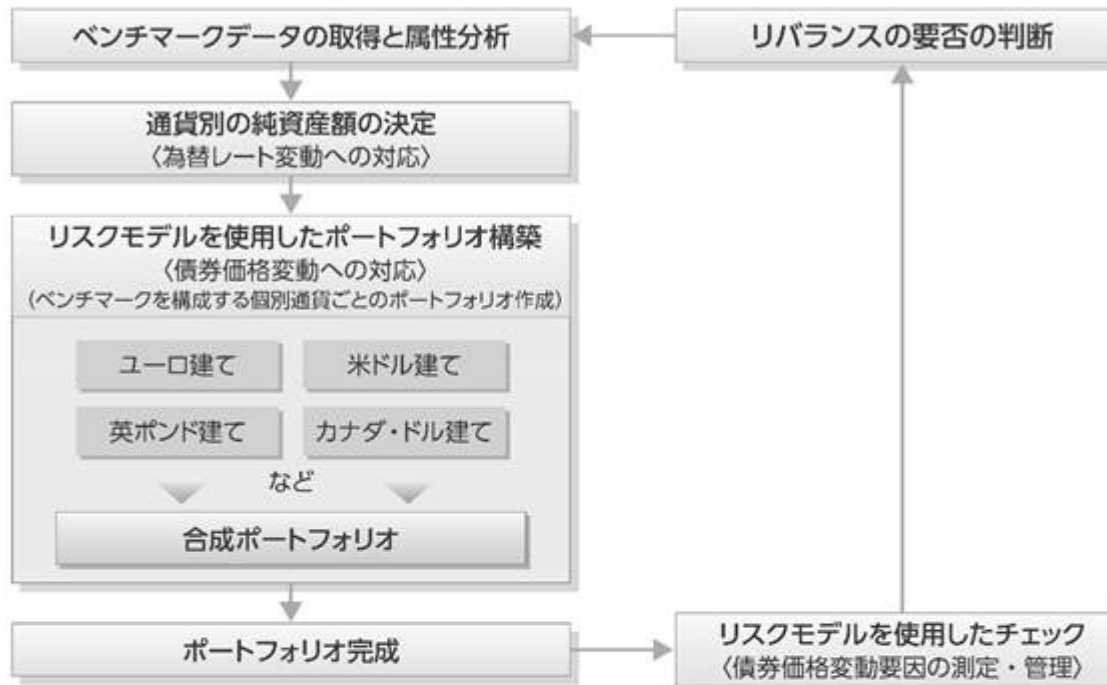
NOMURA－BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

7

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

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応

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

②債券価格変動への対応

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

③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

8

2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

NOMURA-BPI総合短期指数とは

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

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

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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

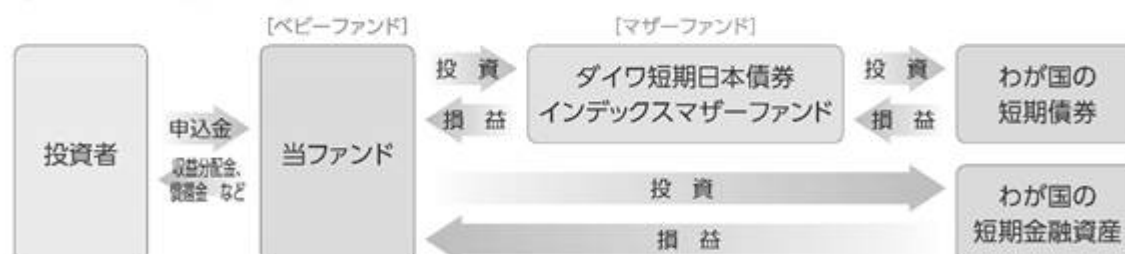
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

〈2040年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈2040年の決算日から〉



・為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～8.の運用が行なわれないことがあります。

9

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

10

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

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への直接投資は、行ないません。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2008年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。 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 など
↑ ↓ 1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（ 3）	

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
↓ 運用指図 ↑ ↓ 2		損益 ↑ ↓ 信託金(3)
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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。 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 など
		損益 ↑ ↓ 投資
投資対象	内外の株式・債券・リート（REIT）および短期金融資産 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2025年6月末日現在）>

・資本金の額 414億2,454万1,896円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。

（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

2024年10月 1日 株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株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

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券
4. 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
5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券
6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

投資態度

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

ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

当初設定時の基本配分比率

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

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の32%

ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券

.....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

.....信託財産の純資産総額の 5%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の 5%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．2040年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 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. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

4. 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。）

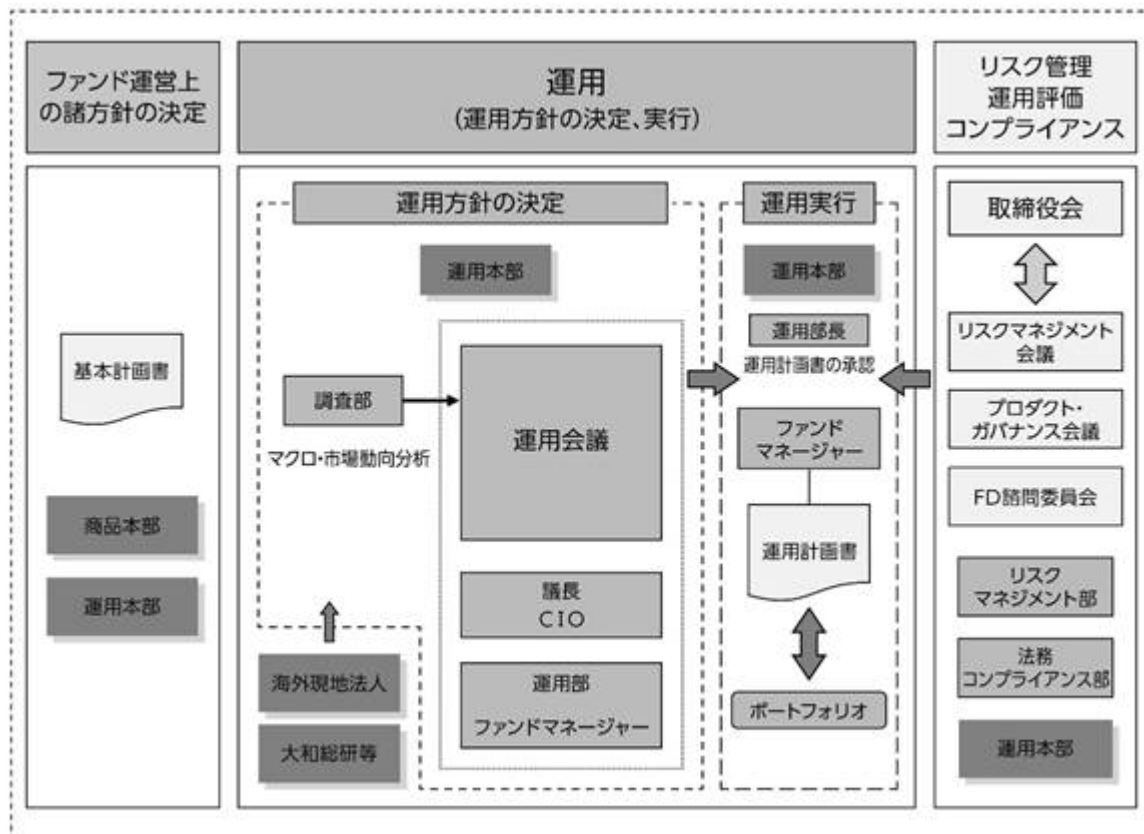
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【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。



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2025年6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】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行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】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

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）

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

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

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

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

(2) 投資対象

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。

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

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せん。

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します。）
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します。）

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。

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

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るものとします。

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

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。

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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)、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

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

1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得な

いことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券

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. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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します。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

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

6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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)、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

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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。

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は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

7．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

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す。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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します。

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

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）

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。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当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

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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、お買付けの申込みの受付けを中止することがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

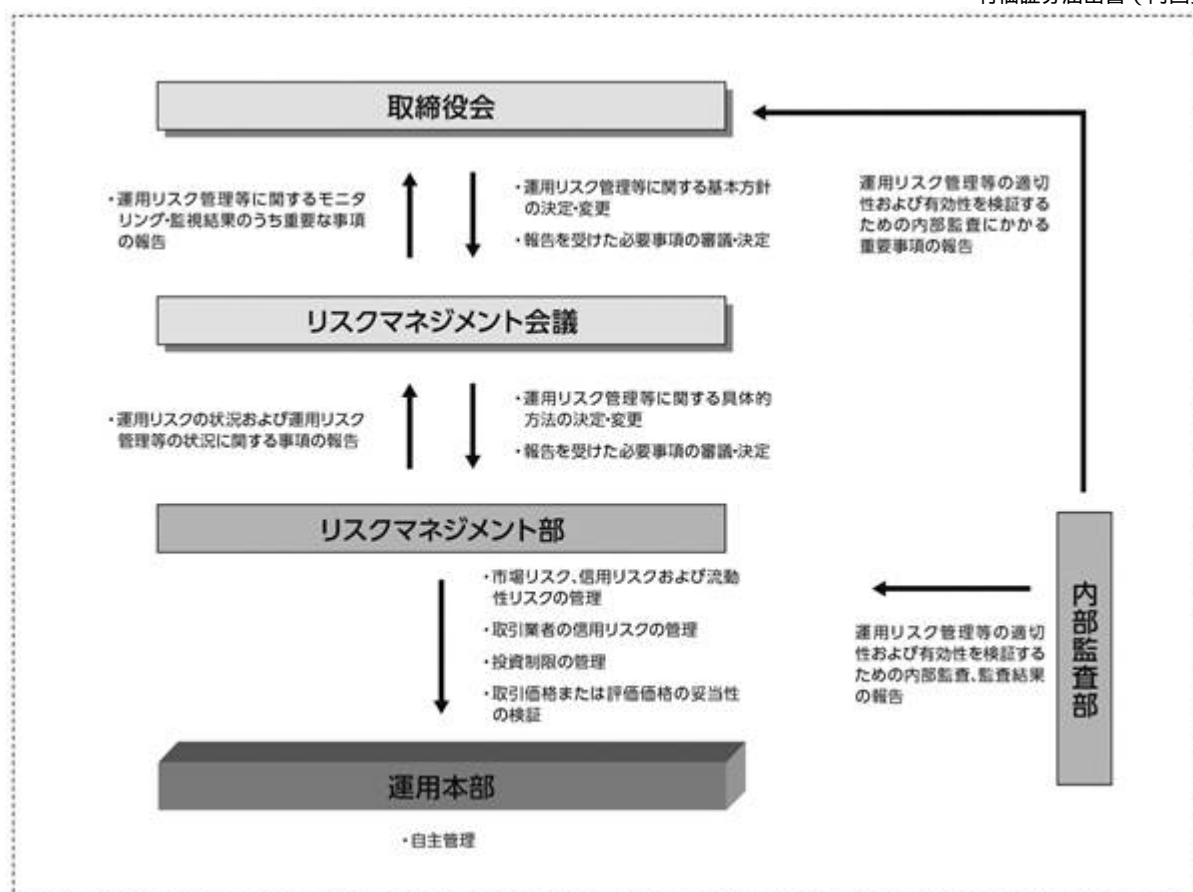
流動性リスクに関する事項

- ・ 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ある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（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



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：配当込みTOPIX

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット 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 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諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016. J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

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

	信託報酬率
第1計算期間から2016年3月11日まで	年率0.715%（税抜0.65%）
2016年3月12日から第18計算期間まで	年率0.396%（税抜0.36%）
第19計算期間から第28計算期間まで	年率0.374%（税抜0.34%）
第29計算期間から第33計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第34計算期間以降	年率0.242%（税抜0.22%）

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。

< 第1計算期間から2016年3月11日まで >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.300% （税抜）	年率0.300% （税抜）	年率0.05% （税抜）

< 2016年3月12日から第18計算期間まで >

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

< 第19計算期間から第28計算期間まで >

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

< 第29計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択す

ることもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

<注1> 個別元本について

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、2025年6月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- （ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2025年6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	529,589,123	99.81
内 日本	529,589,123	99.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,024,941	0.19
純資産総額	530,614,064	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】（2025年6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	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	72,817,075	1.9975 145,458,732	2.1263 154,830,946	29.18
2	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	119,390,456	1.0362 123,712,650	1.0383 123,963,110	23.36
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	27,155,348	3.6847 100,061,413	3.6958 100,360,735	18.91
4	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,248,695	7.0858 86,791,809	7.1264 87,289,100	16.45
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,246,522	3.0442 28,148,264	3.4401 31,808,960	5.99
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	8,117,995	4.0766 33,094,553	3.8601 31,336,272	5.91

(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
親投資信託受益証券	99.81%
合計	99.81%

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

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)
第8計算期間末 (2015年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
第9計算期間末 (2016年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
第10計算期間末 (2017年12月18日)	37,746,883	37,746,883	1.5802	1.5802
第11計算期間末 (2018年12月18日)	45,018,917	45,018,917	1.4875	1.4875
第12計算期間末 (2019年12月18日)	77,674,021	77,674,021	1.6805	1.6805
第13計算期間末 (2020年12月18日)	119,539,263	119,539,263	1.7292	1.7292
第14計算期間末 (2021年12月20日)	238,841,582	238,841,582	1.9765	1.9765
第15計算期間末 (2022年12月19日)	290,922,352	290,922,352	1.9868	1.9868
第16計算期間末 (2023年12月18日)	403,759,259	403,759,259	2.2551	2.2551
2024年6月末日	478,227,687	-	2.5722	-

7月末日	477,375,654	-	2.5308	-
8月末日	465,082,624	-	2.4973	-
9月末日	464,712,123	-	2.4913	-
10月末日	490,324,047	-	2.5579	-
11月末日	485,348,986	-	2.5433	-
第17計算期間末 (2024年12月18日)	492,476,996	492,476,996	2.5612	2.5612
12月末日	499,723,536	-	2.5979	-
2025年1月末日	505,896,798	-	2.5936	-
2月末日	490,337,992	-	2.5304	-
3月末日	494,425,026	-	2.5152	-
4月末日	492,897,239	-	2.4883	-
5月末日	516,996,836	-	2.5634	-
6月末日	530,614,064	-	2.6148	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
2024年12月19日 ~ 2025年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第8計算期間	6.5
第9計算期間	2.3
第10計算期間	11.7
第11計算期間	5.9
第12計算期間	13.0
第13計算期間	2.9
第14計算期間	14.3

第15計算期間	0.5
第16計算期間	13.5
第17計算期間	13.6
2024年12月19日～ 2025年6月18日	1.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第8計算期間	6,366,392	910,747
第9計算期間	5,468,224	1,102,640
第10計算期間	7,259,647	3,856,478
第11計算期間	9,247,574	2,870,316
第12計算期間	21,843,305	5,886,469
第13計算期間	45,072,340	22,164,723
第14計算期間	70,739,694	19,025,186
第15計算期間	57,094,084	31,512,786
第16計算期間	49,299,001	16,683,120
第17計算期間	42,361,589	29,118,666
2024年12月19日～ 2025年6月18日	19,784,104	9,205,850

(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 (2025年6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		442,981,603,220	98.36
	内 日本	442,981,603,220	98.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,386,504,116	1.64
純資産総額		450,368,107,336	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)		7,367,190,000	1.64
	内 日本	7,367,190,000	1.64

(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（2025年6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	5,830,600	2,620.61 15,279,754,091	2,493.00 14,535,685,800	3.23
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,783,600	2,733.17 10,341,232,809	3,730.00 14,112,828,000	3.13
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,929,500	1,503.21 10,416,496,490	1,983.00 13,741,198,500	3.05
4	日立	日本	株式	電気機器	2,818,000	3,706.09 10,443,762,496	4,205.00 11,849,690,000	2.63
5	任天堂	日本	株式	その他製品	692,500	8,012.37 5,548,572,532	13,880.00 9,611,900,000	2.13
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,230,500	3,061.82 6,829,405,326	3,634.00 8,105,637,000	1.80
7	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	833,900	9,258.49 7,720,662,839	8,535.00 7,117,336,500	1.58
8	三菱重工業	日本	株式	機械	1,937,200	1,947.20 3,772,124,188	3,610.00 6,993,292,000	1.55
9	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	232,100	23,080.74 5,357,041,533	27,680.00 6,424,528,000	1.43
10	キーエンス	日本	株式	電気機器	109,700	66,717.05 7,318,860,475	57,840.00 6,345,048,000	1.41
11	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,031,200	5,255.75 5,419,738,512	6,111.00 6,301,663,200	1.40
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,144,800	2,854.91 6,123,230,987	2,888.00 6,194,182,400	1.38
13	伊藤忠	日本	株式	卸売業	780,100	7,610.65 5,937,072,859	7,556.00 5,894,435,600	1.31
14	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,443,500	2,958.71 4,270,907,914	3,993.00 5,763,895,500	1.28
15	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	542,600	8,427.55 4,572,791,609	10,515.00 5,705,439,000	1.27

16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	32,721,100	150.18 4,914,176,583	154.00 5,039,049,400	1.12
17	三井物産	日本	株式	卸売業	1,668,300	2,942.92 4,909,689,320	2,947.00 4,916,480,100	1.09
18	信越化学	日本	株式	化学	977,000	5,652.93 5,522,913,909	4,772.00 4,662,244,000	1.04
19	武田薬品	日本	株式	医薬品	978,800	4,264.67 4,174,268,538	4,425.00 4,331,190,000	0.96
20	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	17,646,100	198.34 3,500,092,876	223.00 3,935,080,300	0.87
21	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	78,300	46,647.31 3,652,485,026	49,520.00 3,877,416,000	0.86
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,545,900	2,412.24 3,729,092,267	2,480.00 3,833,832,000	0.85
23	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	345,700	6,632.73 2,292,935,704	10,655.00 3,683,433,500	0.82
24	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,598,800	1,526.81 3,967,880,043	1,394.50 3,624,026,600	0.80
25	HOYA	日本	株式	精密機器	211,100	19,169.14 4,046,605,982	17,155.00 3,621,420,500	0.80
26	富士通	日本	株式	電気機器	1,019,400	2,928.12 2,984,929,665	3,515.00 3,583,191,000	0.80
27	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,126,800	2,298.02 2,589,412,769	3,111.00 3,505,474,800	0.78
28	第一三共	日本	株式	医薬品	1,010,100	4,840.33 4,889,224,552	3,365.00 3,398,986,500	0.75
29	日本電気	日本	株式	電気機器	783,400	2,730.32 2,138,938,218	4,219.00 3,305,164,600	0.73
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,281,900	2,184.40 2,800,193,048	2,323.00 2,977,853,700	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
株式	98.36%
合計	98.36%

(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	0.25%
建設業	2.24%
食料品	2.98%
繊維製品	0.39%
パルプ・紙	0.14%
化学	4.72%
医薬品	3.89%
石油・石炭製品	0.42%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	0.61%
鉄鋼	0.73%
非鉄金属	0.91%
金属製品	0.48%
機械	6.04%
電気機器	17.60%
輸送用機器	6.60%
精密機器	1.97%
その他製品	3.37%
電気・ガス業	1.20%
陸運業	2.37%
海運業	0.60%
空運業	0.35%
倉庫・運輸関連業	0.16%
情報・通信業	8.08%
卸売業	6.74%
小売業	4.80%
銀行業	8.66%
証券、商品先物取引業	0.89%
保険業	3.23%
その他金融業	1.09%
不動産業	1.84%
サービス業	4.38%
合計	98.36%

(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 0709月	買建	258	7,195,641,900	7,367,190,000	1.64%

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年6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		679,834,914,235	95.35
	内 香港	3,658,481,765	0.51
	内 シンガポール	3,110,697,911	0.44
	内 イスラエル	1,855,275,953	0.26
	内 ノルウェー	1,200,903,062	0.17
	内 スウェーデン	7,030,981,713	0.99
	内 デンマーク	4,408,121,288	0.62
	内 イギリス	26,373,391,458	3.70
	内 アイルランド	837,053,178	0.12
	内 オランダ	8,561,764,771	1.20
	内 ベルギー	1,851,208,771	0.26
	内 フランス	19,775,805,880	2.77
	内 ドイツ	18,788,965,259	2.64
	内 スイス	16,552,843,357	2.32
	内 ポルトガル	305,306,898	0.04
	内 スペイン	5,989,177,088	0.84
	内 イタリア	5,637,116,717	0.79
	内 フィンランド	1,912,794,782	0.27
	内 オーストリア	372,588,224	0.05

	内 カナダ	21,782,811,883	3.06
	内 アメリカ	518,587,127,414	72.73
	内 オーストラリア	10,880,836,501	1.53
	内 ニュージーランド	361,660,362	0.05
投資証券		12,258,289,063	1.72
	内 香港	199,845,897	0.03
	内 シンガポール	181,212,515	0.03
	内 イギリス	172,588,998	0.02
	内 フランス	270,070,287	0.04
	内 アメリカ	10,449,345,901	1.47
	内 オーストラリア	985,225,465	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,915,328,020	2.93
純資産総額		713,008,531,318	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）		20,804,566,484	2.92
	内 イギリス	1,207,231,894	0.17
	内 ドイツ	4,320,645,756	0.61
	内 カナダ	2,218,779,763	0.31
	内 アメリカ	12,031,837,521	1.69
	内 オーストラリア	1,026,071,550	0.14
為替予約取引（買建）		4,853,368,810	0.68
	内 日本	4,853,368,810	0.68

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年6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	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,655,100	19,958.58 33,033,477,526	22,843.77 37,808,736,140	5.30

2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	478,600	61,309.51 29,342,798,024	71,817.07 34,371,650,372	4.82
3	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,018,800	34,272.90 34,917,256,946	29,118.39 29,665,820,622	4.16
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	647,400	30,112.37 19,494,765,753	32,336.07 20,934,373,660	2.94
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	148,500	83,806.61 12,445,295,050	106,236.96 15,776,188,605	2.21
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	302,720	23,919.13 7,240,817,655	39,004.57 11,807,464,490	1.66
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	395,300	24,478.39 9,676,365,663	25,852.92 10,219,662,952	1.43
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	196,250	49,721.09 9,757,777,121	46,864.86 9,197,228,834	1.29
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	335,240	24,698.64 8,280,009,114	25,815.27 8,654,314,031	1.21
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	189,470	36,233.77 6,865,216,110	41,576.39 7,877,480,337	1.10
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	90,850	70,178.54 6,375,722,049	70,331.32 6,389,600,495	0.90
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	54,685	115,537.38 6,318,167,713	112,292.91 6,140,738,029	0.86
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	116,850	46,163.83 5,394,255,042	50,482.21 5,898,846,718	0.83
14	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	28,990	129,707.04 3,760,210,588	191,601.00 5,554,513,199	0.78
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	293,009	17,052.82 4,996,646,118	15,839.31 4,641,062,669	0.65
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	55,200	77,431.06 4,274,195,886	79,691.83 4,398,989,524	0.62

17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	30,160	141,303.13 4,261,704,257	142,658.12 4,302,569,002	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	298,800	13,437.49 4,015,162,799	14,085.66 4,208,797,808	0.59
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	158,867	25,912.01 4,116,566,207	23,149.32 3,677,664,069	0.52
20	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	163,300	22,491.16 3,672,808,065	22,070.49 3,604,111,360	0.51
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	67,350	61,825.32 4,163,944,141	53,397.23 3,596,304,074	0.50
22	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	114,033	26,598.12 3,033,066,407	30,444.85 3,471,718,082	0.49
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	490,401	6,842.12 3,355,404,458	6,823.44 3,346,225,330	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	119,872	26,616.36 3,190,564,983	26,400.31 3,164,658,092	0.44
25	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	69,258	38,503.31 2,666,667,254	43,772.28 3,031,580,568	0.43
26	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	26,150	111,756.22 2,922,429,108	115,792.95 3,027,985,643	0.42
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	277,050	9,332.13 2,585,505,946	10,184.48 2,821,612,206	0.40
28	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,066	87,179.24 5,410,873,466	44,762.21 2,778,211,891	0.39
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	105,500	19,509.52 2,058,264,755	26,214.95 2,765,677,679	0.39
30	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	アメリカ	株式	情報技術	145,300	10,218.51 1,484,771,395	18,932.45 2,750,886,351	0.39

(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
株式	95.35%
投資証券	1.72%
合計	97.07%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
----	------

エネルギー	3.52%
素材	3.07%
資本財・サービス	10.34%
一般消費財・サービス	9.54%
生活必需品	5.82%
ヘルスケア	9.38%
金融	16.48%
情報技術	26.06%
コミュニケーション・サービス	8.22%
公益事業	2.63%
不動産	0.29%
合計	95.35%

(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 SEP 25	買建	267	11,781,697,172	12,031,837,521	1.69%
	イギリス	FTSE 100 INDEX SEP 25	買建	69	1,212,539,353	1,207,231,894	0.17%
	オーストラリア	SPI 200 SEP 25	買建	51	1,027,298,113	1,026,071,550	0.14%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX SEP 25	買建	66	2,209,718,642	2,218,779,763	0.31%
	ドイツ	SWISS MKT IX SEP 25	買建	66	1,438,360,535	1,431,637,951	0.20%
		EURO STOXX 50 SEP 25	買建	319	2,867,323,815	2,889,007,805	0.41%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2025年7月	買建	11,300,000	1,180,523,840	1,193,717,310	0.17%
		ユーロ買/円売 2025年7 月	買建	3,600,000	588,903,480	610,540,920	0.09%
		米ドル買/円売 2025年7 月	買建	10,000,000	1,429,872,680	1,446,887,000	0.20%
		豪ドル買/円売 2025年7 月	買建	5,200,000	480,765,800	491,072,400	0.07%

		英ポンド買/円売 2025年7月	買建	1,400,000	270,110,120	277,758,600	0.04%
		スイス・フラン買/円売 2025年7月	買建	4,600,000	805,228,570	833,392,580	0.12%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資状況（2025年6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		241,860,351,400	96.12
	内 日本	241,860,351,400	96.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,771,881,107	3.88
純資産総額		251,632,232,507	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)		9,853,200,000	3.92
	内 日本	9,853,200,000	3.92

(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（2025年6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	137,247	126,466.29 17,357,119,749	132,900.00 18,240,126,300	7.25
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	120,848	106,094.61 12,821,322,267	117,900.00 14,247,979,200	5.66
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	122,011	93,052.25 11,353,398,658	102,000.00 12,445,122,000	4.95
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	74,980	140,548.12 10,538,298,780	147,200.00 11,037,056,000	4.39
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	65,182	146,862.56 9,572,795,683	156,100.00 10,174,910,200	4.04
6	GLP投資法人	日本	投資証券	77,422	122,739.38 9,502,728,893	129,700.00 10,041,633,400	3.99
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	121,127	78,444.37 9,501,732,116	79,600.00 9,641,709,200	3.83
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	46,883	175,473.80 8,226,738,482	187,800.00 8,804,627,400	3.50
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	35,090	235,067.73 8,248,526,766	243,500.00 8,544,415,000	3.40
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	52,023	143,704.64 7,475,946,587	155,100.00 8,068,767,300	3.21
11	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	129,641	62,589.97 8,114,226,325	62,000.00 8,037,742,000	3.19
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	46,250	145,034.97 6,707,867,798	149,600.00 6,919,000,000	2.75
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	86,443	71,522.59 6,182,627,661	76,100.00 6,578,312,300	2.61
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	64,367	84,932.92 5,466,877,390	92,600.00 5,960,384,200	2.37
15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	51,290	102,407.14 5,252,462,448	104,500.00 5,359,805,000	2.13
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	70,285	77,406.34 5,440,505,116	75,900.00 5,334,631,500	2.12
17	産業ファンド	日本	投資証券	43,082	115,829.06 4,990,147,696	121,500.00 5,234,463,000	2.08
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	40,623	114,417.77 4,647,993,225	117,700.00 4,781,327,100	1.90
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	46,920	93,206.35 4,373,241,989	93,500.00 4,387,020,000	1.74
20	API投資法人	日本	投資証券	34,311	111,738.60 3,833,863,127	122,700.00 4,209,959,700	1.67

21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	29,219	137,706.12 4,023,635,222	139,100.00 4,064,362,900	1.62
22	森ヒルズリート	日本	投資証券	27,669	133,696.17 3,699,239,351	133,800.00 3,702,112,200	1.47
23	イオンリート投資	日本	投資証券	28,572	123,428.17 3,526,589,757	126,800.00 3,622,929,600	1.44
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	43,651	78,334.97 3,419,399,913	82,100.00 3,583,747,100	1.42
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	11,914	276,047.75 3,288,832,978	286,700.00 3,415,743,800	1.36
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	34,752	91,024.79 3,163,293,692	95,600.00 3,322,291,200	1.32
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	20,792	141,788.01 2,948,056,357	156,000.00 3,243,552,000	1.29
28	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	45,354	61,644.32 2,795,816,808	69,000.00 3,129,426,000	1.24
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	15,776	166,701.54 2,629,883,506	194,800.00 3,073,164,800	1.22
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	9,613	285,050.33 2,740,188,881	319,500.00 3,071,353,500	1.22

(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	96.12%
合計	96.12%

(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	日本	TREIT 先物 0709月	買建	5,600	9,676,744,000	9,853,200,000	3.92%
-------------	----	----------------	----	-------	---------------	---------------	-------

(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（2025年6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		1,121,245,729	2.32
	内 アメリカ	1,121,245,729	2.32
投資証券		45,884,484,471	94.82
	内 ガーンジー	75,627,507	0.16
	内 韓国	84,573,381	0.17
	内 香港	492,062,826	1.02
	内 シンガポール	1,565,210,994	3.23
	内 イスラエル	83,016,344	0.17
	内 イギリス	2,169,254,427	4.48
	内 アイルランド	17,318,221	0.04
	内 オランダ	72,077,320	0.15
	内 ベルギー	439,395,476	0.91
	内 フランス	860,037,143	1.78
	内 ドイツ	13,557,191	0.03
	内 スペイン	207,573,315	0.43
	内 イタリア	4,978,864	0.01
	内 カナダ	615,307,756	1.27
	内 アメリカ	35,404,364,678	73.17
	内 オーストラリア	3,739,987,817	7.73
	内 ニュージーランド	40,141,211	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,383,732,923	2.86
純資産総額		48,389,463,123	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)	1,368,629,935	2.83
内 ドイツ	408,609,144	0.84
内 アメリカ	960,020,791	1.98
為替予約取引(買建)	354,065,271	0.73
内 日本	354,065,271	0.73

(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（2025年6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	199,988	16,794.62 3,358,737,708	15,294.83 3,058,782,902	6.32
2	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	133,893	20,022.87 2,680,929,480	22,029.94 2,949,655,466	6.10
3	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	21,082	140,600.80 2,964,148,692	113,691.77 2,396,850,087	4.95
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	68,230	27,901.84 1,903,752,186	24,814.64 1,693,102,996	3.50
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	194,633	8,331.78 1,621,653,984	8,258.51 1,607,379,414	3.32
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	66,128	26,360.63 1,743,182,731	23,242.00 1,536,947,307	3.18
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	461,599	3,528.44 1,628,757,663	3,222.45 1,487,479,698	3.07
8	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	34,028	49,702.26 1,691,268,775	41,977.52 1,428,411,146	2.95
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	87,500	12,890.11 1,127,889,771	12,814.23 1,121,245,729	2.32
10	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	227,743	4,688.07 1,067,682,688	4,674.46 1,064,577,092	2.20
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	45,736	24,435.23 1,117,572,386	21,121.98 966,035,179	2.00
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	63,588	17,600.78 1,119,202,635	14,814.06 941,996,638	1.95

13	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	30,645	33,773.60 1,034,993,839	29,596.26 906,977,627	1.87
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	97,264	9,244.23 899,144,823	9,105.65 885,652,214	1.83
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	73,697	11,009.32 811,358,066	9,752.95 718,763,414	1.49
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	122,856	4,939.03 606,794,764	4,738.18 582,114,235	1.20
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	13,876	44,600.17 618,873,334	41,330.22 573,498,162	1.19
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	25,228	23,647.76 596,587,608	21,410.15 540,135,479	1.12
19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	25,859	18,271.54 472,484,120	18,338.73 474,221,436	0.98
20	LINK REIT	香港	投資証券	586,874	628.21 368,684,474	783.70 459,933,154	0.95
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	145,485	3,656.45 531,962,062	3,030.87 440,946,602	0.91
22	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	47,194	8,271.69 390,376,038	9,104.20 429,663,837	0.89
23	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	297,274	1,537.05 456,945,872	1,364.10 405,513,604	0.84
24	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,183,720	347.00 410,809,778	339.25 401,582,929	0.83
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	59,232	7,417.45 439,358,927	6,716.28 397,819,159	0.82
26	UDR INC	アメリカ	投資証券	64,975	6,590.73 428,241,885	5,895.21 383,041,601	0.79
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	23,025	18,072.28 416,117,704	16,473.58 379,304,308	0.78
28	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	149,740	3,153.38 472,193,349	2,513.90 376,431,626	0.78
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	41,205	10,232.27 421,621,609	8,900.02 366,725,431	0.76
30	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	35,211	10,905.64 383,999,299	10,214.89 359,676,752	0.74

(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
-----------	------

投資信託受益証券	2.32%
投資証券	94.82%
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。

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	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE SEP 25	買建	184	968,189,581	960,020,791	1.98%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE SEP 25	買建	360	399,745,563	408,609,144	0.84%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年7月	買建	1,240,000	177,382,000	179,392,412	0.37%
		ユーロ買/円売 2025年7月	買建	1,030,000	167,960,452	174,672,859	0.36%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年6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		551,751,990	98.88
	内 日本	551,751,990	98.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,261,745	1.12
純資産総額		558,013,735	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（2025年6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	155 5年国債	日本	国債証券	65,000,000	98.94 64,317,400	98.88 64,274,600	0.300000 2027/12/20	11.52
2	152 5年国債	日本	国債証券	62,000,000	98.96 61,358,480	99.01 61,389,300	0.100000 2027/03/20	11.00
3	153 5年国債	日本	国債証券	61,000,000	98.58 60,136,960	98.61 60,152,710	0.005000 2027/06/20	10.78
4	150 5年国債	日本	国債証券	57,000,000	98.91 56,379,180	99.07 56,472,180	0.005000 2026/12/20	10.12
5	100 20年国債	日本	国債証券	54,000,000	104.03 56,179,440	103.83 56,070,360	2.200000 2028/03/20	10.05
6	470 2年国債	日本	国債証券	52,000,000	100.02 52,012,880	100.18 52,094,120	0.800000 2027/03/01	9.34
7	149 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	99.03 49,516,140	99.27 49,636,000	0.005000 2026/09/20	8.90
8	161 5年国債	日本	国債証券	49,000,000	98.45 48,244,420	98.57 48,303,220	0.300000 2028/06/20	8.66
9	154 5年国債	日本	国債証券	40,000,000	98.69 39,479,600	98.60 39,440,000	0.100000 2027/09/20	7.07
10	463 2年国債	日本	国債証券	25,000,000	99.60 24,902,320	99.80 24,950,000	0.400000 2026/08/01	4.47
11	101 20年国債	日本	国債証券	10,000,000	104.81 10,481,600	104.38 10,438,000	2.400000 2028/03/20	1.87
12	98 20年国債	日本	国債証券	8,000,000	104.16 8,332,880	103.00 8,240,480	2.100000 2027/09/20	1.48
13	469 2年国債	日本	国債証券	7,000,000	99.82 6,988,030	100.03 7,002,170	0.700000 2027/02/01	1.25
14	97 20年国債	日本	国債証券	5,000,000	104.43 5,221,600	103.22 5,161,250	2.200000 2027/09/20	0.92
15	99 20年国債	日本	国債証券	4,000,000	103.60 4,144,080	103.28 4,131,480	2.100000 2027/12/20	0.74
16	468 2年国債	日本	国債証券	4,000,000	99.77 3,990,800	99.90 3,996,120	0.600000 2027/01/01	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.88%
合計	98.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年6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		336,460,118,447	97.53
	内 ユーロ	103,779,106,184	30.08
	内 中国	37,772,818,883	10.95
	内 シンガポール	1,331,895,374	0.39
	内 マレーシア	1,713,296,009	0.50
	内 イスラエル	1,116,858,996	0.32
	内 ノルウェー	517,844,124	0.15
	内 スウェーデン	560,353,004	0.16
	内 デンマーク	672,718,942	0.19
	内 イギリス	19,286,986,880	5.59
	内 ポーランド	2,148,199,950	0.62
	内 カナダ	6,282,361,662	1.82
	内 アメリカ	153,848,708,222	44.59
	内 メキシコ	2,484,568,392	0.72
	内 オーストラリア	4,038,306,048	1.17

	内 ニュージーランド	906,095,777	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,532,567,163	2.47
純資産総額		344,992,685,610	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	2,962,580,974	0.86
内 日本	2,962,580,974	0.86

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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（2025年6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 1,733,363,096	100.84 1,731,028,670	1.850000 2027/05/15	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	96.37 1,604,991,911	97.68 1,626,696,345	2.875000 2028/05/15	0.47
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	97.76 1,557,276,603	98.16 1,563,664,172	3.875000 2033/08/15	0.45
4	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,499,355,428	102.06 1,504,529,737	2.050000 2029/04/15	0.44
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,481,637,996	102.38 1,482,622,704	4.500000 2033/11/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,481,884,173	97.28 1,479,192,879	3.875000 2034/08/15	0.43
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	98.12 1,449,433,141	98.61 1,456,604,691	4.000000 2034/02/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,301,939,646	86.30 1,337,251,999	1.125000 2031/02/15	0.39
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	98.28 1,280,978,578	99.94 1,302,573,190	4.250000 2034/11/15	0.38
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,600,000	102.84 1,280,812,933	102.78 1,280,099,257	4.625000 2035/02/15	0.37

11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,241,679,716	85.33 1,272,778,388	1.250000 2031/08/15	0.37
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,248,897,191	91.97 1,265,309,233	2.750000 2032/08/15	0.37
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,247,895,830	101.19 1,245,594,075	4.375000 2034/05/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	99.16 1,220,640,393	100.80 1,240,781,315	4.000000 2029/01/31	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,207,889,172	85.34 1,235,851,983	1.375000 2031/11/15	0.36
16	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,234,128,038	101.37 1,228,275,817	2.390000 2026/11/15	0.36
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,180,481,562	85.55 1,214,129,324	0.875000 2030/11/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,197,055,211	100.81 1,211,658,576	4.000000 2029/07/31	0.35
19	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,204,667,819	103.12 1,207,841,912	2.370000 2029/01/15	0.35
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,104,935,054	96.12 1,113,565,730	3.500000 2033/02/15	0.32
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.85 1,084,451,584	100.82 1,095,002,536	4.000000 2030/02/28	0.32
22	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,050,077,903	105.11 1,061,366,349	2.540000 2030/12/25	0.31
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	100.19 1,015,625,060	100.77 1,021,566,489	4.000000 2030/03/31	0.30
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	85.94 995,678,805	87.99 1,019,369,721	1.625000 2031/05/15	0.30
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.50 1,008,663,953	100.22 1,015,920,347	4.000000 2027/01/15	0.29
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,004,019,861	100.00 1,013,670,000	3.750000 2027/08/15	0.29
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,900,000	85.84 982,070,295	87.61 1,002,268,963	1.875000 2032/02/15	0.29
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	82.41 954,703,368	85.10 985,947,573	0.625000 2030/08/15	0.29
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	94.40 956,924,753	96.41 977,299,520	1.125000 2026/10/31	0.28
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.98 1,054,054,612	96.28 975,971,612	4.625000 2054/05/15	0.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.53%
合計	97.53%

(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	豪ドル買/円売 2025年7月	買建	288,000	27,275,328	27,213,408	0.01%
		イスラエル・シェケル買/円売 2025年7月	買建	1,097,000	44,810,036	46,822,702	0.01%
		オフショア人民元買/円売 2025年7月	買建	41,135,000	824,273,198	830,464,895	0.24%
		シンガポール・ドル買/円売 2025年7月	買建	267,000	29,822,378	30,295,341	0.01%
		英ポンド買/円売 2025年7月	買建	613,000	121,515,801	121,696,833	0.04%
		米ドル買/円売 2025年7月	買建	6,731,000	972,703,541	974,599,663	0.28%
		ユーロ買/円売 2025年7月	買建	3,836,000	648,475,800	650,780,085	0.19%
		カナダ・ドル買/円売 2025年7月	買建	2,484,000	260,703,816	262,420,218	0.08%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2025年7月	買建	1,198,000	17,962,692	18,287,829	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2040

2025年6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	26,148円
純資産総額	5.3億円

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	0.7%
1年間	1.7%
3年間	32.9%
5年間	67.3%
設定来	161.5%



※上記の「基準価額の騰落率」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6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期
	13年12月	14年12月	15年12月	16年12月	17年12月	18年12月	19年12月	20年12月	21年12月	22年12月	23年12月	24年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,677	29.2%	日本円	58.7%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.9%
国内債券	16	23.1%	米ドル	25.7%	最終利回り(%)	ソニーグループ	日本	0.9%
外国債券	1,048	18.4%	ユーロ	7.6%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
外国株式・先物	1,099	16.2%	オフショア人民元	2.1%	残存年数	NVIDIA CORP	アメリカ	0.9%
外国リート・先物	293	6.0%	英ポンド	2.0%	債券格付別構成	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.8%
国内リート・先物	58	6.0%	カナダ・ドル	1.0%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.4%
外国投資信託等	5	0.1%	豪ドル	1.0%	AA	PROLOGIS INC	アメリカ	0.4%
			スイス・フラン	0.4%	A	WELLTOWER INC	アメリカ	0.4%
			シンガポール・ドル	0.3%	BBB	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
コール・ローン、その他	2.3%		その他	1.1%	BB	EQUINIX INC	アメリカ	0.3%
合計	4,196	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.3%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

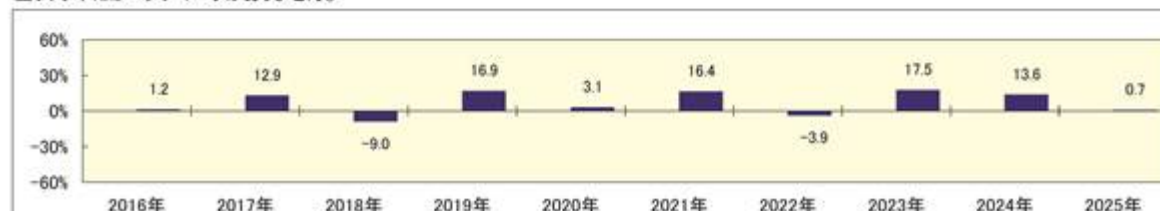
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2025年は6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
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	0.41%	0.40%	0.02%

※対象期間は2023年12月19日～2024年12月18日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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。

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、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

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

2【換金（解約）手続等】

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。

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ

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

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

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

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年2月28日から2008年12月18日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第34計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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）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。

< 収益分配金にかかる請求権 >

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

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

< 償還金にかかる請求権 >

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

< 換金請求権 >

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2023年12月19日から2024年12月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,546,875	1,918,941
親投資信託受益証券	402,967,811	491,515,683
未収入金	11,000	553,000
流動資産合計	404,525,686	493,987,624
資産合計	404,525,686	493,987,624
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12	547,589
未払受託者報酬	62,526	78,585
未払委託者報酬	688,339	864,892
その他未払費用	15,550	19,562
流動負債合計	766,427	1,510,628
負債合計	766,427	1,510,628
純資産の部		
元本等		
元本	1 179,040,743	1 192,283,666
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	224,718,516	300,193,330
（分配準備積立金）	61,364,723	103,596,738
元本等合計	403,759,259	492,476,996
純資産合計	403,759,259	492,476,996
負債純資産合計	404,525,686	493,987,624

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期 自 2022年12月20日 至 2023年12月18日	第17期 自 2023年12月19日 至 2024年12月18日
営業収益		
受取利息	-	1,727
有価証券売買等損益	44,771,379	57,886,872
営業収益合計	44,771,379	57,888,599
営業費用		
支払利息	203	-
受託者報酬	113,692	152,404
委託者報酬	1,251,534	1,677,451
その他費用	28,262	37,945
営業費用合計	1,393,691	1,867,800
営業利益又は営業損失（ ）	43,377,688	56,020,799
経常利益又は経常損失（ ）	43,377,688	56,020,799
当期純利益又は当期純損失（ ）	43,377,688	56,020,799
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（ ）	2,223,223	4,873,571
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	144,497,490	224,718,516
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,730,731	61,302,969
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,730,731	61,302,969
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,664,170	36,975,383
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,664,170	36,975,383
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	224,718,516	300,193,330

(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17期
	自2023年12月19日 至2024年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第16期	第17期
	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首元本額	146,424,862円	179,040,743円
期中追加設定元本額	49,299,001円	42,361,589円
期中一部解約元本額	16,683,120円	29,118,666円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	179,040,743口	192,283,666口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第16期	第17期
	自2022年12月20日 至2023年12月18日	自2023年12月19日 至2024年12月18日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額（0 円）、解約に伴う当期純利益金 額分配後の有価証券売買等損益 から費用を控除し、繰越欠損金 を補填した額（41,154,530 円）、投資信託約款に規定され る収益調整金（163,688,075円） 及び分配準備積立金 （20,210,193円）より分配対象 額は225,052,798円（1万口当 たり12,569.92円）であり、分配を 行っておりません。	計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 （1,700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 （51,145,349円）、投資信託約 款に規定される収益調整金 （196,596,592円）及び分配準備 積立金（52,449,689円）より分 配対象額は300,193,330円（1万 口当たり15,612.00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17期
	自2023年12月19日 至2024年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第17期
	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	42,261,450	51,450,567
合計	42,261,450	51,450,567

（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16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第17期 自2023年12月19日 至2024年12月18日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第16期 2023年12月18日現在	第17期 2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2551円 (22,551円)	2.5612円 (25,612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	76,595,831	153,015,491	

外国株式インデックスマザーファンド	11,192,828	79,992,903	
外国債券インデックスマザーファンド	22,755,567	84,177,393	
ダイワJ - R E I Tマザーファンド	10,974,561	33,368,152	
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	8,113,100	33,274,257	
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	103,885,286	107,687,487	
親投資信託受益証券 合計		491,515,683	
合計		491,515,683	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月18日現在 金 額（円）	2024年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,509,355,185	18,115,112,162
株式	271,694,881,710	400,098,341,150

派生商品評価勘定	-	317,850
未収入金	-	606,500
未収配当金	34,216,517	40,745,686
未収利息	354,362	-
前払金	40,870,000	20,385,000
その他未収収益	4 3,809,987	7,066,226
差入委託証拠金	83,656,486	-
流動資産合計	284,367,144,247	418,282,574,574
資産合計	284,367,144,247	418,282,574,574
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	88,366,150	34,588,400
未払解約金	45,582,510	143,616,770
未払利息	-	1,160,023
受入担保金	6,027,500,124	12,735,844,660
流動負債合計	6,161,448,784	12,915,209,853
負債合計	6,161,448,784	12,915,209,853
純資産の部		
元本等		
元本	1 167,363,042,675	202,918,715,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	110,842,652,788	202,448,649,644
元本等合計	278,205,695,463	405,367,364,721
純資産合計	278,205,695,463	405,367,364,721
負債純資産合計	284,367,144,247	418,282,574,574

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19日 至2024年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首	2022年12月20日	2023年12月19日
期首元本額	148,213,575,565円	167,363,042,675円
期中追加設定元本額	33,709,870,987円	54,208,209,542円
期中一部解約元本額	14,560,403,877円	18,652,537,140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	2,806,589,377円	2,749,376,688円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,338,435,108円	3,722,637,732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	911,033円	904,647円
ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募)	15,019,052円	8,959,470円
ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募)	186,897,779円	127,893,647円
ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募)	13,126,071円	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)	405,732,331円	302,620,796円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	335,745,401円	1,171,311,234円
日本株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	683,176,927円	862,207,445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）	-円	963,731,047円
D - I ' s T O P I X インデックス	13,681,132円	11,679,154円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	252,698,013円	246,515,707円
i F r e e T O P I X インデックス	7,316,732,442円	9,959,603,282円
i F r e e 8資産バランス	4,616,250,454円	5,200,333,681円
i F r e e 年金バランス	1,010,425,277円	1,228,550,661円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	606,201円	4,364,951円
D Cダイワ日本株式インデックス	70,764,909,047円	72,963,753,872円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,117,247,592円	2,973,734,629円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,949,158,053円	5,197,844,995円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,667,590,984円	6,247,921,235円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,353,575,651円	10,598,144,797円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	55,620,720円	48,865,163円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	76,255,756円	76,595,831円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,843,673,479円	6,604,969,865円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,445,814円	12,474,384円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,685,906円	14,025,228円
ダイワつみたてインデックスバランス70	29,772,487円	83,687,341円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	11,959,611,664円	24,141,805,204円

ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	54,371,807円	47,149,049円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	21,015,894円	19,954,146円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	3,760,384,417円	2,951,993,147円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	350,930,093円	278,988,473円
ダイワ国内バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	51,746,439円	39,319,630円
ダイワ国内バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家専用）	73,719,521円	53,700,842円
ダイワ・ノーロード T O P I X ファンド	239,106,880円	234,374,933円
ダイワファンドラップ T O P I X インデックス	12,349,270,983円	15,707,598,819円
ダイワ T O P I X インデックス （ダイワ S M A 専用）	6,002,426,419円	14,902,340,770円
ダイワファンドラップオンライ ン T O P I X インデックス	3,346,831,688円	3,541,584,334円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	86,587円	886,764円
スタイル9（4資産分散・ balan ス型）	145,111円	6,283,264円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	202,435円	9,095,535円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	74,055円	367,913円
スタイル9（6資産分散・ balan ス型）	128,381円	11,597,753円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	203,035円	13,270,370円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	74,654円	577,437円
スタイル9（8資産分散・ balan ス型）	126,582円	9,307,452円
スタイル9（8資産分散・積極 型）	213,768円	28,207,165円
ダイワ国内株式インデックス （投資一任専用）	-円	4,999,558円
ダイワ・インデックスセレクト T O P I X	1,153,362,208円	976,015,710円

	ダイワライフスタイル 2 5	107,605,154円	92,382,825円
	ダイワライフスタイル 5 0	481,894,635円	431,876,444円
	ダイワライフスタイル 7 5	403,714,677円	379,440,247円
	D C ・ダイワ ・トピックス ・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,127,833,501円	7,641,606,691円
計		167,363,042,675円	202,918,715,077円
2.	期末日における受益権の総数	167,363,042,675口	202,918,715,077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 5,729,754,780円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 12,125,038,290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 617,720,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,018,970,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年12月19日 至2024年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	12,681,916,678	13,825,653,988
合計	12,681,916,678	13,825,653,988

（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	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	6,859,435,000	-	6,771,230,000	88,205,000	5,510,405,000	-	5,476,245,000	34,160,000
合計	6,859,435,000	-	6,771,230,000	88,205,000	5,510,405,000	-	5,476,245,000	34,160,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.6623円	1.9977円
（1万口当たり純資産額）	（16,623円）	（19,977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	6,000	3,950.00	23,700,000	
ニッスイ	144,200	881.90	127,169,980	
マルハニチロ	21,400	2,912.00	62,316,800	
雪国まいたけ	12,300	1,016.00	12,496,800	
カネコ種苗	4,000	1,420.00	5,680,000	
サカタのタネ	16,100	3,445.00	55,464,500	
ホクト	12,800	1,806.00	23,116,800	貸付株式数 3,200株

ホクリヨウ	300	1,128.00	338,400	貸付株式数	200株
ショーボンドHD	19,000	5,265.00	100,035,000		
ミライト・ワン	47,200	2,254.00	106,388,800	貸付株式数	9,600株
タマホーム	9,000	3,435.00	30,915,000	貸付株式数	3,500株
サンヨーホームズ	200	716.00	143,200	貸付株式数	100株 (100株)
日本アクア	800	776.00	620,800		
ファーストコーポレーション	500	835.00	417,500	貸付株式数	400株
ベステラ	400	1,018.00	407,200	貸付株式数	300株 (300株)
キャンディル	700	571.00	399,700	貸付株式数	100株
住石ホールディングス	15,800	793.00	12,529,400	貸付株式数	7,500株
日鉄鉱業	5,800	4,185.00	24,273,000		
三井松島HLDGS	7,000	3,270.00	22,890,000	貸付株式数	2,700株
I N P E X	435,700	1,940.00	845,258,000		
石油資源開発	79,000	1,083.00	85,557,000		
K&Oエナジーグループ	6,500	3,070.00	19,955,000	貸付株式数	2,500株
リョーサン菱洋HD	18,400	2,255.00	41,492,000		
ダイセキ環境ソリューション	400	1,285.00	514,000	貸付株式数	300株
第一カッター興業	4,100	1,435.00	5,883,500		
明豊ファシリティワークス	700	870.00	609,000		
安藤・間	83,600	1,172.00	97,979,200		
東急建設	45,000	699.00	31,455,000	貸付株式数	11,300株
コムシスホールディングス	51,100	3,218.00	164,439,800		
ビーアールホールディングス	22,500	334.00	7,515,000		
高松コンストラクションGP	10,700	2,668.00	28,547,600	貸付株式数	2,600株
東建コーポレーション	3,600	12,040.00	43,344,000		
ソネック	200	833.00	166,600	貸付株式数	100株
ヤマウラ	7,200	1,184.00	8,524,800	貸付株式数	2,300株
オリエンタル白石	53,100	388.00	20,602,800		
大成建設	91,500	6,590.00	602,985,000		
大 林 組	332,800	2,049.00	681,907,200		
清水建設	285,900	1,205.50	344,652,450		
長谷工コーポレーション	92,500	2,000.00	185,000,000	貸付株式数	4,000株
松井建設	9,300	882.00	8,202,600	貸付株式数	3,600株
銭 高 組	100	3,725.00	372,500		
鹿島建設	223,600	2,745.00	613,782,000		

不動テトラ	6,400	2,020.00	12,928,000	
大末建設	500	1,553.00	776,500	
鉄建建設	6,600	2,213.00	14,605,800	
西松建設	16,000	5,136.00	82,176,000	
三井住友建設	81,300	412.00	33,495,600	
大豊建設	2,800	3,315.00	9,282,000	
佐田建設	700	976.00	683,200	
ナカノフドー建設	900	796.00	716,400	
奥村組	17,800	3,805.00	67,729,000	貸付株式数 7,000株
東鉄工業	11,200	3,175.00	35,560,000	
イチケン	300	2,539.00	761,700	
富士ピー・エス	800	398.00	318,400	貸付株式数 400株
浅沼組	40,200	620.00	24,924,000	
戸田建設	124,000	920.90	114,191,600	貸付株式数 14,400株
熊谷組	16,600	3,975.00	65,985,000	
北野建設	200	4,095.00	819,000	
植木組	400	1,537.00	614,800	
矢作建設	13,700	1,542.00	21,125,400	貸付株式数 5,300株
ピーエス・コンストラクション	7,600	1,093.00	8,306,800	
日本ハウスHLDGS	21,300	325.00	6,922,500	貸付株式数 8,400株
大東建託	34,400	17,595.00	605,268,000	
新日本建設	14,100	1,466.00	20,670,600	
東亜道路	17,500	1,279.00	22,382,500	貸付株式数 5,200株
日本道路	10,300	1,755.00	18,076,500	
東亜建設	30,500	1,182.00	36,051,000	
日本国土開発	28,600	512.00	14,643,200	
若築建設	3,000	3,810.00	11,430,000	
東洋建設	29,100	1,280.00	37,248,000	
五洋建設	132,100	619.10	81,783,110	
世紀東急	14,600	1,486.00	21,695,600	貸付株式数 5,600株
福田組	3,800	5,240.00	19,912,000	貸付株式数 1,400株
日本ドライケミカル	300	4,155.00	1,246,500	貸付株式数 100株
住友林業	87,100	5,610.00	488,631,000	
日本基礎技術	800	584.00	467,200	
巴コーポレーション	1,300	925.00	1,202,500	
大和ハウス	304,200	4,748.00	1,444,341,600	
ライト工業	20,600	2,201.00	45,340,600	貸付株式数 7,400株
積水ハウス	305,900	3,627.00	1,109,499,300	
日特建設	10,000	978.00	9,780,000	

北陸電気工事	7,100	1,111.00	7,888,100	
ユアテック	19,600	1,421.00	27,851,600	貸付株式数 7,300株
日本リーテック	8,000	1,123.00	8,984,000	貸付株式数 2,900株
四電工	12,800	1,536.00	19,660,800	
中電工	15,800	3,290.00	51,982,000	
関 電 工	55,300	2,260.50	125,005,650	
きんでん	70,200	3,109.00	218,251,800	
東京エネシス	10,700	1,041.00	11,138,700	
トーエネック	16,900	927.00	15,666,300	
住友電設	8,300	4,795.00	39,798,500	
日本電設工業	19,100	2,011.00	38,410,100	
エクシオグループ	106,900	1,700.00	181,730,000	貸付株式数 31,500株
新日本空調	6,500	3,925.00	25,512,500	
九電工	21,800	5,071.00	110,547,800	
三機工業	21,100	3,150.00	66,465,000	
日揮ホールディングス	99,800	1,271.00	126,845,800	
中外炉工業	3,300	3,490.00	11,517,000	
ヤマト	1,100	1,204.00	1,324,400	貸付株式数 400株
太平電業	6,400	5,020.00	32,128,000	貸付株式数 700株
高砂熱学	24,300	6,172.00	149,979,600	
三晃金属	200	4,265.00	853,000	
NECネットエスアイ	37,900	3,330.00	126,207,000	
朝日工業社	9,500	2,101.00	19,959,500	
明星工業	17,500	1,380.00	24,150,000	
大 気 社	13,000	4,615.00	59,995,000	
ダイダン	13,300	3,900.00	51,870,000	
日比谷総合設備	8,300	3,805.00	31,581,500	貸付株式数 3,200株
ニッポン	33,400	2,127.00	71,041,800	貸付株式数 12,000株
日清製粉 G 本社	105,400	1,844.00	194,357,600	
日東富士製粉	1,800	6,530.00	11,754,000	
昭和産業	8,600	2,778.00	23,890,800	
鳥越製粉	1,000	800.00	800,000	貸付株式数 300株
中部飼料	14,000	1,290.00	18,060,000	
フィード・ワン	14,700	776.00	11,407,200	
東洋精糖	200	1,458.00	291,600	
日本甜菜糖	5,300	2,366.00	12,539,800	貸付株式数 2,100株
DM三井製糖ホールディ	10,000	3,425.00	34,250,000	
塩水港精糖	1,500	315.00	472,500	貸付株式数 200株
ウェルネオシュガー	6,100	2,143.00	13,072,300	
L I F U L L	25,900	196.00	5,076,400	

M I X I	19,900	3,185.00	63,381,500	
ジェイエイシーリクルートメント	38,200	720.00	27,504,000	
日本M&Aセンターホールディングス	155,500	641.80	99,799,900	
メンバーズ	4,100	1,050.00	4,305,000	
中広	200	438.00	87,600	
U T グループ	13,800	2,146.00	29,614,800	貸付株式数 5,400株
アイティメディア	5,700	1,540.00	8,778,000	貸付株式数 100株
ケアネット	21,600	573.00	12,376,800	貸付株式数 8,400株
E・Jホールディングス	6,200	1,675.00	10,385,000	
オープンアップグループ	31,800	1,750.00	55,650,000	
コシダカホールディングス	32,000	1,157.00	37,024,000	貸付株式数 12,200株
アルトナー	500	1,957.00	978,500	貸付株式数 300株
パソナグループ	12,800	1,993.00	25,510,400	貸付株式数 2,200株
C D S	400	1,826.00	730,400	
リンクアンドモチベーション	26,100	571.00	14,903,100	貸付株式数 9,800株
エス・エム・エス	40,400	1,555.50	62,842,200	
サニーサイドアップG	400	552.00	220,800	
パーソルホールディングス	986,300	236.30	233,062,690	
リニカル	800	327.00	261,600	
クックパッド	28,800	151.00	4,348,800	貸付株式数 10,900株
エスクリ	500	190.00	95,000	貸付株式数 200株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホールディング	800	730.00	584,000	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	42,300	2,769.00	117,128,700	
中 村 屋	2,500	3,180.00	7,950,000	
江崎グリコ	29,000	4,750.00	137,750,000	
名糖産業	4,500	1,942.00	8,739,000	貸付株式数 1,400株
井村屋グループ	5,500	2,467.00	13,568,500	
不 二 家	7,000	2,696.00	18,872,000	貸付株式数 2,700株
山崎製パン	67,700	2,950.50	199,748,850	
第一屋製パン	300	561.00	168,300	
モロゾフ	3,300	4,775.00	15,757,500	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	6,400	4,035.00	25,824,000	貸付株式数 2,500株
寿スピリッツ	59,900	2,088.00	125,071,200	貸付株式数 5,800株
カルビー	46,400	3,210.00	148,944,000	貸付株式数 3,000株
森永乳業	38,900	2,916.50	113,451,850	
六甲バター	7,400	1,338.00	9,901,200	貸付株式数 2,800株

ヤクルト	144,700	3,075.00	444,952,500	貸付株式数	1,400株
明治ホールディングス	135,400	3,178.00	430,301,200		
雪印メグミルク	27,200	2,729.00	74,228,800		
プリマハム	13,600	2,206.00	30,001,600		
日本ハム	43,600	5,064.00	220,790,400		
林兼産業	400	459.00	183,600	貸付株式数	300株
丸大食品	10,200	1,676.00	17,095,200	貸付株式数	3,700株
S F o o d s	11,200	2,702.00	30,262,400	貸付株式数	4,300株
柿安本店	4,000	2,827.00	11,308,000	貸付株式数	1,500株
伊藤ハム米久HLDGS	15,500	3,900.00	60,450,000	貸付株式数	2,700株
学情	5,400	2,268.00	12,247,200		
スタジオアリス	5,300	2,104.00	11,151,200	貸付株式数	1,300株 (300株)
クロスキャット	5,900	1,032.00	6,088,800	貸付株式数	1,600株
エプコ	300	787.00	236,100		
システナ	147,400	363.00	53,506,200		
N J S	2,600	3,680.00	9,568,000	貸付株式数	1,000株
デジタルアーツ	6,500	5,980.00	38,870,000	貸付株式数	2,500株
日鉄ソリューションズ	35,200	4,154.00	146,220,800	貸付株式数	13,600株
総合警備保障	176,600	1,106.50	195,407,900	貸付株式数	68,300株
キューブシステム	5,400	1,063.00	5,740,200	貸付株式数	1,600株
いちご	85,600	358.00	30,644,800		
日本駐車場開発	120,500	206.00	24,823,000		
コア	4,600	1,840.00	8,464,000		
カカクコム	76,200	2,393.00	182,346,600	貸付株式数	29,500株
アイロムグループ	4,300	2,588.00	11,128,400		
セントケア・ホールディング	6,700	724.00	4,850,800	貸付株式数	2,000株
グ					
サイネックス	200	756.00	151,200	貸付株式数	100株
ルネサンス	8,200	1,002.00	8,216,400	貸付株式数	3,200株
ディップ	18,500	2,462.00	45,547,000	貸付株式数	7,200株
SBSホールディングス	9,200	2,359.00	21,702,800		
デジタルホールディングス	5,400	1,267.00	6,841,800		
新日本科学	11,200	1,556.00	17,427,200	貸付株式数	4,400株
キャリアデザインセンター	200	1,861.00	372,200		
エムスリー	208,900	1,391.00	290,579,900	貸付株式数	80,800株
ツカダ・グローバルHOLD	900	431.00	387,900	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	812.00	812,000		

ワールドホールディングス	4,200	1,997.00	8,387,400	貸付株式数	1,600株
ディー・エヌ・エー	42,300	2,684.50	113,554,350		
博報堂 D Y HLDGS	119,800	1,214.00	145,437,200	貸付株式数	49,700株
ぐるなび	19,700	280.00	5,516,000	貸付株式数	7,400株
タカミヤ	14,200	408.00	5,793,600		
ファンコミュニケーションズ	14,900	415.00	6,183,500		
ライク	4,000	1,362.00	5,448,000	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	33,400	303.00	10,120,200	貸付株式数	13,000株
WDBホールディングス	5,400	1,676.00	9,050,400	貸付株式数	1,800株
手間いらず	1,700	3,460.00	5,882,000	貸付株式数	600株
ティア	800	428.00	342,400	貸付株式数	300株
アドウェイズ	12,900	297.00	3,831,300		
バリューコマース	9,300	1,164.00	10,825,200		
インフォマート	99,700	289.00	28,813,300	貸付株式数	1,800株
サッポロホールディングス	33,300	8,618.00	286,979,400		
アサヒグループホールディングン	760,300	1,646.00	1,251,453,800		
麒麟 H D	421,800	2,074.50	875,024,100		
シマダヤ	2,900	1,402.00	4,065,800		
宝ホールディングス	68,400	1,336.50	91,416,600	貸付株式数	9,300株
オエノンホールディングス	32,800	397.00	13,021,600	貸付株式数	12,700株
養 命 酒	3,400	2,495.00	8,483,000		
飛島ホールディングス	10,500	1,576.00	16,548,000		
コカ・コーラボトラーズ JHD	71,400	2,447.50	174,751,500		
サントリー食品インター	71,300	5,076.00	361,918,800		
ダイドーグループ HD	11,500	3,380.00	38,870,000	貸付株式数	3,800株
伊 藤 園	33,900	3,569.00	120,989,100		
キーコーヒー	11,400	2,036.00	23,210,400	貸付株式数	4,200株
ユニカフェ	400	950.00	380,000	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	14,300	5,120.00	73,216,000		
不二製油グループ	20,200	3,614.00	73,002,800	貸付株式数	5,300株
かどや製油	100	3,590.00	359,000		
J - オイルミルズ	11,600	2,124.00	24,638,400	貸付株式数	2,600株
サンエー	18,300	2,804.00	51,313,200	貸付株式数	2,600株
カワチ薬品	8,300	2,512.00	20,849,600		
エービーシー・マート	47,600	3,267.00	155,509,200		

ハードオフコーポレーション	4,300	1,803.00	7,752,900	
高千穂交易	4,300	3,805.00	16,361,500	貸付株式数 1,600株
アスクル	25,800	1,723.00	44,453,400	
ゲオホールディングス	12,200	1,582.00	19,300,400	貸付株式数 4,800株
アダストリア	15,000	3,620.00	54,300,000	
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	2,000.00	400,000	
伊藤忠食品	2,400	6,920.00	16,608,000	貸付株式数 500株
くら寿司	12,700	3,035.00	38,544,500	貸付株式数 5,000株
キャンドウ	3,800	3,460.00	13,148,000	貸付株式数 1,400株
IKホールディングス	400	404.00	161,600	貸付株式数 300株
バルグループHLDGS	24,900	3,230.00	80,427,000	
エディオン	47,400	1,770.00	83,898,000	
あらた	16,600	3,050.00	50,630,000	貸付株式数 2,900株
サーラコーポレーション	22,600	850.00	19,210,000	
ワッツ	500	679.00	339,500	貸付株式数 400株
トーメンデバイス	1,600	6,370.00	10,192,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,300	3,925.00	16,877,500	
JPホールディングス	27,000	649.00	17,523,000	貸付株式数 1,700株
フジオフードG本社	12,200	1,183.00	14,432,600	貸付株式数 4,800株 (300株)
あみやき亭	7,900	1,624.00	12,829,600	貸付株式数 3,000株
東京エレクトロンデバイス	10,800	2,856.00	30,844,800	貸付株式数 4,200株
ひらまつ	2,700	171.00	461,700	貸付株式数 1,000株
円谷フィールズホールディ	17,600	1,707.00	30,043,200	貸付株式数 6,100株
双日	121,100	3,032.00	367,175,200	
アルフレッサホールディングス	101,400	2,149.50	217,959,300	
大黒天物産	3,300	9,810.00	32,373,000	貸付株式数 1,200株
ハニーズホールディングス	9,700	1,620.00	15,714,000	貸付株式数 3,300株
ファーマライズHD	300	576.00	172,800	貸付株式数 100株
キッコーマン	335,500	1,713.00	574,711,500	貸付株式数 14,500株
味の素	234,500	6,435.00	1,509,007,500	貸付株式数 32,600株
ブルドックソ - ス	5,400	1,864.00	10,065,600	
キューピー	54,400	3,418.00	185,939,200	
ハウス食品G本社	34,100	2,866.50	97,747,650	
カゴメ	43,300	2,946.00	127,561,800	

アリアケジャパン	10,100	5,490.00	55,449,000	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	2,874.00	7,759,800		
やまみ	200	3,900.00	780,000	貸付株式数	100株
ニチレイ	41,200	4,166.00	171,639,200		
横浜冷凍	27,300	826.00	22,549,800	貸付株式数	10,700株
東洋水産	46,900	10,600.00	497,140,000		
イトアンドHLDGS	5,300	2,125.00	11,262,500	貸付株式数	1,900株
大冷	200	1,900.00	380,000		
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,500	1,264.00	6,952,000	貸付株式数	800株
日清食品H D	130,500	3,786.00	494,073,000	貸付株式数	50,500株
一正蒲鉾	500	737.00	368,500	貸付株式数	200株 (200株)
フジッコ	10,500	1,695.00	17,797,500	貸付株式数	3,800株
ロックフィールド	12,400	1,535.00	19,034,000	貸付株式数	4,800株
日本たばこ産業	615,200	4,154.00	2,555,540,800		
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,052.00	12,927,600		
わらべや日洋HD	6,800	1,958.00	13,314,400	貸付株式数	2,100株
なとり	6,400	2,184.00	13,977,600		
イフジ産業	200	1,626.00	325,200	貸付株式数	100株
ファーマフーズ	13,400	938.00	12,569,200	貸付株式数	5,200株
北の達人コーポ	43,600	146.00	6,365,600	貸付株式数	17,000株 (1,300株)
ユーグレナ	63,000	396.00	24,948,000	貸付株式数	24,600株 (600株)
紀文食品	8,800	1,059.00	9,319,200	貸付株式数	3,400株
ビックスホールディングス	6,000	1,015.00	6,090,000	貸付株式数	1,900株
スター・マイカ・HLDGS	10,500	736.00	7,728,000		
SREホールディングス	3,700	3,045.00	11,266,500	貸付株式数	1,600株
ADワークスグループ	2,700	208.00	561,600	貸付株式数	1,000株
片倉工業	9,500	1,894.00	17,993,000	貸付株式数	3,600株
グ ン ゼ	7,300	5,320.00	38,836,000		
ヒューリック	236,100	1,343.00	317,082,300	貸付株式数	92,600株
神 栄	200	1,620.00	324,000		
ラサ商事	5,900	1,356.00	8,000,400	貸付株式数	900株
アルペン	9,100	2,046.00	18,618,600	貸付株式数	3,400株
ハブ	400	742.00	296,800	貸付株式数	300株
ラクーンホールディングス	7,700	747.00	5,751,900	貸付株式数	300株

クオールホールディングス	13,500	1,492.00	20,142,000	
アルコニックス	15,500	1,456.00	22,568,000	
神戸物産	84,200	3,566.00	300,257,200	
ソリトンシステムズ	5,300	1,161.00	6,153,300	
ジンスホールディングス	8,300	6,330.00	52,539,000	貸付株式数 2,700株
ビックカメラ	65,100	1,723.00	112,167,300	貸付株式数 700株
DCMホールディングス	56,300	1,413.00	79,551,900	
ペッパーフードサービス	32,100	189.00	6,066,900	貸付株式数 12,200株
ハイパー	300	287.00	86,100	
M o n o t a R O	154,200	2,675.50	412,562,100	
東京一番フーズ	300	496.00	148,800	
D Dグループ	800	1,386.00	1,108,800	貸付株式数 700株
あい ホールディングス	17,400	2,078.00	36,157,200	
ディー・ブイエックス	200	912.00	182,400	
きちりホールディングス	400	900.00	360,000	貸付株式数 300株
J. フロント リテイリング	124,800	1,908.00	238,118,400	
ドトール・日レスHD	19,300	2,307.00	44,525,100	
マツキヨココカラ&カンパニー	191,700	2,161.00	414,263,700	貸付株式数 60,900株
ブロンコビリー	6,400	3,750.00	24,000,000	貸付株式数 2,400株
Z O Z O	80,900	4,899.00	396,329,100	
トレジャー・ファクトリー	7,500	1,376.00	10,320,000	貸付株式数 2,800株
物語コーポレーション	19,400	3,580.00	69,452,000	貸付株式数 7,600株
三越伊勢丹HD	165,000	2,336.00	385,440,000	
東洋紡	44,600	937.00	41,790,200	貸付株式数 17,400株
ユニチカ	33,200	143.00	4,747,600	貸付株式数 13,000株
富士紡ホールディングス	4,100	5,460.00	22,386,000	
日清紡ホールディングス	78,100	872.70	68,157,870	
倉敷紡績	7,300	5,390.00	39,347,000	
ダイワボウHD	48,200	3,045.00	146,769,000	
シキボウ	7,400	996.00	7,370,400	貸付株式数 1,800株
日東紡績	11,600	6,180.00	71,688,000	貸付株式数 2,700株
トヨタ紡織	43,300	1,990.00	86,167,000	
マクニカホールディングス	84,200	1,714.50	144,360,900	貸付株式数 13,300株
H a m e e	4,400	1,260.00	5,544,000	
マーケットエンタープライズ	100	838.00	83,800	
ラクト・ジャパン	4,600	2,706.00	12,447,600	貸付株式数 300株
ウエルシアHD	56,300	1,925.50	108,405,650	
クリエイトSDH	15,300	2,781.00	42,549,300	貸付株式数 5,600株

グリムス	4,600	2,400.00	11,040,000	貸付株式数	1,800株
バイタルK S KHD	15,000	1,116.00	16,740,000		
八洲電機	8,800	1,661.00	14,616,800	貸付株式数	3,100株
メディアスホールディングス	6,200	829.00	5,139,800	貸付株式数	2,300株
レスター	9,200	2,439.00	22,438,800		
ジオリーブグループ	300	1,060.00	318,000		
丸善CHI HD	2,000	318.00	636,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
大光	600	584.00	350,400	貸付株式数	500株
OCHIホールディングス	300	1,305.00	391,500		
TOKAIホールディングス	58,800	957.00	56,271,600	貸付株式数	22,300株
黒谷	300	548.00	164,400	貸付株式数	100株
ミサワ	200	700.00	140,000		
ティーライフ	200	1,140.00	228,000	貸付株式数	100株
C o m i n i x	200	902.00	180,400		
エー・ピーホールディングス	300	948.00	284,400	貸付株式数	200株
三洋貿易	11,200	1,521.00	17,035,200		
チムニー	500	1,251.00	625,500	貸付株式数	300株
シュッピン	10,700	993.00	10,625,100	貸付株式数	4,200株
ビューティガレージ	3,400	1,310.00	4,454,000	貸付株式数	1,300株
オイシックス・ラ・大地	17,600	1,344.00	23,654,400	貸付株式数	6,800株
ウイン・パートナーズ	7,900	1,253.00	9,898,700	貸付株式数	2,300株
ネクステージ	24,800	1,317.00	32,661,600	貸付株式数	9,700株
ジョイフル本田	30,200	1,837.00	55,477,400	貸付株式数	8,600株
エターナルホスピタリティ グル	4,000	2,817.00	11,268,000	貸付株式数	1,500株
ホットランド	8,300	2,228.00	18,492,400	貸付株式数	3,200株 (200株)
すかいらーくHD	148,700	2,431.50	361,564,050	貸付株式数	57,600株
SFPホールディングス	6,100	1,961.00	11,962,100	貸付株式数	2,300株
綿半ホールディングス	8,400	1,497.00	12,574,800	貸付株式数	1,800株
日本毛織	26,400	1,291.00	34,082,400	貸付株式数	7,100株
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	412.00	206,000	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	1,100	891.00	980,100	貸付株式数	1,000株
ヨシックスホールディングス	3,600	3,290.00	11,844,000	貸付株式数	1,300株

ユナイテッド・スーパー マーケ	45,700	742.00	33,909,400	貸付株式数 18,100株 (300株)
野村不動産HLDGS	63,500	3,697.00	234,759,500	
三重交通グループHD	21,700	493.00	10,698,100	貸付株式数 7,600株
地主	8,900	2,112.00	18,796,800	貸付株式数 3,400株
プレサンスコーポレーショ ン	13,400	1,932.00	25,888,800	貸付株式数 4,900株
フィル・カンパニー	2,000	885.00	1,770,000	貸付株式数 800株
ハウスコム	200	1,397.00	279,400	貸付株式数 100株
J P M C	5,800	1,126.00	6,530,800	
サンセイランディック	400	941.00	376,400	貸付株式数 300株
エストラスト	100	687.00	68,700	
フージャースHD	15,500	1,001.00	15,515,500	
オープンハウスグループ	37,100	5,370.00	199,227,000	貸付株式数 13,600株
東急不動産H D	304,500	913.30	278,099,850	
飯田 G H D	97,000	2,334.50	226,446,500	
イーグランド	200	1,386.00	277,200	貸付株式数 100株
帝国繊維	11,600	2,370.00	27,492,000	貸付株式数 3,900株
日本コークス工業	104,700	94.00	9,841,800	貸付株式数 40,000株
ゴルフダイジェスト・オン	6,200	368.00	2,281,600	貸付株式数 2,400株
ミタチ産業	400	1,200.00	480,000	貸付株式数 300株
B E E N O S	6,800	3,370.00	22,916,000	貸付株式数 2,400株
あさひ	9,100	1,543.00	14,041,300	
日本調剤	7,200	1,358.00	9,777,600	貸付株式数 2,300株
コスモス薬品	18,400	6,629.00	121,973,600	
シップヘルスケアHD	43,000	2,202.50	94,707,500	
トーエル	500	731.00	365,500	貸付株式数 100株
ソフトクリエイイトHD	7,400	2,244.00	16,605,600	
セブン&アイ・HLDGS	1,201,600	2,499.50	3,003,399,200	
クリエイイト・レストラン ツ・ホール	81,800	1,175.00	96,115,000	貸付株式数 32,000株
明治電機工業	4,000	1,348.00	5,392,000	
ツルハホールディングス	22,800	8,257.00	188,259,600	
デリカフーズHLDGS	500	501.00	250,500	
スターティアホールディン グス	400	2,201.00	880,400	貸付株式数 300株
サンマルクホールディング ス	8,800	2,571.00	22,624,800	
フェリシモ	400	832.00	332,800	

トリドールホールディングス	30,600	3,874.00	118,544,400	貸付株式数 12,000株
帝人	99,000	1,289.00	127,611,000	
東レ	752,800	996.10	749,864,080	
クラレ	150,100	2,252.50	338,100,250	
旭化成	696,700	1,071.50	746,514,050	
TOKYO BASE	11,600	321.00	3,723,600	貸付株式数 4,400株
稲葉製作所	5,900	1,691.00	9,976,900	貸付株式数 2,300株
宮地エンジニアリングG	12,800	1,898.00	24,294,400	貸付株式数 5,000株
トーカロ	30,600	1,851.00	56,640,600	
アルファCO	400	1,109.00	443,600	
SUMCO	202,000	1,153.00	232,906,000	貸付株式数 78,200株
川田テクノロジーズ	6,900	2,641.00	18,222,900	
RS TECHNOLOGIES	8,100	3,300.00	26,730,000	貸付株式数 1,800株
ジェイテックコーポレーション	200	1,245.00	249,000	
信和	800	737.00	589,600	貸付株式数 700株
ビーロッド	700	1,351.00	945,700	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	300	1,009.00	302,700	
AND DOホールディングス	6,000	966.00	5,796,000	貸付株式数 2,400株
シーアールイー	4,500	1,195.00	5,377,500	
ケイアイスター不動産	5,500	4,230.00	23,265,000	貸付株式数 300株
アグレ都市デザイン	300	1,603.00	480,900	貸付株式数 200株
ジェイ・エス・ビー	4,200	2,605.00	10,941,000	
ロードスターキャピタル	5,800	2,474.00	14,349,200	
イノベーションホールディングンク	400	917.00	366,800	貸付株式数 200株
グローバルリンクマネジメン ト	200	2,802.00	560,400	貸付株式数 100株
フェイスネットワーク	400	1,633.00	653,200	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	4,200	12,730.00	53,466,000	貸付株式数 1,600株
SUMINOE	300	2,014.00	604,200	貸付株式数 200株 (200株)
日本フエルト	600	479.00	287,400	
イチカワ	100	1,579.00	157,900	
エコナックホールディングス	1,100	112.00	123,200	貸付株式数 1,000株
日東製網	200	1,493.00	298,600	貸付株式数 100株
芦森工業	200	2,580.00	516,000	
アツギ	800	979.00	783,200	貸付株式数 300株

ウイルプラスHLDGS	200	1,003.00	200,600	
JMホールディングス	7,700	2,425.00	18,672,500	
コメダホールディングス	28,500	2,880.00	82,080,000	貸付株式数 9,000株
サツドラホールディングス	500	790.00	395,000	貸付株式数 400株
アレンザホールディングス	8,100	1,086.00	8,796,600	貸付株式数 3,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,300	1,389.00	4,583,700	貸付株式数 1,200株 (300株)
バロックジャパン	12,800	787.00	10,073,600	貸付株式数 4,900株
クスリのアオキHLDGS	36,400	3,239.00	117,899,600	
ダイニック	400	730.00	292,000	
共和レザー	700	687.00	480,900	
ピーバンドットコム	200	390.00	78,000	貸付株式数 100株
力の源HD	8,100	951.00	7,703,100	貸付株式数 3,200株
FOOD&LIFE COMPAN	58,000	3,445.00	199,810,000	
アセンテック	4,200	957.00	4,019,400	
セーレン	19,900	2,807.00	55,859,300	
ソトー	300	668.00	200,400	貸付株式数 100株
東海染工	100	690.00	69,000	
小松マテーレ	15,000	784.00	11,760,000	
ワコールホールディングス	21,300	5,300.00	112,890,000	
ホギメディカル	13,900	4,770.00	66,303,000	貸付株式数 5,300株
クラウドシアHLDGS	300	329.00	98,700	貸付株式数 200株
T S I ホールディングス	32,500	1,034.00	33,605,000	貸付株式数 11,100株
マツオカコーポレーション	300	1,985.00	595,500	
ワールド	15,900	2,487.00	39,543,300	
T I S	109,000	3,868.00	421,612,000	貸付株式数 28,500株
テクミラホールディングス	600	333.00	199,800	貸付株式数 500株
グリー	34,700	449.00	15,580,300	
G M O ベパボ	1,300	1,542.00	2,004,600	貸付株式数 200株
コーエーテクモHD	77,600	1,816.00	140,921,600	貸付株式数 30,400株
三菱総合研究所	5,100	4,675.00	23,842,500	
ボルテージ	300	225.00	67,500	貸付株式数 100株
電算	100	1,428.00	142,800	
A G S	500	809.00	404,500	貸付株式数 400株
ファインデックス	8,100	803.00	6,504,300	貸付株式数 3,200株
ブレインパッド	8,600	1,187.00	10,208,200	貸付株式数 3,300株
K L a b	26,000	171.00	4,446,000	貸付株式数 6,100株

ポールトゥウィンホールディング	14,700	421.00	6,188,700	貸付株式数 5,500株
ネクソン	226,600	2,230.00	505,318,000	
アイスタイル	34,500	474.00	16,353,000	貸付株式数 13,200株
エムアップホールディングス	12,600	1,569.00	19,769,400	
エイチーム	6,800	996.00	6,772,800	貸付株式数 2,600株
エニグモ	11,600	294.00	3,410,400	貸付株式数 4,600株
テクノスジャパン	1,000	766.00	766,000	
e n i s h	1,500	153.00	229,500	貸付株式数 800株
コロプラ	35,100	470.00	16,497,000	貸付株式数 13,300株
オルトプラス	1,100	78.00	85,800	貸付株式数 900株
ブロードリーフ	41,400	688.00	28,483,200	
クロス・マーケティングG	500	766.00	383,000	貸付株式数 400株
デジタルハーツHLDGS	7,300	819.00	5,978,700	
メディアドゥ	4,600	1,402.00	6,449,200	貸付株式数 1,500株
じげん	25,700	489.00	12,567,300	貸付株式数 10,000株
バイキューブ	13,900	200.00	2,780,000	貸付株式数 2,500株
エンカレッジ・テクノロジー	300	576.00	172,800	貸付株式数 200株
サイバーリンクス	500	766.00	383,000	貸付株式数 400株
ディー・エル・イー	4,300	130.00	559,000	
フィックスターズ	10,400	1,860.00	19,344,000	貸付株式数 4,000株
CARTA HOLDINGS	5,800	1,414.00	8,201,200	貸付株式数 2,200株
オプティム	10,700	704.00	7,532,800	貸付株式数 3,900株
セレス	4,600	3,340.00	15,364,000	貸付株式数 1,400株
S H I F T	6,900	16,995.00	117,265,500	貸付株式数 2,500株
特種東海製紙	5,000	3,495.00	17,475,000	貸付株式数 1,200株
セック	1,800	4,430.00	7,974,000	
テクマトリックス	22,200	2,441.00	54,190,200	
プロシップ	4,500	1,569.00	7,060,500	貸付株式数 700株
ガンホー・オンライン・エンター	25,600	3,202.00	81,971,200	
GMOペイメントゲートウェイ	23,500	8,168.00	191,948,000	貸付株式数 8,600株
ザッパラス	200	365.00	73,000	貸付株式数 100株
システムリサーチ	7,000	1,445.00	10,115,000	貸付株式数 700株
インターネットイニシアティブ	56,300	3,019.00	169,969,700	
さくらインターネット	16,100	4,355.00	70,115,500	貸付株式数 6,300株
GMOグローバルサインHD	3,100	2,464.00	7,638,400	貸付株式数 1,100株

SRAホールディングス	5,900	4,320.00	25,488,000	
システムインテグレータ	400	304.00	121,600	
朝日ネット	11,100	651.00	7,226,100	
e B A S E	14,500	643.00	9,323,500	貸付株式数 5,600株
アバントグループ	13,000	2,007.00	26,091,000	
アドソル日進	4,300	2,126.00	9,141,800	
ODKソリューションズ	300	562.00	168,600	貸付株式数 200株
フリービット	4,500	1,434.00	6,453,000	
コムチュア	13,600	2,287.00	31,103,200	
アステリア	8,100	519.00	4,203,900	貸付株式数 3,000株
アイル	5,800	2,713.00	15,735,400	貸付株式数 2,200株
王子ホールディングス	390,000	588.90	229,671,000	
日本製紙	53,500	848.00	45,368,000	貸付株式数 21,400株
三菱製紙	1,500	473.00	709,500	貸付株式数 1,400株
北越コーポレーション	57,800	1,546.00	89,358,800	貸付株式数 22,600株
中越パルプ	500	1,451.00	725,500	貸付株式数 300株
巴川コーポレーション	400	694.00	277,600	貸付株式数 300株
大王製紙	51,900	820.00	42,558,000	
阿波製紙	300	452.00	135,600	貸付株式数 200株
マークラインズ	6,100	2,129.00	12,986,900	
メディカル・データ・ビジ	12,200	383.00	4,672,600	貸付株式数 4,700株
g u m i	16,800	460.00	7,728,000	貸付株式数 6,500株
ショーケース	100	274.00	27,400	
モバイルファクトリー	300	922.00	276,600	貸付株式数 200株
テラスカイ	4,000	2,116.00	8,464,000	貸付株式数 1,500株
デジタル・インフォメー ション	5,400	2,179.00	11,766,600	
PCIホールディングス	400	890.00	356,000	貸付株式数 100株
アイビーシー	200	665.00	133,000	
ネオジャパン	2,700	1,739.00	4,695,300	
P R T I M E S	2,100	1,673.00	3,513,300	貸付株式数 800株
ラクス	48,800	1,918.50	93,622,800	
ランドコンピュータ	500	658.00	329,000	貸付株式数 200株
ダブルスタンダード	3,700	1,592.00	5,890,400	貸付株式数 1,000株
オープンドア	7,200	659.00	4,744,800	貸付株式数 2,800株
マイネット	400	333.00	133,200	貸付株式数 100株
アカツキ	5,000	2,783.00	13,915,000	
ベネフィットジャパン	100	1,074.00	107,400	
UBI COMホールディングス	3,300	1,239.00	4,088,700	

カナミックネットワーク	12,900	501.00	6,462,900	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	122.00	146,400	
レンゴー	93,700	847.90	79,448,230	
トーモク	5,900	2,181.00	12,867,900	貸付株式数 700株
ザ・パック	7,600	3,550.00	26,980,000	貸付株式数 3,000株
チェンジホールディングス	25,600	1,471.00	37,657,600	
シンクロ・フード	700	349.00	244,300	貸付株式数 200株
オークネット	4,800	2,677.00	12,849,600	貸付株式数 1,800株
キャピタル・アセット・プラン	200	747.00	149,400	
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	1,509.00	301,800	
マクロミル	19,400	1,225.00	23,765,000	
ビーグリー	200	1,695.00	339,000	
オロ	4,300	2,453.00	10,547,900	貸付株式数 1,600株
ユーザーローカル	4,400	1,881.00	8,276,400	貸付株式数 1,600株
テモナ	300	187.00	56,100	貸付株式数 200株
ニーズウェル	1,200	389.00	466,800	貸付株式数 900株
マネーフォワード	25,300	5,033.00	127,334,900	
サインポスト	500	411.00	205,500	貸付株式数 400株
レゾナック・ホールディング	92,400	4,082.00	377,176,800	
住友化学	828,400	341.50	282,898,600	
住友精化	4,900	4,620.00	22,638,000	
日産化学	53,000	4,832.00	256,096,000	
ラサ工業	3,700	2,707.00	10,015,900	
クレハ	21,300	2,749.00	58,553,700	貸付株式数 3,500株
多木化学	4,000	3,535.00	14,140,000	貸付株式数 1,500株
テイカ	7,500	1,595.00	11,962,500	貸付株式数 1,000株
石原産業	17,100	1,463.00	25,017,300	
片倉コープアグリ	300	949.00	284,700	貸付株式数 200株
日本曹達	21,900	2,798.00	61,276,200	
東ソー	137,500	2,042.00	280,775,000	
トクヤマ	33,300	2,563.00	85,347,900	
セントラル硝子	13,000	3,210.00	41,730,000	
東亜合成	49,500	1,493.50	73,928,250	
大阪ソーダ	35,900	1,963.00	70,471,700	貸付株式数 9,600株
関東電化	22,100	1,008.00	22,276,800	貸付株式数 8,600株
SUN ASTERISK	7,400	691.00	5,113,400	貸付株式数 2,800株

デンカ	37,500	2,130.00	79,875,000	
イビデン	59,600	4,366.00	260,213,600	貸付株式数 23,000株
信越化学	923,600	5,201.00	4,803,643,600	
日本カ - バイド	5,400	1,705.00	9,207,000	
電算システムHD	4,600	2,425.00	11,155,000	貸付株式数 1,500株
堺 化 学	7,200	2,564.00	18,460,800	
第一稀元素化学工	11,200	671.00	7,515,200	貸付株式数 4,400株
エア・ウォーター	97,200	1,844.50	179,285,400	
日本酸素HLDGS	99,900	4,359.00	435,464,100	
日本化学工業	3,800	2,321.00	8,819,800	
東邦アセチレン	1,100	365.00	401,500	
日本パ - カライジング	45,900	1,260.00	57,834,000	
高压ガス	14,800	789.00	11,677,200	貸付株式数 4,600株
チタン工業	200	815.00	163,000	貸付株式数 100株
四国化成ホールディング	11,600	2,063.00	23,930,800	
戸田工業	2,300	1,189.00	2,734,700	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	5,600	4,040.00	22,624,000	
保土谷化学	3,200	3,705.00	11,856,000	
日本触媒	66,000	1,873.50	123,651,000	貸付株式数 4,800株
大日精化	7,200	2,928.00	21,081,600	
カネカ	25,400	3,636.00	92,354,400	
協和キリン	121,300	2,382.00	288,936,600	
APPIER GROUP	31,400	1,434.00	45,027,600	貸付株式数 600株
三菱瓦斯化学	83,600	2,698.00	225,552,800	貸付株式数 32,300株
三井化学	92,700	3,341.00	309,710,700	貸付株式数 21,600株
東京応化工業	49,100	3,507.00	172,193,700	
大阪有機化学	8,600	2,826.00	24,303,600	貸付株式数 2,000株
三菱ケミカルグループ	752,900	770.10	579,808,290	
K H ネオケム	18,600	2,015.00	37,479,000	貸付株式数 7,100株
ビジョナル	12,200	8,333.00	101,662,600	貸付株式数 4,600株
ダイセル	117,200	1,362.00	159,626,400	
住友ベ - クライト	32,500	3,754.00	122,005,000	
積水化学	205,100	2,391.00	490,394,100	
日本ゼオン	79,400	1,424.50	113,105,300	
アイカ工業	26,000	3,217.00	83,642,000	
U B E	53,100	2,329.50	123,696,450	貸付株式数 12,000株
積水樹脂	14,100	2,160.00	30,456,000	貸付株式数 2,000株
旭有機材	6,900	4,445.00	30,670,500	貸付株式数 2,600株
ニチバン	6,400	1,987.00	12,716,800	

リケンテクノス	19,300	1,052.00	20,303,600	
大倉工業	4,800	3,000.00	14,400,000	貸付株式数 1,800株
積水化成品	14,400	348.00	5,011,200	貸付株式数 5,400株
群栄化学	2,400	2,622.00	6,292,800	
タイガース ポリマー	600	701.00	420,600	
ミライアル	400	1,315.00	526,000	貸付株式数 300株
ダイキアクシス	500	726.00	363,000	貸付株式数 300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	22,600	611.00	13,808,600	
竹本容器	400	859.00	343,600	
森六ホールディングス	5,700	1,968.00	11,217,600	
恵和	6,700	999.00	6,693,300	貸付株式数 2,500株
日本化薬	72,100	1,270.00	91,567,000	貸付株式数 4,800株
カーリット	10,200	1,266.00	12,913,200	貸付株式数 3,900株
ソルクシーズ	900	330.00	297,000	貸付株式数 600株
CLホールディングス	2,500	653.00	1,632,500	貸付株式数 900株
プレステージ・インター	49,500	687.00	34,006,500	
フェイス	300	1,218.00	365,400	
プロトコーポレーション	11,300	1,302.00	14,712,600	
ハイマックス	3,200	1,373.00	4,393,600	
アミューズ	6,500	1,432.00	9,308,000	貸付株式数 2,400株
野村総合研究所	223,500	4,616.00	1,031,676,000	貸付株式数 86,400株
ドリームインキュベータ	2,600	3,330.00	8,658,000	貸付株式数 900株
クイック	7,300	2,265.00	16,534,500	
T A C	500	200.00	100,000	貸付株式数 300株
C E ホールディングス	500	549.00	274,500	
日本システム技術	9,500	2,003.00	19,028,500	貸付株式数 3,700株
電通グループ	112,400	3,916.00	440,158,400	
インテージホールディングス	11,700	1,633.00	19,106,100	貸付株式数 4,500株
テイクアンドギヴニーズ	5,000	916.00	4,580,000	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	4,800	1,387.00	6,657,600	
びあ	3,600	3,105.00	11,178,000	貸付株式数 1,300株
イオンファンタジー	4,600	2,935.00	13,501,000	貸付株式数 1,700株
ソースネクスト	52,300	178.00	9,309,400	貸付株式数 20,100株
シーティーエス	14,600	929.00	13,563,400	
NEXYZ.GROUP	400	761.00	304,400	
メディカルシステムネットワーク	10,600	418.00	4,430,800	

日本精化	6,800	2,298.00	15,626,400	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	9,600	3,500.00	33,600,000		
トリケミカル	11,200	2,740.00	30,688,000		
シンプレクスHD	20,200	2,509.00	50,681,800		
HEROZ	4,000	918.00	3,672,000	貸付株式数	1,600株
ラクスル	25,000	1,343.00	33,575,000		
メルカリ	50,400	1,839.00	92,685,600	貸付株式数	19,400株
IPS	3,000	2,507.00	7,521,000		
FIG	1,300	300.00	390,000	貸付株式数	1,200株
システムサポート	4,000	1,753.00	7,012,000		
ADEKA	36,000	2,784.00	100,224,000		
日油	121,200	2,182.50	264,519,000		
ミヨシ油脂	400	1,565.00	626,000	貸付株式数	100株
新日本理化	1,600	194.00	310,400	貸付株式数	1,500株
ハリマ化成グループ	8,000	866.00	6,928,000		
イーソル	6,900	619.00	4,271,100	貸付株式数	2,600株
東海ソフト	200	1,378.00	275,600		
ウイングアーク1ST	10,700	3,570.00	38,199,000		
ヒト・コミュニケーションズHD	3,500	814.00	2,849,000	貸付株式数	1,200株
サーバーワークス	1,800	2,362.00	4,251,600	貸付株式数	700株
東名	200	2,389.00	477,800		
ヴィッツ	100	930.00	93,000		
トピラシステムズ	300	794.00	238,200		
Sansan	34,000	2,426.00	82,484,000	貸付株式数	12,800株
LINK-Uグループ	200	410.00	82,000		
ギフトィ	9,100	1,340.00	12,194,000	貸付株式数	2,800株
花王	250,800	6,527.00	1,636,971,600		
第一工業製薬	3,700	3,915.00	14,485,500		
石原ケミカル	4,500	2,376.00	10,692,000	貸付株式数	1,600株
日華化学	500	1,141.00	570,500	貸付株式数	100株
ニイタカ	200	2,007.00	401,400	貸付株式数	100株
三洋化成	6,400	3,980.00	25,472,000		
メドレー	11,300	3,895.00	44,013,500	貸付株式数	3,700株
ベース	5,100	2,973.00	15,162,300	貸付株式数	1,000株
JMDC	12,600	3,992.00	50,299,200	貸付株式数	6,000株
武田薬品	917,600	4,097.00	3,759,407,200		
アステラス製薬	904,600	1,509.50	1,365,493,700		
住友ファーマ	91,800	579.00	53,152,200		

塩野義製薬	342,100	2,167.50	741,501,750	
わかもと製薬	1,300	229.00	297,700	貸付株式数 500株
日本新薬	27,000	4,189.00	113,103,000	
中外製薬	322,800	6,813.00	2,199,236,400	
科研製薬	17,700	4,303.00	76,163,100	
エーザイ	136,800	4,350.00	595,080,000	
理研ビタミン	8,700	2,438.00	21,210,600	
ロート製薬	109,000	2,677.50	291,847,500	
小野薬品	211,000	1,630.50	344,035,500	
久光製薬	22,900	4,111.00	94,141,900	貸付株式数 8,400株
有機合成薬品	900	263.00	236,700	
持田製薬	13,000	3,450.00	44,850,000	
参天製薬	196,000	1,556.00	304,976,000	
扶桑薬品	4,000	2,576.00	10,304,000	
日本ケミファ	100	1,514.00	151,400	
ツムラ	35,400	4,792.00	169,636,800	
テルモ	687,800	3,025.00	2,080,595,000	貸付株式数 86,500株
HUグループHD	30,900	2,575.00	79,567,500	貸付株式数 9,400株
キッセイ薬品工業	17,100	3,510.00	60,021,000	
生化学工業	19,800	793.00	15,701,400	
栄研化学	16,300	2,156.00	35,142,800	貸付株式数 6,400株
鳥居薬品	5,500	4,415.00	24,282,500	
JCRファーマ	34,900	615.00	21,463,500	
東和薬品	13,900	2,745.00	38,155,500	
富士製薬工業	7,600	1,532.00	11,643,200	
ゼリア新薬工業	16,400	2,407.00	39,474,800	貸付株式数 3,900株
ネクセラファーマ	48,400	1,044.00	50,529,600	貸付株式数 18,900株
第一三共	973,300	4,343.00	4,227,041,900	
杏林製薬	22,400	1,453.00	32,547,200	貸付株式数 8,700株
大幸薬品	23,300	322.00	7,502,600	貸付株式数 7,500株
ダイト	7,700	2,010.00	15,477,000	
大塚ホールディングス	257,400	8,609.00	2,215,956,600	
ペプチドリーム	50,000	2,617.50	130,875,000	貸付株式数 4,000株
大日本塗料	11,400	1,132.00	12,904,800	
日本ペイントHOLD	455,700	1,042.00	474,839,400	
関西ペイント	86,300	2,183.00	188,392,900	
神東塗料	900	129.00	116,100	貸付株式数 800株
中国塗料	23,300	2,278.00	53,077,400	
日本特殊塗料	800	1,250.00	1,000,000	
藤倉化成	13,000	508.00	6,604,000	

太陽ホールディングス	18,000	3,940.00	70,920,000	
D I C	36,600	3,632.00	132,931,200	
サカタインクス	22,900	1,641.00	37,578,900	貸付株式数 8,800株
ARTIENCE	18,400	3,020.00	55,568,000	
アルプス技研	9,200	2,624.00	24,140,800	貸付株式数 3,600株
サニックス	14,800	248.00	3,670,400	貸付株式数 5,900株
日本空調サービス	11,400	1,005.00	11,457,000	
オリエンタルランド	629,300	3,304.00	2,079,207,200	
フォーカスシステムズ	6,900	1,115.00	7,693,500	
ダスキン	23,100	3,677.00	84,938,700	
パーク 2 4	78,900	2,123.50	167,544,150	
明光ネットワークジャパン	12,900	722.00	9,313,800	貸付株式数 4,400株
ファルコホールディングス	4,200	2,323.00	9,756,600	
クレスコ	16,900	1,189.00	20,094,100	
フジ・メディア・HD	99,000	1,735.50	171,814,500	
秀英予備校	200	263.00	52,600	
田谷	200	315.00	63,000	
ラウンドワン	99,700	1,338.00	133,398,600	
リゾートトラスト	41,800	3,137.00	131,126,600	貸付株式数 11,000株
オービック	191,500	4,784.00	916,136,000	
ジャストシステム	14,800	3,585.00	53,058,000	
T D C ソフト	17,400	1,441.00	25,073,400	
L I N E ヤフー	1,649,700	438.00	722,568,600	
ビー・エム・エル	13,000	2,943.00	38,259,000	
トレンドマイクロ	54,200	8,405.00	455,551,000	
IDホールディングス	6,900	1,582.00	10,915,800	
リソー教育	66,100	300.00	19,830,000	
日本オラクル	19,700	14,610.00	287,817,000	貸付株式数 3,800株
早稲田アカデミー	5,800	1,824.00	10,579,200	貸付株式数 2,100株 (900株)
アルファシステムズ	3,200	3,585.00	11,472,000	
フューチャー	25,700	1,892.00	48,624,400	
CAC HOLDINGS	6,300	1,680.00	10,584,000	
トーセ	400	614.00	245,600	貸付株式数 200株
ユー・エス・エス	217,400	1,347.50	292,946,500	
オービックビジネス C	17,400	7,087.00	123,313,800	貸付株式数 5,500株
アイティフォー	12,100	1,444.00	17,472,400	
東京個別指導学院	12,500	360.00	4,500,000	貸付株式数 400株
東計電算	2,900	4,330.00	12,557,000	貸付株式数 1,100株
サイバーエージェント	233,600	1,125.50	262,916,800	

楽天グループ	744,700	996.80	742,316,960	貸付株式数 297,500株
エックスネット	200	1,510.00	302,000	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,533.00	8,124,900	
SBIグローバルアセット	20,800	654.00	13,603,200	
テー・オー・ダブリュー	20,600	312.00	6,427,200	
大塚商会	116,900	3,650.00	426,685,000	
サイボウズ	14,200	2,142.00	30,416,400	
山田コンサルティングGP	5,300	1,883.00	9,979,900	
セントラルスポーツ	4,000	2,410.00	9,640,000	貸付株式数 1,400株
パラカ	3,200	1,804.00	5,772,800	
電通総研	10,000	5,850.00	58,500,000	
A C C E S S	10,700	898.00	9,608,600	貸付株式数 4,100株
デジタルガレージ	16,500	3,725.00	61,462,500	
イーエムシステムズ	17,200	782.00	13,450,400	
ウェザーニューズ	6,400	3,265.00	20,896,000	
C I J	25,700	461.00	11,847,700	
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,595.00	8,628,000	貸付株式数 900株
日本エンタープライズ	1,100	130.00	143,000	貸付株式数 400株
WOWOW	7,700	999.00	7,692,300	貸付株式数 2,900株
スカラ	9,400	394.00	3,703,600	貸付株式数 3,600株
インテリジェント ウェイブ	600	1,133.00	679,800	
フルキャストホールディングス	8,700	1,451.00	12,623,700	
エン・ジャパン	17,200	2,129.00	36,618,800	貸付株式数 5,900株
セルソース	6,900	861.00	5,940,900	貸付株式数 2,600株
あすか製薬HD	9,400	2,048.00	19,251,200	貸付株式数 3,100株
サワイグループHD	60,700	2,008.00	121,885,600	貸付株式数 14,200株
富士フイルムHLDGS	621,800	3,372.00	2,096,709,600	
コニカミノルタ	231,900	678.10	157,251,390	
資 生 堂	215,300	2,767.50	595,842,750	
ライオン	131,300	1,818.00	238,703,400	
高砂香料	7,000	5,670.00	39,690,000	
マンダム	20,500	1,302.00	26,691,000	
ミルボン	16,600	3,505.00	58,183,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
コーセー	21,000	6,919.00	145,299,000	
コタ	10,500	1,597.00	16,768,500	
シーボン	200	1,073.00	214,600	
ポーラ・オルビスHD	52,900	1,451.50	76,784,350	貸付株式数 20,700株

ノエビアホールディングス	9,200	4,845.00	44,574,000	貸付株式数	2,700株
アジュバンホールディング	400	810.00	324,000	貸付株式数	200株 (200株)
新日本製薬	5,900	1,924.00	11,351,600	貸付株式数	2,100株
アクシージア	6,700	528.00	3,537,600	貸付株式数	2,500株
エステー	8,500	1,531.00	13,013,500		
アグロカネショウ	3,400	1,895.00	6,443,000		
コニシ	32,500	1,256.00	40,820,000	貸付株式数	12,700株
長谷川香料	19,700	3,095.00	60,971,500	貸付株式数	1,700株
小林製薬	27,000	5,945.00	160,515,000		
荒川化学工業	9,500	1,109.00	10,535,500		
メック	8,500	3,285.00	27,922,500	貸付株式数	3,200株
日本高純度化学	2,600	3,165.00	8,229,000		
タカラバイオ	32,500	1,004.00	32,630,000		
J C U	11,400	3,830.00	43,662,000		
新田ゼラチン	800	726.00	580,800	貸付株式数	700株
O A T アグリオ	4,300	2,036.00	8,754,800	貸付株式数	1,600株
デクセリアルズ	90,300	2,495.00	225,298,500	貸付株式数	14,700株
アース製薬	9,400	5,570.00	52,358,000	貸付株式数	3,600株
北興化学	9,200	1,328.00	12,217,600		
大成ラミック	2,900	2,459.00	7,131,100		
クミアイ化学	41,000	730.00	29,930,000	貸付株式数	14,400株
日本農薬	15,700	670.00	10,519,000		
富士興産	300	1,405.00	421,500		
ニチレキグループ	11,100	2,479.00	27,516,900		
ユシロ化学	5,300	2,160.00	11,448,000		
ビーピー・カストロール	600	891.00	534,600	貸付株式数	400株
富士石油	27,000	285.00	7,695,000		
M O R E S C O	400	1,280.00	512,000		
出光興産	481,900	1,014.00	488,646,600		
ENEOSホールディングス	1,749,200	789.00	1,380,118,800		
コスモエネルギーHLDGS	34,000	6,599.00	224,366,000		
テスホールディングス	21,500	265.00	5,697,500	貸付株式数	8,000株
インフロニアHD	105,600	1,148.00	121,228,800		
横浜ゴム	52,100	3,211.00	167,293,100		
TOYO TIRE	59,300	2,448.00	145,166,400		
ブリヂストン	301,900	5,243.00	1,582,861,700		
住友ゴム	101,100	1,785.50	180,514,050		
藤倉コンポジット	9,900	1,513.00	14,978,700		
オカモト	5,500	5,650.00	31,075,000		

アキレス	5,600	1,441.00	8,069,600	貸付株式数	2,100株
フ コ ク	6,100	1,715.00	10,461,500	貸付株式数	2,400株
ニッタ	10,100	3,640.00	36,764,000		
クリエートメディック	400	929.00	371,600		
住友理工	20,000	1,601.00	32,020,000		
三ツ星ベルト	14,400	3,975.00	57,240,000	貸付株式数	5,600株
バンドー化学	15,300	1,829.00	27,983,700		
A G C	100,300	4,561.00	457,468,300		
日本板硝子	52,700	360.00	18,972,000	貸付株式数	20,600株
石塚硝子	200	2,244.00	448,800	貸付株式数	100株
有沢製作所	15,500	1,420.00	22,010,000		
日本山村硝子	500	1,554.00	777,000		
日本電気硝子	38,300	3,357.00	128,573,100		
オハラ	4,900	1,096.00	5,370,400	貸付株式数	1,900株
住友大阪セメント	18,500	3,244.00	60,014,000	貸付株式数	6,100株
太平洋セメント	63,600	3,633.00	231,058,800		
リソルホールディングス	200	5,040.00	1,008,000		
日本ヒュ - ム	9,100	1,313.00	11,948,300	貸付株式数	3,200株
日本コンクリ - ト	20,300	363.00	7,368,900	貸付株式数	7,800株
三谷セキサン	4,300	5,570.00	23,951,000	貸付株式数	1,300株
アジアパイルH D	14,800	776.00	11,484,800		
東海カーボン	95,100	886.40	84,296,640		
日本カーボン	5,900	4,470.00	26,373,000	貸付株式数	2,300株
東洋炭素	7,300	4,305.00	31,426,500	貸付株式数	2,800株 (800株)
ノリタケ	11,400	3,780.00	43,092,000	貸付株式数	2,100株
T O T O	74,800	3,888.00	290,822,400	貸付株式数	25,000株
日本碍子	120,000	1,923.00	230,760,000		
日本特殊陶業	84,300	4,709.00	396,968,700		
ダントーホールディングス	400	318.00	127,200	貸付株式数	200株
M A R U W A	4,300	45,420.00	195,306,000	貸付株式数	1,400株
品川リフラクトリーズ	12,700	1,671.00	21,221,700	貸付株式数	3,500株
黒崎播磨	7,000	2,380.00	16,660,000		
ヨータイ	5,200	1,560.00	8,112,000		
東京窯業	1,300	408.00	530,400		
ニッカトー	500	507.00	253,500		
フジインコーポレーテッド	27,700	2,396.00	66,369,200		
クニミネ工業	500	1,005.00	502,500	貸付株式数	300株

エーアンドエーマテリアル	300	1,247.00	374,100	
ニチアス	26,100	5,808.00	151,588,800	
日本製鉄	537,200	2,997.00	1,609,988,400	
神戸製鋼所	213,300	1,485.50	316,857,150	貸付株式数 60,300株
中山製鋼所	21,800	708.00	15,434,400	貸付株式数 8,500株
合同製鐵	5,900	3,705.00	21,859,500	貸付株式数 2,300株
J F E ホールディングス	319,600	1,665.00	532,134,000	
東京製鐵	29,600	1,460.00	43,216,000	貸付株式数 10,700株
共英製鋼	10,300	1,760.00	18,128,000	
大和工業	20,000	7,301.00	146,020,000	
東京鐵鋼	4,700	6,320.00	29,704,000	貸付株式数 1,700株
大阪製鐵	4,900	2,979.00	14,597,100	貸付株式数 1,800株
淀川製鋼所	9,800	5,440.00	53,312,000	貸付株式数 2,300株
中部鋼鈑	7,000	2,306.00	16,142,000	貸付株式数 2,700株
丸一鋼管	32,300	3,398.00	109,755,400	
モリ工業	2,700	4,675.00	12,622,500	
大同特殊鋼	66,800	1,112.50	74,315,000	
日本高周波	500	350.00	175,000	貸付株式数 400株
日本冶金工	7,100	3,750.00	26,625,000	
山陽特殊製鋼	10,500	1,771.00	18,595,500	
愛知製鋼	6,100	4,820.00	29,402,000	
日本金属	300	648.00	194,400	貸付株式数 200株
ミガロホールディングス	400	1,518.00	607,200	貸付株式数 300株
大平洋金属	9,800	1,417.00	13,886,600	貸付株式数 3,800株
新日本電工	63,300	280.00	17,724,000	
栗本鉄工所	4,900	4,030.00	19,747,000	
虹 技	200	1,204.00	240,800	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	200	1,023.00	204,600	貸付株式数 100株
日本製鋼所	31,500	6,300.00	198,450,000	
三菱製鋼	7,800	1,384.00	10,795,200	
日亜鋼業	1,100	299.00	328,900	
日本精線	8,400	1,267.00	10,642,800	
エンビプロHD	10,400	395.00	4,108,000	貸付株式数 3,900株 (1,400株)
大紀アルミニウム	15,200	1,038.00	15,777,600	貸付株式数 5,900株
日本軽金属HD	31,000	1,496.00	46,376,000	
三井金属	26,500	4,545.00	120,442,500	
東邦亜鉛	8,300	740.00	6,142,000	貸付株式数 3,200株
三菱マテリアル	75,800	2,305.00	174,719,000	
住友鉱山	134,200	3,495.00	469,029,000	貸付株式数 34,700株

DOWAホールディングス	28,600	4,396.00	125,725,600	
古河機金	14,000	1,521.00	21,294,000	
エス・サイエンス	6,800	21.00	142,800	貸付株式数 6,400株
大阪チタニウム	18,400	1,773.00	32,623,200	貸付株式数 7,200株
東邦チタニウム	21,900	1,016.00	22,250,400	貸付株式数 8,600株
U A C J	14,900	5,270.00	78,523,000	
C K サンエツ	2,600	3,790.00	9,854,000	貸付株式数 500株
古河電工	35,300	6,774.00	239,122,200	
住友電工	366,400	2,861.50	1,048,453,600	
フジクラ	113,800	6,248.00	711,022,400	
S W C C	14,200	7,510.00	106,642,000	貸付株式数 5,400株
カナレ電気	200	1,431.00	286,200	
平河ヒューテック	6,800	1,539.00	10,465,200	貸付株式数 1,500株
いよぎんホールディング	132,600	1,499.50	198,833,700	
しずおかフィナンシャル	223,100	1,301.50	290,364,650	
ちゅうぎんフィナンシャ	85,300	1,660.00	141,598,000	
楽天銀行	47,000	4,400.00	206,800,000	貸付株式数 9,300株
京都フィナンシャルG	127,500	2,234.00	284,835,000	貸付株式数 33,000株
リョービ	11,300	2,190.00	24,747,000	貸付株式数 4,400株
アールステイ	1,200	537.00	644,400	貸付株式数 400株
AREホールディングス	42,900	1,670.00	71,643,000	
東洋製罐グループHD	67,600	2,441.50	165,045,400	
ホッカンホールディングス	5,700	1,637.00	9,330,900	
コロナ	5,800	962.00	5,579,600	
横河ブリッジHLDGS	18,400	2,780.00	51,152,000	
駒井ハルテック	300	1,538.00	461,400	
高田機工	400	1,016.00	406,400	
三和ホールディングス	104,700	4,527.00	473,976,900	
文化シヤッタ -	27,700	1,850.00	51,245,000	貸付株式数 9,500株
三協立山	13,300	652.00	8,671,600	貸付株式数 3,500株
アルインコ	8,000	1,033.00	8,264,000	貸付株式数 1,100株
東洋シヤッタ -	300	767.00	230,100	
L I X I L	154,600	1,707.50	263,979,500	
日本フィルコン	800	500.00	400,000	貸付株式数 700株
ノーリツ	14,900	1,679.00	25,017,100	
長府製作所	11,800	1,871.00	22,077,800	
リンナイ	56,400	3,168.00	178,675,200	貸付株式数 20,800株
ユニプレス	18,400	1,073.00	19,743,200	貸付株式数 7,200株
ダイニチ工業	600	620.00	372,000	

日東精工	15,400	634.00	9,763,600	
三洋工業	100	2,824.00	282,400	
岡 部	18,700	762.00	14,249,400	
ジーテクト	11,800	1,592.00	18,785,600	
東 プ レ	18,700	1,967.00	36,782,900	貸付株式数 2,300株
高周波熱錬	16,000	964.00	15,424,000	貸付株式数 3,500株
東京製鋼	6,300	1,241.00	7,818,300	貸付株式数 2,400株
サンコール	11,600	280.00	3,248,000	貸付株式数 4,600株
モリテックスチル	1,000	158.00	158,000	貸付株式数 400株
パイオラックス	14,200	2,567.00	36,451,400	貸付株式数 700株
エイチワン	10,900	985.00	10,736,500	
日本発条	93,800	1,930.00	181,034,000	貸付株式数 36,200株
中央発條	6,900	1,291.00	8,907,900	
アドバネクス	100	984.00	98,400	
三浦工業	48,200	3,951.00	190,438,200	
タ ク マ	35,100	1,628.00	57,142,800	
テクノプロ・ホールディング グ	61,400	2,914.50	178,950,300	
アトラグループ	400	137.00	54,800	貸付株式数 200株
アイ・アールジャパンHD	5,500	723.00	3,976,500	貸付株式数 2,000株
K e e P e r 技研	6,500	4,705.00	30,582,500	貸付株式数 2,500株
楽待	400	697.00	278,800	貸付株式数 300株
三機サービス	200	984.00	196,800	
G u n o s y	8,400	679.00	5,703,600	貸付株式数 300株
デザインワン・ジャパン	600	112.00	67,200	貸付株式数 200株
イー・ガーディアン	5,000	1,953.00	9,765,000	
リブセンス	600	145.00	87,000	貸付株式数 500株
ジャパンマテリアル	32,300	1,675.00	54,102,500	
ベクトル	14,400	1,029.00	14,817,600	
ウチヤマホールディングス	600	310.00	186,000	貸付株式数 500株 (400株)
チャームケアコーポレー ション	8,800	1,273.00	11,202,400	貸付株式数 3,400株
キャリアリンク	3,900	2,403.00	9,371,700	貸付株式数 800株
I B J	8,100	595.00	4,819,500	貸付株式数 2,200株
アサンテ	5,200	1,642.00	8,538,400	貸付株式数 1,800株
バリューHR	9,500	1,793.00	17,033,500	貸付株式数 3,700株 (400株)
M&Aキャピタルパートナー	8,600	2,758.00	23,718,800	

ライドオンエクスプレスHD	4,300	998.00	4,291,400	
ERIホールディングス	400	2,087.00	834,800	貸付株式数 300株
アビスト	200	3,030.00	606,000	貸付株式数 100株
シグマクシス・ホールディング	30,800	897.00	27,627,600	貸付株式数 5,600株
ウエルグループ	8,800	968.00	8,518,400	
エスクロー A J	1,400	139.00	194,600	
メドピア	8,400	459.00	3,855,600	貸付株式数 3,200株
レアジョブ	300	367.00	110,100	
リクルートホールディングス	824,700	11,080.00	9,137,676,000	
エラン	13,900	749.00	10,411,100	
ツ ガ ミ	22,100	1,385.00	30,608,500	
オークマ	18,200	3,215.00	58,513,000	
芝浦機械	13,400	3,540.00	47,436,000	貸付株式数 5,100株
アマダ	144,300	1,469.50	212,048,850	
アイダエンジニア	23,300	791.00	18,430,300	貸付株式数 6,700株
F U J I	45,200	2,236.50	101,089,800	
牧野フライス	11,500	7,270.00	83,605,000	
オーエスジー	45,800	1,748.50	80,081,300	
ダイジェット	200	699.00	139,800	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	26,000	815.00	21,190,000	
DMG森精機	65,500	2,449.00	160,409,500	
ソディック	27,300	731.00	19,956,300	
ディスコ	50,000	43,360.00	2,168,000,000	
日東工器	4,000	2,533.00	10,132,000	貸付株式数 1,700株
日進工具	8,600	733.00	6,303,800	
パンチ工業	1,200	398.00	477,600	貸付株式数 1,100株
富士ダイス	7,700	781.00	6,013,700	貸付株式数 1,300株
土木管理総合試験	500	305.00	152,500	
日本郵政	1,183,700	1,491.00	1,764,896,700	
ベルシステム24HLDGS	11,300	1,243.00	14,045,900	
鎌倉新書	9,000	503.00	4,527,000	貸付株式数 3,400株 (1,700株)
S M N	300	415.00	124,500	
一蔵	200	389.00	77,800	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	200	673.00	134,600	
エアトリ	7,800	1,178.00	9,188,400	貸付株式数 2,900株
アトラエ	7,400	812.00	6,008,800	貸付株式数 2,800株

ストライク	5,200	3,725.00	19,370,000	貸付株式数	1,800株
ソラスト	29,100	463.00	13,473,300		
セラク	3,200	1,272.00	4,070,400	貸付株式数	1,100株
インソース	22,900	1,130.00	25,877,000		
豊田自動織機	87,700	11,200.00	982,240,000		
豊和工業	700	1,240.00	868,000	貸付株式数	200株
石川製作所	300	1,354.00	406,200	貸付株式数	200株
リケンN P R	13,000	2,528.00	32,864,000	貸付株式数	5,000株
東洋機械金属	1,000	645.00	645,000		
津田駒工業	300	338.00	101,400	貸付株式数	200株
エンシュウ	300	557.00	167,100		
島精機製作所	16,500	1,009.00	16,648,500	貸付株式数	5,400株
オプトラン	17,100	1,897.00	32,438,700	貸付株式数	6,600株
イワキポンプ	6,900	2,486.00	17,153,400	貸付株式数	2,700株
フリーー	9,800	1,091.00	10,691,800		
ヤマシンフィルタ	21,900	657.00	14,388,300	貸付株式数	8,200株
日阪製作所	12,600	1,061.00	13,368,600		
やまびこ	17,000	2,566.00	43,622,000		
野村マイクロ・サイエンス	17,200	1,601.00	27,537,200	貸付株式数	6,700株 (100株)
平田機工	5,000	5,270.00	26,350,000		
P E G A S U S	11,400	428.00	4,879,200		
マルマエ	4,500	1,434.00	6,453,000	貸付株式数	1,700株
タツモ	7,400	2,245.00	16,613,000	貸付株式数	2,900株
ナブテスコ	65,200	2,757.00	179,756,400		
三井海洋開発	13,100	3,170.00	41,527,000		
レオン自動機	10,900	1,424.00	15,521,600		
S M C	31,100	62,340.00	1,938,774,000		
ホソカワミクロン	7,300	4,305.00	31,426,500	貸付株式数	1,800株
ユニオンツール	4,600	4,950.00	22,770,000		
瑞 光	6,600	1,200.00	7,920,000	貸付株式数	2,600株
オイレス工業	14,100	2,485.00	35,038,500		
日精エーエスビー	3,500	4,920.00	17,220,000		
サト - ホールディングス	12,900	2,221.00	28,650,900		
技研製作所	9,800	1,759.00	17,238,200	貸付株式数	3,600株
日本エアーテック	4,900	1,180.00	5,782,000	貸付株式数	1,900株
カ ワ タ	400	796.00	318,400		
日精樹脂工業	6,800	966.00	6,568,800		
オカダアイヨン	400	1,838.00	735,200		

ワイエイシイホールディングス	5,200	1,812.00	9,422,400	貸付株式数 1,800株
小松製作所	511,900	4,173.00	2,136,158,700	
住友重機械	61,500	3,183.00	195,754,500	
日立建機	41,400	3,436.00	142,250,400	貸付株式数 16,000株
日 工	15,400	707.00	10,887,800	
巴工業	4,000	3,750.00	15,000,000	
井関農機	9,700	912.00	8,846,400	貸付株式数 3,800株
T O W A	31,800	1,481.00	47,095,800	貸付株式数 12,600株
丸山製作所	200	1,990.00	398,000	
北川鉄工所	4,100	1,162.00	4,764,200	
シンニッタン	1,400	199.00	278,600	
ローツエ	54,300	1,552.50	84,300,750	貸付株式数 3,400株
タカキタ	400	372.00	148,800	貸付株式数 100株
クボタ	542,900	1,832.00	994,592,800	
荏原実業	5,000	4,135.00	20,675,000	
東洋エンジニア	14,800	684.00	10,123,200	貸付株式数 5,800株
三菱化工機	3,600	3,500.00	12,600,000	
月島ホールディングス	14,000	1,405.00	19,670,000	貸付株式数 5,500株
帝国電機製作所	7,100	2,729.00	19,375,900	
東京機械	300	352.00	105,600	
新東工業	23,100	906.00	20,928,600	
渋谷工業	9,700	3,725.00	36,132,500	
アイチ コーポレーション	17,200	1,395.00	23,994,000	
小森コーポレーション	25,600	1,192.00	30,515,200	
鶴見製作所	7,900	3,120.00	24,648,000	貸付株式数 1,000株
日本ギア工業	500	495.00	247,500	貸付株式数 300株
酒井重工業	4,100	2,315.00	9,491,500	
荏原製作所	213,200	2,565.50	546,964,600	
西島製作所	8,900	2,313.00	20,585,700	貸付株式数 3,500株
北越工業	10,400	1,696.00	17,638,400	貸付株式数 3,900株
ダイキン工業	135,200	17,925.00	2,423,460,000	
オルガノ	16,000	8,260.00	132,160,000	貸付株式数 600株
ト - ヨ - カネツ	3,800	4,160.00	15,808,000	
栗田工業	58,100	5,539.00	321,815,900	貸付株式数 3,000株
椿本チエイン	47,100	1,872.00	88,171,200	
大同工業	500	755.00	377,500	
日 機 装	26,600	962.00	25,589,200	
木村化工機	7,900	903.00	7,133,700	
レイズネクスト	14,600	1,547.00	22,586,200	

アネスト岩田	17,600	1,417.00	24,939,200	
ダイフク	175,300	3,371.00	590,936,300	
サムコ	2,500	2,776.00	6,940,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	700	1,404.00	982,800	
油研工業	200	2,555.00	511,000	
タダノ	59,800	1,141.50	68,261,700	
フジテック	33,400	6,072.00	202,804,800	
C K D	28,700	2,470.00	70,889,000	
平和	34,600	2,142.00	74,113,200	貸付株式数 12,700株
理想科学工業	8,300	3,200.00	26,560,000	貸付株式数 3,000株
S A N K Y O	120,000	2,016.00	241,920,000	
日本金銭機械	12,500	980.00	12,250,000	貸付株式数 4,700株
マースグループHLDGS	7,000	3,160.00	22,120,000	貸付株式数 2,200株
フクシマガリレイ	7,600	5,250.00	39,900,000	
オーイズミ	400	318.00	127,200	貸付株式数 100株
ダイコク電機	4,500	2,865.00	12,892,500	貸付株式数 1,800株
竹内製作所	18,900	4,855.00	91,759,500	貸付株式数 400株
ア マ ノ	29,500	4,308.00	127,086,000	貸付株式数 8,700株
J U K I	16,000	355.00	5,680,000	貸付株式数 5,500株
サンデン	2,000	143.00	286,000	貸付株式数 1,700株
ジャノメ	9,000	981.00	8,829,000	貸付株式数 3,300株
ブラザー工業	138,800	2,730.00	378,924,000	
マックス	12,800	3,360.00	43,008,000	貸付株式数 2,700株
モリタホールディングス	16,200	2,109.00	34,165,800	貸付株式数 1,900株
グローリー	27,200	2,618.00	71,209,600	貸付株式数 9,300株
新晃工業	31,300	1,212.00	37,935,600	貸付株式数 4,500株
大和冷機工業	15,900	1,456.00	23,150,400	貸付株式数 6,200株
セガサミーホールディングス	92,700	2,614.00	242,317,800	貸付株式数 35,800株
T P R	13,200	2,384.00	31,468,800	貸付株式数 1,000株
ツバキ・ナカシマ	25,500	478.00	12,189,000	貸付株式数 10,000株
ホシザキ	66,900	6,363.00	425,684,700	
大豊工業	9,000	570.00	5,130,000	貸付株式数 3,400株
日本精工	192,300	662.90	127,475,670	貸付株式数 10,600株
N T N	245,900	244.10	60,024,190	
ジェイテクト	92,500	1,120.00	103,600,000	
不二越	7,700	3,150.00	24,255,000	貸付株式数 1,300株
ミネベアミツミ	180,600	2,521.00	455,292,600	
日本トムソン	28,300	510.00	14,433,000	

T H K	59,900	3,659.00	219,174,100	
ユーシン精機	9,500	655.00	6,222,500	
前澤給装工業	7,300	1,294.00	9,446,200	
イーグル工業	11,500	1,998.00	22,977,000	貸付株式数 4,100株
前澤工業	700	1,208.00	845,600	
P I L L A R	9,600	4,210.00	40,416,000	
キッツ	34,800	1,105.00	38,454,000	
日 立	2,674,200	3,966.00	10,605,877,200	
三菱電機	1,056,300	2,639.50	2,788,103,850	
富士電機	63,100	8,744.00	551,746,400	
東洋電機製造	400	1,095.00	438,000	
安川電機	112,800	3,939.00	444,319,200	
シンフォニア テクノロジー	10,300	6,630.00	68,289,000	
明 電 舎	17,500	4,335.00	75,862,500	
オリジン	200	1,139.00	227,800	
山洋電気	4,500	8,540.00	38,430,000	貸付株式数 1,700株
デンヨー	7,900	2,826.00	22,325,400	貸付株式数 3,100株
PHCホールディングス	19,400	932.00	18,080,800	貸付株式数 7,600株
KOKUSAI ELECTRIC	72,700	2,270.00	165,029,000	貸付株式数 28,500株
ソシオネクスト	103,500	2,860.50	296,061,750	貸付株式数 10,900株
ベイカレント	77,700	5,257.00	408,468,900	
ORCHESTRA HLDGS	2,300	772.00	1,775,600	
アイモバイル	13,400	543.00	7,276,200	
ディスラプターズ	700	162.00	113,400	貸付株式数 200株
M S - J a p a n	5,800	1,088.00	6,310,400	貸付株式数 500株
船場	300	1,378.00	413,400	
ジャパンエレベーターSHD	41,100	2,784.00	114,422,400	
フルテック	200	1,184.00	236,800	貸付株式数 100株 (100株)
グリーンズ	400	1,877.00	750,800	
ツナググループHLDGS	300	610.00	183,000	貸付株式数 100株
GAMEWITH	500	220.00	110,000	貸付株式数 400株
MS&CONSULTING	100	419.00	41,900	
エル・ティー・エス	1,400	2,322.00	3,250,800	貸付株式数 500株
ミダックホールディングス	6,400	1,528.00	9,779,200	
キュービーネットHLDGS	6,000	1,002.00	6,012,000	貸付株式数 2,300株
オープングループ	16,700	185.00	3,089,500	貸付株式数 5,200株
三桜工業	14,300	713.00	10,195,900	貸付株式数 5,600株
マキタ	129,200	4,741.00	612,537,200	

東芝テック	15,500	3,660.00	56,730,000	
芝浦メカトロニクス	7,500	7,870.00	59,025,000	貸付株式数 2,900株
マブチモーター	45,600	2,228.00	101,596,800	
ニデック	458,600	2,820.00	1,293,252,000	
ユーエムシーエレクトロニクス	6,400	292.00	1,868,800	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,900	1,166.00	5,713,400	貸付株式数 1,500株
東光高岳	5,600	2,047.00	11,463,200	貸付株式数 2,100株
ダブル・スコープ	31,800	259.00	8,236,200	貸付株式数 12,400株
宮越ホールディングス	4,600	1,913.00	8,799,800	貸付株式数 1,700株
ダイヘン	9,800	7,630.00	74,774,000	
ヤーマン	20,200	727.00	14,685,400	貸付株式数 7,900株 (200株)
JVCケンウッド	82,000	1,769.50	145,099,000	
ミマキエンジニアリング	8,600	1,486.00	12,779,600	貸付株式数 3,400株
I - P E X	5,400	2,940.00	15,876,000	
大崎電気	22,200	801.00	17,782,200	
オムロン	95,200	5,034.00	479,236,800	貸付株式数 7,600株
日東工業	14,000	2,825.00	39,550,000	貸付株式数 5,400株
I D E C	15,300	2,351.00	35,970,300	貸付株式数 6,000株
正興電機製作所	400	1,162.00	464,800	貸付株式数 100株
不二電機工業	300	1,099.00	329,700	貸付株式数 200株
ジーエス・ユアサ コーポ	46,400	2,550.00	118,320,000	貸付株式数 17,900株
サクサ	300	2,781.00	834,300	貸付株式数 100株
メルコホールディングス	2,300	2,088.00	4,802,400	
テクノメディカ	2,000	1,792.00	3,584,000	貸付株式数 900株
ダイヤモンドエレクトリク HD	4,100	490.00	2,009,000	貸付株式数 1,400株
日本電気	146,900	13,280.00	1,950,832,000	
富士通	955,600	2,763.00	2,640,322,800	
沖電気	50,300	1,057.00	53,167,100	
電気興業	4,200	1,616.00	6,787,200	
サンケン電気	10,600	6,120.00	64,872,000	貸付株式数 4,100株
ナカヨ	200	1,134.00	226,800	
アイホン	6,200	2,682.00	16,628,400	
ルネサスエレクトロニクス	791,200	2,005.00	1,586,356,000	
セイコーエプソン	133,200	2,810.00	374,292,000	貸付株式数 49,100株
ワコム	73,000	749.00	54,677,000	
アルバック	22,800	6,150.00	140,220,000	

アクセル	5,200	1,201.00	6,245,200	
E I Z O	13,600	2,193.00	29,824,800	貸付株式数 5,300株
ジャパンディスプレイ	61,700	20.00	1,234,000	
日本信号	23,600	912.00	21,523,200	
京三製作所	24,100	517.00	12,459,700	
能美防災	14,000	3,205.00	44,870,000	
ホーチキ	6,600	2,435.00	16,071,000	貸付株式数 1,300株
星和電機	500	529.00	264,500	
エレコム	24,800	1,466.00	36,356,800	
パナソニック ホールディング	1,226,900	1,585.50	1,945,249,950	
シャープ	150,000	995.00	149,250,000	貸付株式数 58,000株
アンリツ	73,200	1,251.50	91,609,800	貸付株式数 28,600株
富士通ゼネラル	29,400	2,248.00	66,091,200	
ソニーグループ	3,600,800	3,291.00	11,850,232,800	
T D K	896,900	2,055.00	1,843,129,500	
帝国通信工業	4,500	2,550.00	11,475,000	貸付株式数 1,600株
タムラ製作所	41,400	499.00	20,658,600	貸付株式数 16,200株
アルプスアルパイン	84,300	1,588.00	133,868,400	貸付株式数 18,400株
池上通信機	400	629.00	251,600	
日本電波工業	9,700	844.00	8,186,800	貸付株式数 3,600株
鈴木	5,500	1,774.00	9,757,000	
メイコー	10,300	9,110.00	93,833,000	
日本トリム	2,300	3,530.00	8,119,000	
フオスタ - 電機	10,600	1,517.00	16,080,200	
S M K	2,500	2,440.00	6,100,000	
ヨコオ	9,200	1,736.00	15,971,200	
ティアック	1,700	78.00	132,600	貸付株式数 1,600株
ホシデン	25,900	2,318.00	60,036,200	貸付株式数 9,800株
ヒロセ電機	15,100	18,710.00	282,521,000	
日本航空電子	27,000	2,785.00	75,195,000	
T O A	10,500	919.00	9,649,500	
マクセル	21,000	1,721.00	36,141,000	
古野電気	12,300	2,678.00	32,939,400	
スミダコーポレーション	14,000	885.00	12,390,000	
アイコム	4,000	2,622.00	10,488,000	貸付株式数 300株
リオン	4,300	2,556.00	10,990,800	
横河電機	113,600	3,448.00	391,692,800	
新電元工業	3,900	2,379.00	9,278,100	貸付株式数 1,500株

アズビル	282,900	1,239.50	350,654,550	
東亜ディーケーケー	500	725.00	362,500	
日本光電工業	92,000	2,141.00	196,972,000	貸付株式数 31,500株
チノー	4,200	2,180.00	9,156,000	貸付株式数 1,300株
共和電業	1,200	426.00	511,200	
日本電子材料	6,300	2,164.00	13,633,200	
堀場製作所	19,500	8,980.00	175,110,000	
アドバンテスト	324,000	8,760.00	2,838,240,000	
小野測器	500	580.00	290,000	貸付株式数 200株
エスベック	9,200	2,645.00	24,334,000	貸付株式数 2,200株
キーエンス	102,900	64,420.00	6,628,818,000	
日置電機	5,400	7,590.00	40,986,000	貸付株式数 2,100株
シスメックス	266,200	2,946.00	784,225,200	
日本マイクロニクス	16,900	4,165.00	70,388,500	貸付株式数 2,900株
メガチップス	7,900	6,410.00	50,639,000	貸付株式数 3,100株
OBARA GROUP	6,400	4,055.00	25,952,000	貸付株式数 2,500株
IMAGICA GROUP	10,300	546.00	5,623,800	貸付株式数 3,400株
澤藤電機	100	903.00	90,300	
デンソー	1,090,700	2,083.50	2,272,473,450	
原田工業	600	518.00	310,800	
コーセル	11,000	1,153.00	12,683,000	貸付株式数 4,100株
イリソ電子工業	10,400	2,672.00	27,788,800	
オプテックスグループ	18,900	1,679.00	31,733,100	
千代田インテグレ	3,600	3,550.00	12,780,000	
レーザーテック	47,100	15,700.00	739,470,000	
スタンレー電気	64,400	2,564.50	165,153,800	貸付株式数 20,700株
ウシオ電機	45,500	2,058.50	93,661,750	
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	941.00	1,129,200	
エノモト	400	1,458.00	583,200	
日本セラミック	9,400	2,612.00	24,552,800	貸付株式数 3,500株
遠藤照明	600	1,430.00	858,000	
古河電池	7,500	1,380.00	10,350,000	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,400	2,308.00	19,387,200	貸付株式数 1,300株
図研	9,400	4,355.00	40,937,000	
日本電子	23,800	5,510.00	131,138,000	貸付株式数 9,500株
カシオ	82,300	1,289.00	106,084,700	
ファナック	497,600	4,051.00	2,015,777,600	
日本シイエムケイ	30,100	395.00	11,889,500	貸付株式数 11,800株

エンプラス	3,000	4,910.00	14,730,000	貸付株式数 1,000株 (100株)
大真空	12,400	536.00	6,646,400	貸付株式数 4,900株
ローム	186,300	1,435.00	267,340,500	貸付株式数 73,000株
浜松ホトニクス	165,000	1,788.00	295,020,000	貸付株式数 13,400株
三井ハイテック	45,500	873.00	39,721,500	貸付株式数 13,400株
新光電気工業	35,700	5,548.00	198,063,600	
京セラ	638,900	1,519.00	970,489,100	
協栄産業	100	2,248.00	224,800	
太陽誘電	45,100	2,185.50	98,566,050	
村田製作所	918,500	2,467.50	2,266,398,750	
双葉電子工業	19,600	498.00	9,760,800	
日東電工	326,100	2,508.50	818,021,850	
北陸電気工業	400	1,596.00	638,400	
東海理化電機	29,000	2,173.00	63,017,000	
ニチコン	27,000	1,025.00	27,675,000	
日本ケミコン	12,700	945.00	12,001,500	貸付株式数 4,700株
K O A	17,100	967.00	16,535,700	貸付株式数 6,700株
三井E & S	55,500	1,676.00	93,018,000	貸付株式数 21,500株
カナデビア	85,000	923.00	78,455,000	貸付株式数 19,300株
三菱重工業	1,816,100	2,257.00	4,098,937,700	
川崎重工業	77,500	6,364.00	493,210,000	
I H I	83,300	8,200.00	683,060,000	
名村造船所	29,300	1,607.00	47,085,100	貸付株式数 11,500株
サノヤスホールディングス	1,600	157.00	251,200	貸付株式数 1,200株
スプリックス	300	891.00	267,300	貸付株式数 100株
マネジメントソリューションズ	5,200	1,674.00	8,704,800	貸付株式数 2,000株
プロレド・パートナーズ	2,500	426.00	1,065,000	貸付株式数 1,000株
AND FACTORY	300	216.00	64,800	
テノ.ホールディングス	100	467.00	46,700	
フロンティア・マネジメント	3,100	765.00	2,371,500	
ピアラ	200	229.00	45,800	
コプロ・ホールディングス	500	1,630.00	815,000	貸付株式数 200株
ギークス	300	384.00	115,200	
アンビスホールディングス	22,600	737.00	16,656,200	貸付株式数 8,800株
カーブスホールディングス	28,900	805.00	23,264,500	
フォーラムエンジニアリング	12,300	1,025.00	12,607,500	

FAST FITNESS JAP	3,600	1,390.00	5,004,000	
日本車輛	4,000	2,222.00	8,888,000	
三菱ロジスネクスト	16,100	1,983.00	31,926,300	貸付株式数 800株
近畿車輛	200	1,395.00	279,000	
一家ホールディングス	300	662.00	198,600	貸付株式数 200株
フルサト・マルカHD	8,700	2,281.00	19,844,700	貸付株式数 3,200株
ヤマエグループHD	11,700	1,898.00	22,206,600	貸付株式数 4,500株
ジャパングラフトホール ディ	900	140.00	126,000	貸付株式数 800株
F P G	36,100	2,760.00	99,636,000	
島根銀行	300	505.00	151,500	貸付株式数 200株
じもとホールディングス	1,000	292.00	292,000	貸付株式数 900株
全国保証	26,500	5,410.00	143,365,000	
めぶきフィナンシャルG	508,400	656.50	333,764,600	貸付株式数 90,000株
ジャパンインベストメントA	16,400	1,016.00	16,662,400	貸付株式数 6,400株
東京きらぼしFG	13,000	4,440.00	57,720,000	貸付株式数 700株
九州フィナンシャルG	178,100	702.50	125,115,250	
かんぽ生命保険	117,800	2,877.50	338,969,500	
ゆうちょ銀行	834,600	1,480.50	1,235,625,300	
あんしん保証	500	153.00	76,500	貸付株式数 100株
富山第一銀行	32,100	1,086.00	34,860,600	貸付株式数 12,400株
コンコルディア・フィナン シャル	538,800	875.70	471,827,160	
ジェイリース	7,600	1,213.00	9,218,800	
西日本フィナンシャルHD	62,300	2,029.00	126,406,700	
イントラスト	400	824.00	329,600	
日本モーゲージサービス	600	424.00	254,400	貸付株式数 100株
C a s a	400	826.00	330,400	貸付株式数 300株
S B I アルヒ	10,300	813.00	8,373,900	貸付株式数 3,700株
プレミアグループ	17,100	2,501.00	42,767,100	
日産自動車	1,285,200	417.60	536,699,520	貸付株式数 503,900株
いすゞ自動車	317,600	2,125.00	674,900,000	
トヨタ自動車	5,466,000	2,726.50	14,903,049,000	
日野自動車	154,700	473.10	73,188,570	
三菱自動車工業	401,000	487.20	195,367,200	貸付株式数 7,300株
エフテック	800	503.00	402,400	貸付株式数 700株
レシップホールディングス	600	474.00	284,400	
G M B	300	997.00	299,100	貸付株式数 200株
ファルテック	200	432.00	86,400	

武蔵精密工業	25,200	4,145.00	104,454,000	
日産車体	15,600	1,104.00	17,222,400	
新明和工業	29,600	1,353.00	40,048,800	
極東開発工業	13,900	2,381.00	33,095,900	貸付株式数 2,700株
トピー工業	8,300	1,921.00	15,944,300	貸付株式数 3,200株
ティラド	2,300	3,565.00	8,199,500	
タチエス	19,000	1,719.00	32,661,000	貸付株式数 7,400株
N O K	40,000	2,445.00	97,800,000	貸付株式数 15,000株
フタバ産業	31,000	690.00	21,390,000	貸付株式数 11,200株
カヤバ	17,500	2,815.00	49,262,500	
市光工業	18,500	392.00	7,252,000	
大同メタル工業	20,000	472.00	9,440,000	
プレス工業	40,100	528.00	21,172,800	貸付株式数 7,700株
ミクニ	1,400	313.00	438,200	
太平洋工業	23,600	1,292.00	30,491,200	貸付株式数 9,200株
河西工業	1,900	158.00	300,200	貸付株式数 1,700株
アイシン	217,800	1,729.00	376,576,200	
マ ツ ダ	315,800	1,011.00	319,273,800	
今仙電機製作所	700	498.00	348,600	貸付株式数 600株
本田技研	2,436,200	1,244.50	3,031,850,900	
スズキ	830,900	1,783.00	1,481,494,700	
SUBARU	310,000	2,574.50	798,095,000	
安永	600	469.00	281,400	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	434,200	1,376.00	597,459,200	貸付株式数 38,300株
小糸製作所	106,500	2,003.50	213,372,750	
T B K	1,300	261.00	339,300	貸付株式数 500株
エクセディ	16,800	4,620.00	77,616,000	
ミツバ	19,200	885.00	16,992,000	
豊田合成	29,500	2,750.00	81,125,000	
愛三工業	19,500	1,585.00	30,907,500	
盟和産業	200	1,290.00	258,000	
日本プラスト	900	351.00	315,900	
ヨ ロ ズ	10,600	1,161.00	12,306,600	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	18,000	3,190.00	57,420,000	
新家工業	200	4,910.00	982,000	
シマノ	44,700	20,900.00	934,230,000	
テイ・エス テック	41,900	1,751.00	73,366,900	貸付株式数 900株
3 3 F G	9,100	2,199.00	20,010,900	貸付株式数 3,500株
第四北越フィナンシャルG	31,800	2,870.00	91,266,000	貸付株式数 2,400株

ひろぎんHLDGS	142,500	1,160.00	165,300,000	貸付株式数	53,700株
マーキュリアホールディングス	500	828.00	414,000	貸付株式数	300株 (300株)
おきなわF G	8,000	2,620.00	20,960,000		
ダイレクトマーケティングミクス	12,800	281.00	3,596,800		
ポピンズ	1,900	1,222.00	2,321,800		
LITALICO	9,600	870.00	8,352,000	貸付株式数	700株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,554.00	310,800	貸付株式数	100株
十六F G	14,200	4,275.00	60,705,000		
北國F H D	9,900	5,330.00	52,767,000	貸付株式数	3,800株
ネットプロH D	33,800	510.00	17,238,000	貸付株式数	300株
プロクレアホールディングス	11,600	1,694.00	19,650,400	貸付株式数	4,500株
あいちフィナンシャルグル	18,900	2,396.00	45,284,400	貸付株式数	6,600株
ジャムコ	6,200	1,471.00	9,120,200	貸付株式数	2,400株
小 野 建	11,900	1,451.00	17,266,900	貸付株式数	4,600株
はるやまHLDGS	500	610.00	305,000	貸付株式数	400株
南 陽	500	1,093.00	546,500		
ノ ジ マ	35,500	2,264.00	80,372,000	貸付株式数	11,300株
佐島電機	7,600	1,725.00	13,110,000		
カップ・クリエイト	17,100	1,601.00	27,377,100	貸付株式数	6,700株
エコートレーディング	300	916.00	274,800	貸付株式数	100株
伯東	6,200	4,170.00	25,854,000	貸付株式数	2,300株
コンドーテック	8,200	1,339.00	10,979,800	貸付株式数	1,000株
中山福	600	361.00	216,600		
ライトオン	900	181.00	162,900		
ナガイレーベン	13,800	2,114.00	29,173,200	貸付株式数	5,400株
三菱食品	10,100	4,890.00	49,389,000		
良品計画	129,600	3,410.00	441,936,000		
パリミキホールディングス	1,600	286.00	457,600		
松田産業	8,300	3,095.00	25,688,500		
第一興商	42,100	1,839.50	77,442,950		
メディパルHD	118,000	2,369.00	279,542,000		
アドヴァングループ	9,200	933.00	8,583,600	貸付株式数	3,500株
S P K	4,400	2,060.00	9,064,000		
萩原電気HLDGS	4,700	3,110.00	14,617,000		
アルビス	3,600	2,619.00	9,428,400		
アズワン	33,700	2,758.50	92,961,450	貸付株式数	5,800株

スズデン	4,600	1,821.00	8,376,600	
尾家産業	300	2,000.00	600,000	
シモジマ	7,300	1,296.00	9,460,800	
ドウシシャ	10,100	2,153.00	21,745,300	貸付株式数 2,400株
小津産業	300	1,650.00	495,000	貸付株式数 200株
コナカ	1,400	226.00	316,400	
高速	6,500	2,356.00	15,314,000	
ハウス ローゼ	200	1,439.00	287,800	
G-7ホールディングス	11,900	1,421.00	16,909,900	
たけびし	4,600	2,000.00	9,200,000	貸付株式数 1,700株
イオン北海道	26,400	897.00	23,680,800	貸付株式数 10,500株
コジマ	21,000	1,110.00	23,310,000	貸付株式数 8,100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	12,000	3,540.00	42,480,000	
ネットワンシステムズ	41,800	4,480.00	187,264,000	
エコス	4,000	2,024.00	8,096,000	貸付株式数 1,400株
ワタミ	13,100	958.00	12,549,800	貸付株式数 4,400株
マルシェ	400	201.00	80,400	貸付株式数 300株
リックス	2,500	2,795.00	6,987,500	
システムソフト	35,200	57.00	2,006,400	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	219,700	4,218.00	926,694,600	
丸文	9,700	1,028.00	9,971,600	
西松屋チェーン	24,100	2,277.00	54,875,700	貸付株式数 8,200株
ゼンショーホールディングス	61,800	9,343.00	577,397,400	
ハピネット	8,300	4,735.00	39,300,500	貸付株式数 3,400株
幸楽苑	8,000	1,042.00	8,336,000	貸付株式数 3,100株
ハークスレイ	400	676.00	270,400	
橋本総業HLDGS	4,200	1,275.00	5,355,000	貸付株式数 1,500株
日本ライフライン	29,100	1,330.00	38,703,000	
サイゼリヤ	16,100	5,560.00	89,516,000	
タカショー	8,700	448.00	3,897,600	貸付株式数 3,300株
V Tホールディングス	42,400	491.00	20,818,400	
アルゴグラフィックス	9,500	5,120.00	48,640,000	
魚力	3,800	2,440.00	9,272,000	貸付株式数 1,300株
I D O M	37,000	1,096.00	40,552,000	
日本エム・ディ・エム	8,100	587.00	4,754,700	
ポプラ	400	206.00	82,400	貸付株式数 300株 (100株)

フジ・コーポレーション	4,900	2,114.00	10,358,600	
ユナイテッドアローズ	11,600	2,655.00	30,798,000	
進和	6,600	2,908.00	19,192,800	貸付株式数 2,300株
エスケイジャパン	300	704.00	211,200	
ダイトロン	4,700	2,711.00	12,741,700	
ハイデイ日高	17,600	2,768.00	48,716,800	貸付株式数 5,900株
シークス	15,500	1,128.00	17,484,000	貸付株式数 5,800株
京都きもの友禅HD	600	84.00	50,400	貸付株式数 200株
コロワイド	61,400	1,713.50	105,208,900	貸付株式数 24,000株
田中商事	300	677.00	203,100	
オーハシテクニカ	5,200	2,014.00	10,472,800	
壱番屋	43,000	1,008.00	43,344,000	貸付株式数 16,800株
白銅	3,100	2,389.00	7,405,900	貸付株式数 1,000株
トップカルチャー	400	138.00	55,200	貸付株式数 200株
P L A N T	300	1,579.00	473,700	貸付株式数 200株
スギホールディングス	58,300	2,490.00	145,167,000	
ダイコー通産	100	1,330.00	133,000	
薬王堂ホールディングス	5,300	1,978.00	10,483,400	
島津製作所	148,000	4,460.00	660,080,000	貸付株式数 100株
J M S	9,300	430.00	3,999,000	
クボテック	400	212.00	84,800	貸付株式数 300株
長野計器	6,700	2,472.00	16,562,400	貸付株式数 2,600株
ブイ・テクノロジー	5,000	2,229.00	11,145,000	貸付株式数 1,900株
スター精密	17,500	1,881.00	32,917,500	
東京計器	7,200	3,220.00	23,184,000	貸付株式数 2,800株
愛知時計	4,800	1,984.00	9,523,200	
インターアクション	6,200	984.00	6,100,800	
オーバル	1,100	350.00	385,000	貸付株式数 1,000株
東京精密	21,100	7,317.00	154,388,700	
マニー	41,200	1,781.50	73,397,800	貸付株式数 15,900株
ニコン	162,200	1,649.00	267,467,800	
トプコン	58,400	2,794.00	163,169,600	
オリンパス	588,700	2,348.50	1,382,561,950	
理研計器	14,500	3,880.00	56,260,000	貸付株式数 5,700株
SCREENホールディングス	43,000	9,230.00	396,890,000	
キヤノン電子	9,700	2,464.00	23,900,800	
タムロン	14,200	4,370.00	62,054,000	
H O Y A	200,900	20,140.00	4,046,126,000	
シ ー ド	900	458.00	412,200	

ノーリツ銅機	9,700	4,875.00	47,287,500	
A&Dホロンホールディングス	12,800	2,005.00	25,664,000	
朝日インテック	125,300	2,510.50	314,565,650	
キヤノン	512,800	5,024.00	2,576,307,200	
リ コ ー	270,800	1,762.50	477,285,000	
シチズン時計	94,600	904.00	85,518,400	
リズム	300	3,795.00	1,138,500	貸付株式数 200株
大研医器	1,000	516.00	516,000	
メニコン	38,300	1,465.00	56,109,500	貸付株式数 15,000株
シンシア	100	531.00	53,100	
K Y O R I T S U	1,600	164.00	262,400	
中本パックス	400	1,770.00	708,000	
パラマウントベッドHD	23,700	2,640.00	62,568,000	貸付株式数 3,700株
トランザクション	6,800	2,206.00	15,000,800	貸付株式数 2,500株
粧美堂	300	509.00	152,700	貸付株式数 200株
ニホンフラッシュ	8,500	796.00	6,766,000	貸付株式数 2,000株
前田工織	18,300	1,788.00	32,720,400	
永大産業	1,300	206.00	267,800	
アートネイチャー	10,500	810.00	8,505,000	
フルヤ金属	9,800	3,520.00	34,496,000	貸付株式数 3,800株
バンダイナムコHLDGS	279,100	3,713.00	1,036,298,300	
アイフィスジャパン	300	562.00	168,600	貸付株式数 100株
S H O E I	28,900	2,254.00	65,140,600	貸付株式数 100株
フランスベッドHLDGS	14,700	1,276.00	18,757,200	貸付株式数 5,800株
マーベラス	19,300	579.00	11,174,700	
パイロットコーポレーション	16,100	4,775.00	76,877,500	貸付株式数 6,200株
萩原工業	6,900	1,637.00	11,295,300	貸付株式数 2,200株
エイベックス	19,400	1,478.00	28,673,200	
フジシールインターナショナル	23,200	2,511.00	58,255,200	貸付株式数 1,800株
タカラトミー	43,200	4,590.00	198,288,000	貸付株式数 16,500株
広済堂ホールディングス	38,700	511.00	19,775,700	貸付株式数 12,800株
エステールホールディングス	200	601.00	120,200	
レック	13,200	1,268.00	16,737,600	貸付株式数 5,100株
タカノ	400	694.00	277,600	
三光合成	12,900	587.00	7,572,300	
プロネクサス	10,600	1,284.00	13,610,400	
ホクシン	900	101.00	90,900	

ウッドワン	400	874.00	349,600	貸付株式数	300株
き も と	1,800	278.00	500,400		
TOPPANホールディングス	134,800	4,182.00	563,733,600		
大日本印刷	209,000	2,236.50	467,428,500		
共同印刷	2,900	3,930.00	11,397,000		
N I S S H A	17,600	1,554.00	27,350,400		
光村印刷	100	1,403.00	140,300		
Z A C R O S	8,100	4,080.00	33,048,000	貸付株式数	3,000株
ヴィア・ホールディングス	2,300	131.00	301,300	貸付株式数	900株
TAKARA & COMPANY	6,100	2,965.00	18,086,500		
前澤化成工業	7,200	1,732.00	12,470,400	貸付株式数	2,700株
未来工業	3,700	3,705.00	13,708,500	貸付株式数	1,400株
アシックス	379,600	3,045.00	1,155,882,000		
ツ ツ ミ	2,400	2,100.00	5,040,000		
ウェーブロックHLDGS	400	645.00	258,000		
ジェイ エス ピー	8,500	2,092.00	17,782,000	貸付株式数	3,300株
ニ チ ハ	12,900	2,928.00	37,771,200	貸付株式数	5,000株
ローランド	7,600	3,960.00	30,096,000		
エフピコ	22,800	2,861.00	65,230,800		
小松ウオール工業	7,500	1,503.00	11,272,500	貸付株式数	2,600株
ヤマハ	187,900	1,069.50	200,959,050		
河合楽器	3,100	2,966.00	9,194,600		
クリナップ	9,900	655.00	6,484,500		
ビジョン	65,500	1,472.00	96,416,000		
天馬	8,600	2,973.00	25,567,800	貸付株式数	2,100株
キングジム	9,100	870.00	7,917,000	貸付株式数	3,400株 (200株)
象印マホービン	30,700	1,816.00	55,751,200	貸付株式数	12,000株
リンテック	20,600	3,025.00	62,315,000	貸付株式数	5,300株
信越ポリマー	22,200	1,573.00	34,920,600		
東 リ	2,900	464.00	1,345,600		
イトーキ	20,500	1,660.00	34,030,000		
任 天 堂	649,200	9,265.00	6,014,838,000		
三菱鉛筆	14,200	2,406.00	34,165,200	貸付株式数	2,500株
松 風	10,300	2,129.00	21,928,700		
タカラスタンダ - ド	23,600	1,668.00	39,364,800		
コ ク ヨ	51,400	2,759.00	141,812,600		
ナカバヤシ	11,000	507.00	5,577,000		
ニ フ コ	38,600	3,768.00	145,444,800		

立川ブラインド	4,700	1,320.00	6,204,000	貸付株式数	1,800株
グローブライド	10,200	1,876.00	19,135,200	貸付株式数	3,000株
オカムラ	31,000	2,057.00	63,767,000		
バルカー	7,900	3,170.00	25,043,000		
MUTOHホールディングス	200	2,435.00	487,000		
伊 藤 忠	731,300	7,623.00	5,574,699,900		
丸 紅	894,000	2,235.00	1,998,090,000		
スクロール	16,300	1,073.00	17,489,900		
高 島	800	1,237.00	989,600	貸付株式数	600株
ヨンドシーホールディングス	10,400	1,857.00	19,312,800	貸付株式数	3,800株
三陽商会	5,300	2,816.00	14,924,800		
長瀬産業	48,600	3,153.00	153,235,800		
ナイガイ	400	231.00	92,400	貸付株式数	300株
蝶 理	5,800	3,845.00	22,301,000	貸付株式数	1,900株
豊田通商	326,700	2,598.50	848,929,950		
オンワ - ドホールディングス	66,800	555.00	37,074,000		
三共生興	14,100	583.00	8,220,300		
兼 松	45,500	2,563.50	116,639,250		
美 津 濃	10,200	9,120.00	93,024,000		
ツカモトコーポレーション	200	1,074.00	214,800		
ルックホールディングス	3,300	2,446.00	8,071,800	貸付株式数	1,200株
三井物産	1,598,400	3,171.00	5,068,526,400		
日本紙パルプ	51,900	668.00	34,669,200		
東京エレクトロン	217,600	23,785.00	5,175,616,000		
カメイ	11,500	1,901.00	21,861,500		
東都水産	100	5,500.00	550,000		
OUGホールディングス	200	2,616.00	523,200		
スターゼン	7,500	2,947.00	22,102,500		
セイコーグループ	15,900	4,760.00	75,684,000		
山 善	36,600	1,366.00	49,995,600	貸付株式数	13,600株
椿本興業	6,000	2,023.00	12,138,000	貸付株式数	2,400株
住友商事	652,000	3,286.00	2,142,472,000		
B I P R O G Y	34,800	4,621.00	160,810,800		
内田洋行	4,400	6,570.00	28,908,000		
三菱商事	2,010,600	2,505.00	5,036,553,000		
第一実業	10,200	2,770.00	28,254,000	貸付株式数	3,200株
キヤノンマーケティングJPN	21,400	5,118.00	109,525,200		
西華産業	5,100	4,875.00	24,862,500	貸付株式数	2,000株

佐藤商事	7,500	1,405.00	10,537,500	
東京産業	10,900	710.00	7,739,000	貸付株式数 3,200株
ユアサ商事	9,300	4,250.00	39,525,000	
神鋼商事	2,400	6,100.00	14,640,000	
トルク	800	230.00	184,000	
阪和興業	17,900	4,725.00	84,577,500	
正栄食品	7,200	3,970.00	28,584,000	貸付株式数 2,800株 (1,100株)
カナデン	8,100	1,459.00	11,817,900	
R Y O D E N	8,800	2,376.00	20,908,800	
ニプロ	85,700	1,439.00	123,322,300	貸付株式数 29,900株
岩谷産業	108,100	1,764.50	190,742,450	貸付株式数 41,800株
ナイス	2,500	1,610.00	4,025,000	
ニチモウ	400	1,942.00	776,800	
極東貿易	6,500	1,556.00	10,114,000	貸付株式数 2,500株
アステナホールディングス	20,500	472.00	9,676,000	
三愛オブリ	25,400	1,825.00	46,355,000	
稲畑産業	29,400	3,190.00	93,786,000	
G S I クレオス	5,800	2,152.00	12,481,600	貸付株式数 2,100株
明和産業	15,500	633.00	9,811,500	
クワザワホールディングス	400	668.00	267,200	貸付株式数 300株
ゴ - ルドウィン	18,200	8,342.00	151,824,400	貸付株式数 3,100株
ユニ・チャ - ム	214,800	3,925.00	843,090,000	
キ ン グ	400	719.00	287,600	
ワ キ タ	16,000	1,587.00	25,392,000	貸付株式数 6,200株
ヤマトインタ - ナショナル	1,000	331.00	331,000	貸付株式数 300株
東邦ホールディングス	29,400	4,232.00	124,420,800	貸付株式数 300株
サンゲツ	27,300	2,788.00	76,112,400	
ミツウロコグループ	13,800	1,765.00	24,357,000	
シナネンホールディングス	3,000	6,350.00	19,050,000	貸付株式数 1,200株
伊藤忠エネクス	26,900	1,609.00	43,282,100	
サンリオ	88,400	5,031.00	444,740,400	貸付株式数 500株
サンワ テクノス	4,900	2,158.00	10,574,200	
新光商事	14,600	944.00	13,782,400	貸付株式数 5,700株
トーホー	4,700	2,839.00	13,343,300	貸付株式数 1,800株 (100株)
三信電気	4,300	1,863.00	8,010,900	
東陽テクニカ	10,000	1,409.00	14,090,000	
モスフード サービス	16,000	3,730.00	59,680,000	貸付株式数 4,000株

加賀電子	22,100	2,870.00	63,427,000	貸付株式数	2,500株
都築電気	6,200	2,749.00	17,043,800		
ソーダニツカ	10,600	1,161.00	12,306,600		
立花エレクトック	6,500	2,577.00	16,750,500		
木曽路	16,500	2,114.00	34,881,000	貸付株式数	6,200株
SRSホールディングス	17,900	1,173.00	20,996,700	貸付株式数	7,000株
千 趣 会	22,000	298.00	6,556,000	貸付株式数	900株
タカキュー	900	126.00	113,400	貸付株式数	700株
リテールパートナーズ	16,000	1,263.00	20,208,000	貸付株式数	6,300株
上新電機	10,800	2,263.00	24,440,400	貸付株式数	4,200株
日本瓦斯	52,000	2,130.00	110,760,000		
ロイヤルホールディングス	19,200	2,404.00	46,156,800	貸付株式数	7,500株
東 天 紅	100	855.00	85,500		
チヨダ	10,400	1,355.00	14,092,000		
ライフコーポレーション	11,300	3,420.00	38,646,000		
リンガーハット	14,100	2,226.00	31,386,600	貸付株式数	5,300株
M r M a x H D	13,700	691.00	9,466,700		
テンアライド	1,900	273.00	518,700	貸付株式数	1,600株
AOKIホールディングス	23,400	1,269.00	29,694,600	貸付株式数	6,200株
オークワ	17,100	895.00	15,304,500	貸付株式数	6,500株
コメリ	14,700	3,280.00	48,216,000		
青山商事	23,300	2,263.00	52,727,900		
しまむら	25,600	8,530.00	218,368,000	貸付株式数	3,100株
はせがわ	600	302.00	181,200		
高 島 屋	151,000	1,252.00	189,052,000		
松 屋	18,300	972.00	17,787,600	貸付株式数	7,200株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	52,900	2,166.00	114,581,400	貸付株式数	20,400株
近鉄百貨店	6,100	2,169.00	13,230,900	貸付株式数	2,400株
丸井グループ	72,200	2,522.50	182,124,500		
クレディセゾン	64,200	3,538.00	227,139,600	貸付株式数	8,100株
アクシアル リテイリング	29,200	890.00	25,988,000		
井 筒 屋	500	430.00	215,000	貸付株式数	200株
イオン	402,200	3,730.00	1,500,206,000		
イ ズ ミ	16,400	3,180.00	52,152,000		
フオーバル	4,300	1,358.00	5,839,400	貸付株式数	1,000株
平 和 堂	17,700	2,287.00	40,479,900	貸付株式数	6,500株
フ ジ	19,800	2,053.00	40,649,400	貸付株式数	7,500株
ヤオコー	12,800	9,196.00	117,708,800	貸付株式数	3,800株

ゼビオホールディングス	14,800	1,140.00	16,872,000	
ケーズホールディングス	73,100	1,377.50	100,695,250	貸付株式数 21,200株
P A L T A C	17,000	4,305.00	73,185,000	貸付株式数 3,900株
三谷産業	18,800	320.00	6,016,000	
OLYMPICグループ	600	459.00	275,400	貸付株式数 500株
日産東京販売H D	1,700	497.00	844,900	
あおぞら銀行	69,900	2,397.00	167,550,300	貸付株式数 27,400株
三菱UFJフィナンシャルG	6,641,600	1,812.50	12,037,900,000	
りそなホールディングス	1,250,700	1,148.50	1,436,428,950	
三井住友トラストグルー	360,600	3,696.00	1,332,777,600	
三井住友フィナンシャルG	2,112,700	3,659.00	7,730,369,300	
千葉銀行	313,600	1,223.00	383,532,800	
群馬銀行	175,900	1,100.00	193,490,000	貸付株式数 46,700株
武蔵野銀行	15,400	2,978.00	45,861,200	貸付株式数 1,400株
千葉興業銀行	23,900	1,378.00	32,934,200	貸付株式数 9,400株
筑波銀行	44,400	244.00	10,833,600	貸付株式数 17,200株
七十七銀行	32,400	4,542.00	147,160,800	
秋田銀行	6,800	2,199.00	14,953,200	
山形銀行	11,200	969.00	10,852,800	貸付株式数 1,900株
岩手銀行	6,400	2,667.00	17,068,800	
東邦銀行	87,600	285.00	24,966,000	貸付株式数 32,900株
東北銀行	600	1,153.00	691,800	
ふくおかフィナンシャルG	88,200	4,012.00	353,858,400	
スルガ銀行	63,000	1,108.00	69,804,000	
八十二銀行	237,000	1,010.00	239,370,000	
山梨中央銀行	11,300	1,811.00	20,464,300	
大垣共立銀行	19,300	1,859.00	35,878,700	
福井銀行	9,000	1,797.00	16,173,000	貸付株式数 2,600株
清水銀行	4,000	1,436.00	5,744,000	貸付株式数 1,600株
富山銀行	200	1,536.00	307,200	貸付株式数 100株
滋賀銀行	15,300	3,780.00	57,834,000	
南都銀行	15,200	3,225.00	49,020,000	貸付株式数 3,500株
百五銀行	95,400	616.00	58,766,400	貸付株式数 37,300株
紀陽銀行	36,300	2,110.00	76,593,000	
ほくほくフィナンシャルG	57,000	1,919.50	109,411,500	貸付株式数 22,000株
山陰合同銀行	63,300	1,238.00	78,365,400	貸付株式数 7,000株
鳥取銀行	400	1,210.00	484,000	貸付株式数 100株
百十四銀行	9,900	3,265.00	32,323,500	
四国銀行	14,900	1,103.00	16,434,700	

阿波銀行	14,200	2,704.00	38,396,800	
大分銀行	6,100	3,110.00	18,971,000	
宮崎銀行	6,600	3,030.00	19,998,000	
佐賀銀行	5,900	2,137.00	12,608,300	
琉球銀行	23,200	1,032.00	23,942,400	貸付株式数 9,000株
セブン銀行	362,900	315.70	114,567,530	
みずほフィナンシャルG	1,367,000	3,779.00	5,165,893,000	
高知銀行	400	808.00	323,200	
山口フィナンシャルG	99,300	1,622.00	161,064,600	貸付株式数 12,700株
芙蓉総合リース	9,300	11,400.00	106,020,000	貸付株式数 3,300株
みずほリース	76,100	1,003.00	76,328,300	
東京センチュリー	75,700	1,532.00	115,972,400	貸付株式数 9,800株
SBIホールディングス	163,000	4,056.00	661,128,000	
日本証券金融	37,200	2,074.00	77,152,800	貸付株式数 7,600株
アイフル	167,800	322.00	54,031,600	
日本アジア投資	700	205.00	143,500	貸付株式数 600株
名古屋銀行	6,300	6,310.00	39,753,000	
北洋銀行	138,100	467.00	64,492,700	貸付株式数 44,700株
大光銀行	400	1,426.00	570,400	貸付株式数 200株
愛媛銀行	14,800	1,096.00	16,220,800	貸付株式数 4,200株
トマト銀行	400	1,186.00	474,400	貸付株式数 100株
京葉銀行	45,600	801.00	36,525,600	貸付株式数 6,100株
栃木銀行	46,400	283.00	13,131,200	
北日本銀行	3,600	2,764.00	9,950,400	
東和銀行	18,600	632.00	11,755,200	
福島銀行	1,200	220.00	264,000	貸付株式数 1,100株
大東銀行	600	719.00	431,400	貸付株式数 100株
リコーリース	9,600	5,110.00	49,056,000	貸付株式数 3,700株
イオンフィナンシャルサー ビス	58,200	1,254.50	73,011,900	
ア コ ム	241,200	379.40	91,511,280	
ジャックス	12,100	3,635.00	43,983,500	貸付株式数 4,700株
オ リ コ	33,100	806.00	26,678,600	貸付株式数 12,900株
オリックス	607,300	3,311.00	2,010,770,300	
三菱HCキャピタル	507,600	1,006.50	510,899,400	
ジャフコ グループ	30,200	2,194.00	66,258,800	貸付株式数 10,800株
九州 リースサービス	400	1,019.00	407,600	
トモニホールディングス	96,900	441.00	42,732,900	貸付株式数 4,400株
大和証券G本社	724,200	1,020.50	739,046,100	

野村ホールディングス	1,703,100	904.00	1,539,602,400	
岡三証券グループ	80,100	636.00	50,943,600	貸付株式数 17,200株
丸三証券	33,700	986.00	33,228,200	貸付株式数 13,200株
東洋証券	30,200	561.00	16,942,200	
東海東京HD	120,400	482.00	58,032,800	
光世証券	300	426.00	127,800	貸付株式数 200株
水戸証券	27,800	571.00	15,873,800	
いちよし証券	20,500	994.00	20,377,000	貸付株式数 800株
松井証券	69,900	811.00	56,688,900	
SOMPOホールディングス	495,000	4,111.00	2,034,945,000	
日本取引所グループ	602,500	1,796.50	1,082,391,250	
マネックスG	99,200	985.00	97,712,000	
極東証券	12,600	1,429.00	18,005,400	貸付株式数 4,800株
岩井コスモホールディング	11,600	2,296.00	26,633,600	
アイザワ証券グループ	14,600	1,722.00	25,141,200	貸付株式数 5,500株
フィデアホール	10,400	1,367.00	14,216,800	貸付株式数 4,100株
池田泉州HD	140,500	396.00	55,638,000	貸付株式数 32,900株
アニコムホールディングス	34,100	645.00	21,994,500	
MS&AD	742,000	3,347.00	2,483,474,000	
スパークス・グループ	11,300	1,495.00	16,893,500	
小林洋行	500	278.00	139,000	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	476,200	4,169.00	1,985,277,800	
東京海上HD	988,600	5,452.00	5,389,847,200	
アドバンテッジリスクマネ	600	642.00	385,200	貸付株式数 200株
イー・ギャランティ	16,600	1,764.00	29,282,400	貸付株式数 3,800株
アサックス	400	701.00	280,400	貸付株式数 100株
NECキャピタルソリューション	5,000	3,750.00	18,750,000	
T&Dホールディングス	271,800	2,750.50	747,585,900	
アドバンスクリエイト	7,800	474.00	3,697,200	貸付株式数 3,100株
三井不動産	1,405,400	1,239.50	1,741,993,300	
三菱地所	586,500	2,120.00	1,243,380,000	
平和不動産	16,400	4,185.00	68,634,000	
東京建物	88,500	2,501.00	221,338,500	
京阪神ビルディング	17,000	1,605.00	27,285,000	
住友不動産	164,700	4,693.00	772,937,100	
太平洋興発	400	705.00	282,000	貸付株式数 200株
テーオーシー	18,000	645.00	11,610,000	
スターツコーポレーション	16,300	3,645.00	59,413,500	

フジ住宅	12,600	758.00	9,550,800	
空港施設	14,100	569.00	8,022,900	
明和地所	8,100	1,005.00	8,140,500	貸付株式数 2,800株
ゴールドクレスト	6,900	3,300.00	22,770,000	貸付株式数 1,500株
リログループ	58,800	1,888.50	111,043,800	
エスリード	4,800	4,360.00	20,928,000	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	16,100	520.00	8,372,000	貸付株式数 5,200株
日本エスコン	26,500	932.00	24,698,000	貸付株式数 10,400株
MIRARTHホールディング	59,300	496.00	29,412,800	
A V A N T I A	600	781.00	468,600	貸付株式数 500株
イオンモール	61,200	2,019.00	123,562,800	
毎日コムネット	400	717.00	286,800	貸付株式数 100株
ファースト住建	500	1,007.00	503,500	貸付株式数 400株
ランド	652,400	8.00	5,219,200	貸付株式数 256,200株
カチタス	27,200	2,165.00	58,888,000	
東祥	8,800	625.00	5,500,000	
トーセイ	16,800	2,522.00	42,369,600	貸付株式数 2,700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	16,900	1,871.00	31,619,900	
インテリックス	300	770.00	231,000	
ランドビジネス	400	214.00	85,600	貸付株式数 300株
サンネクスタグループ	400	1,017.00	406,800	貸付株式数 100株
グランディハウス	9,300	559.00	5,198,700	貸付株式数 2,900株
東武鉄道	108,300	2,454.00	265,768,200	
相鉄ホールディングス	34,000	2,436.50	82,841,000	貸付株式数 8,200株
東急	288,300	1,684.50	485,641,350	
京浜急行	127,200	1,269.50	161,480,400	
小田急電鉄	170,000	1,403.50	238,595,000	貸付株式数 65,700株
京王電鉄	54,400	3,855.00	209,712,000	
京成電鉄	59,700	4,112.00	245,486,400	貸付株式数 24,400株
富士急行	12,700	2,235.00	28,384,500	貸付株式数 500株
東日本旅客鉄道	567,000	2,777.50	1,574,842,500	
西日本旅客鉄道	262,700	2,750.00	722,425,000	
東海旅客鉄道	396,100	2,882.50	1,141,758,250	
東京地下鉄	171,900	1,583.50	272,203,650	
西武ホールディングス	111,900	3,347.00	374,529,300	貸付株式数 22,000株
鴻池運輸	17,500	2,954.00	51,695,000	貸付株式数 1,600株
西日本鉄道	29,800	2,160.50	64,382,900	貸付株式数 11,400株
ハマキョウレックス	35,200	1,304.00	45,900,800	

サカイ引越センター	13,000	2,437.00	31,681,000	
近鉄グループHLDGS	110,000	3,188.00	350,680,000	
阪急阪神HLDGS	136,900	4,077.00	558,141,300	
南海電鉄	45,800	2,373.50	108,706,300	貸付株式数 10,300株
京阪ホールディングス	56,600	3,303.00	186,949,800	貸付株式数 7,500株
神戸電鉄	2,800	2,311.00	6,470,800	貸付株式数 1,000株
名古屋鉄道	113,500	1,695.50	192,439,250	貸付株式数 33,000株
山陽電鉄	7,700	2,009.00	15,469,300	貸付株式数 2,700株
トランコム	1,200	10,270.00	12,324,000	
ヤマトホールディングス	124,800	1,764.50	220,209,600	
山 九	24,800	5,341.00	132,456,800	
日 新	7,000	4,435.00	31,045,000	
丸 運	700	419.00	293,300	貸付株式数 600株
丸全昭和運輸	6,400	5,930.00	37,952,000	貸付株式数 2,100株
センコーグループHLDGS	60,400	1,517.00	91,626,800	
トナミホールディングス	2,300	5,840.00	13,432,000	貸付株式数 800株
ニッコンホールディングス	58,400	2,006.00	117,150,400	
日石輸送	100	2,767.00	276,700	
福山通運	11,000	3,680.00	40,480,000	
セイノーホールディングス	50,500	2,400.50	121,225,250	貸付株式数 21,800株
神奈川中央交通	2,900	3,765.00	10,918,500	
AZ-COM丸和ホールディ	31,900	1,119.00	35,696,100	貸付株式数 12,200株
日本郵船	212,700	5,030.00	1,069,881,000	
商船三井	195,200	5,231.00	1,021,091,200	
川崎汽船	233,600	2,092.50	488,808,000	貸付株式数 91,600株
NSユニテッド海運	6,500	3,870.00	25,155,000	貸付株式数 2,400株
明海グループ	1,200	676.00	811,200	貸付株式数 900株
飯野海運	37,700	1,120.00	42,224,000	貸付株式数 1,800株
共栄タンカー	200	1,038.00	207,600	貸付株式数 100株
九州旅客鉄道	78,600	3,887.00	305,518,200	
SGホールディングス	172,400	1,478.00	254,807,200	貸付株式数 9,100株
NIPPON EXPRESS	36,800	7,265.00	267,352,000	
ID&E ホールディングス	6,000	6,480.00	38,880,000	
日本航空	235,400	2,548.50	599,916,900	
ANAホールディングス	279,300	2,917.00	814,718,100	
ビーウィズ	2,200	1,486.00	3,269,200	貸付株式数 800株
TREホールディングス	24,200	1,497.00	36,227,400	
人・夢・技術グループ	4,300	1,375.00	5,912,500	貸付株式数 1,700株
西本WISMETTAC HD	6,300	1,927.00	12,140,100	

シルバーライフ	2,900	708.00	2,053,200	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,379.00	237,900		
GENKY DRUGSTORES	9,500	3,160.00	30,020,000	貸付株式数	1,500株
コア商事HLDGS	8,000	599.00	4,792,000	貸付株式数	2,100株
KPPグループホールディン	22,500	624.00	14,040,000		
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	200	1,334.00	266,800	貸付株式数	100株
ブックオフGHD	7,900	1,487.00	11,747,300	貸付株式数	3,000株
ギフトホールディングス	5,400	3,290.00	17,766,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	107,200	1,169.00	125,316,800		
三井倉庫HOLD	10,600	7,250.00	76,850,000		
住友倉庫	30,500	2,753.00	83,966,500		
渋沢倉庫	4,700	3,035.00	14,264,500		
ヤマタネ	4,400	3,870.00	17,028,000	貸付株式数	1,500株
東陽倉庫	300	1,407.00	422,100		
乾汽船	13,000	1,614.00	20,982,000	貸付株式数	5,100株
日本トランスシティ	20,600	1,025.00	21,115,000		
ケイヒン	200	2,015.00	403,000		
中央倉庫	6,100	1,543.00	9,412,300	貸付株式数	2,100株
川西倉庫	200	1,056.00	211,200	貸付株式数	100株
安田倉庫	7,000	1,745.00	12,215,000	貸付株式数	2,300株
ファイズホールディングス	200	947.00	189,400		
NISSOHD	9,100	750.00	6,825,000	貸付株式数	3,400株
大栄環境	23,000	2,885.00	66,355,000	貸付株式数	8,900株
日本管財ホールディンク	11,100	2,601.00	28,871,100		
東洋埠頭	300	1,258.00	377,400		
上組	47,400	3,386.00	160,496,400		
サンリツ	300	789.00	236,700		
キムラユニティー	500	1,444.00	722,000		
キューソー流通システム	6,800	2,130.00	14,484,000	貸付株式数	2,600株
東海運	600	335.00	201,000	貸付株式数	500株
エーアイテイー	6,500	1,710.00	11,115,000		
内外トランスライン	4,100	2,711.00	11,115,100	貸付株式数	1,500株
ショーエイコーポ	400	571.00	228,400	貸付株式数	300株
日本コンセプト	3,700	1,850.00	6,845,000	貸付株式数	1,400株
TBSホールディングス	51,900	3,889.00	201,839,100	貸付株式数	19,100株
日本テレビHLDS	91,300	2,615.50	238,795,150	貸付株式数	29,500株
朝日放送グループHD	9,600	624.00	5,990,400	貸付株式数	3,100株
テレビ朝日HD	25,000	2,268.00	56,700,000		

スカパーJSATHD	80,100	889.00	71,208,900	
テレビ東京HD	6,300	3,005.00	18,931,500	貸付株式数 2,400株
日本BS放送	400	891.00	356,400	貸付株式数 300株
ビジョン	15,400	1,312.00	20,204,800	貸付株式数 5,800株
スマートパリュウ	300	323.00	96,900	貸付株式数 200株
U-NEXT HOLDINGS	34,700	1,707.00	59,232,900	貸付株式数 12,300株
ワイヤレスゲート	500	219.00	109,500	
日本通信	83,200	128.00	10,649,600	貸付株式数 33,900株
クロップス	100	1,010.00	101,000	
日本電信電話	30,674,900	154.90	4,751,542,010	
KDDI	758,500	4,949.00	3,753,816,500	
ソフトバンク	16,501,100	197.30	3,255,667,030	
光通信	11,900	35,020.00	416,738,000	
エムティーアイ	7,100	1,238.00	8,789,800	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	33,600	2,728.00	91,660,800	
ファイバーゲート	5,500	898.00	4,939,000	貸付株式数 2,100株
アイドママーケティングコ ミュ	300	233.00	69,900	貸付株式数 200株
KADOKAWA	54,500	4,355.00	237,347,500	貸付株式数 9,300株
学研ホールディングス	18,900	995.00	18,805,500	
ゼンリン	17,600	817.00	14,379,200	
昭文社ホールディングス	500	392.00	196,000	
インプレスホールディング ス	1,100	148.00	162,800	貸付株式数 1,000株
東京電力HD	864,700	462.30	399,750,810	貸付株式数 326,500株
中部電力	378,200	1,588.00	600,581,600	
関西電力	505,600	1,716.00	867,609,600	
中国電力	178,300	884.10	157,635,030	
北陸電力	104,800	855.50	89,656,400	貸付株式数 38,700株
東北電力	270,500	1,171.50	316,890,750	
四国電力	95,300	1,202.00	114,550,600	貸付株式数 30,300株
九州電力	236,700	1,405.00	332,563,500	
北海道電力	107,400	831.70	89,324,580	貸付株式数 42,200株
沖縄電力	25,700	931.00	23,926,700	
電源開発	77,200	2,539.50	196,049,400	
エフオン	7,300	385.00	2,810,500	
イーレックス	19,900	602.00	11,979,800	貸付株式数 7,600株
レノバ	27,900	702.00	19,585,800	貸付株式数 10,700株
東京瓦斯	194,300	4,354.00	845,982,200	

大阪瓦斯	201,900	3,262.00	658,597,800	
東邦瓦斯	40,400	4,057.00	163,902,800	貸付株式数 15,600株
北海道瓦斯	30,300	540.00	16,362,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	21,300	374.00	7,966,200	
西部ガスHLDGS	10,500	1,703.00	17,881,500	貸付株式数 4,200株
静岡ガス	23,200	1,014.00	23,524,800	貸付株式数 8,800株
メタウォーター	14,100	1,769.00	24,942,900	
アイネット	6,200	1,612.00	9,994,400	貸付株式数 2,300株
松 竹	5,900	11,420.00	67,378,000	貸付株式数 2,300株
東 宝	64,500	6,716.00	433,182,000	
エイチ・アイ・エス	33,800	1,595.00	53,911,000	貸付株式数 13,200株
東 映	17,000	6,260.00	106,420,000	貸付株式数 4,600株
ラックランド	4,400	1,783.00	7,845,200	貸付株式数 1,700株
NTTデータグループ	269,600	3,017.00	813,383,200	
共立メンテナンス	33,200	2,849.00	94,586,800	貸付株式数 12,800株 (600株)
イチネンホールディングス	10,200	1,855.00	18,921,000	
建設技術研究所	5,400	5,100.00	27,540,000	貸付株式数 1,600株
スペース	7,600	1,155.00	8,778,000	
アインホールディングス	15,000	4,291.00	64,365,000	貸付株式数 4,300株
燦ホールディングス	8,800	1,173.00	10,322,400	
ピー・シー・エー	6,800	2,107.00	14,327,600	
スバル興業	4,100	3,120.00	12,792,000	貸付株式数 600株
東京テアトル	400	1,070.00	428,000	貸付株式数 200株
タナベコンサルティンググル	4,500	1,232.00	5,544,000	
ビジネス B 太田昭和	4,400	2,088.00	9,187,200	
ナ ガ ワ	2,800	6,450.00	18,060,000	貸付株式数 1,100株
東京都競馬	7,800	4,350.00	33,930,000	貸付株式数 3,000株
カナモト	16,400	3,270.00	53,628,000	
D T S	18,700	4,225.00	79,007,500	
スクウェア・エニックス・HD	51,800	6,132.00	317,637,600	
シーイーシー	13,000	1,967.00	25,571,000	貸付株式数 4,900株
カプコン	205,000	3,433.00	703,765,000	
ニシオホールディングス	8,700	4,270.00	37,149,000	
アイ・エス・ビー	4,800	1,368.00	6,566,400	貸付株式数 1,200株
アゴーラ ホスピタリティーG	7,200	47.00	338,400	貸付株式数 6,800株
日本空港ビルデング	35,800	4,940.00	176,852,000	貸付株式数 8,300株

トランス・コスモス	13,500	3,390.00	45,765,000	
乃村工藝社	46,200	840.00	38,808,000	
S C S K	84,200	3,270.00	275,334,000	
藤田観光	4,700	7,940.00	37,318,000	貸付株式数 1,000株
KNT-CTホールディングス	6,300	1,177.00	7,415,100	貸付株式数 1,000株
トーカイ	9,400	2,286.00	21,488,400	
白 洋 舎	200	2,237.00	447,400	貸付株式数 100株
セコム	215,300	5,276.00	1,135,922,800	
N S W	4,600	3,065.00	14,099,000	
セントラル警備保障	5,700	2,880.00	16,416,000	
アイネス	8,000	1,837.00	14,696,000	
丹青社	22,300	1,004.00	22,389,200	
メイテックグループホール デ	39,000	2,843.00	110,877,000	
T K C	18,400	3,930.00	72,312,000	貸付株式数 3,500株
富士ソフト	26,300	9,771.00	256,977,300	
応用地質	9,900	2,448.00	24,235,200	
船井総研ホールディン	21,200	2,431.00	51,537,200	貸付株式数 8,200株
N S D	39,700	3,420.00	135,774,000	貸付株式数 9,400株
進学会ホールディングス	400	202.00	80,800	貸付株式数 200株 (200株)
丸紅建材リース	100	3,075.00	307,500	
オ オ バ	800	972.00	777,600	
コナミグループ	38,600	15,065.00	581,509,000	
いであ	300	2,442.00	732,600	
学 究 社	4,200	2,012.00	8,450,400	
イオンディライト	11,300	4,325.00	48,872,500	
ナック	10,800	575.00	6,210,000	貸付株式数 2,400株
福井コンピュータHLDS	7,200	3,115.00	22,428,000	
ダイセキ	25,500	3,825.00	97,537,500	貸付株式数 2,600株
ステップ	3,900	2,131.00	8,310,900	
泉州電業	7,500	5,130.00	38,475,000	貸付株式数 2,800株
GENKI GLOBAL DIN	6,100	3,475.00	21,197,500	貸付株式数 200株
トラスコ中山	22,800	2,321.00	52,918,800	
ヤマダホールディングス	334,800	442.10	148,015,080	
オートバックスセブン	37,900	1,432.00	54,272,800	
モリト	8,700	1,508.00	13,119,600	
アークランズ	32,400	1,663.00	53,881,200	貸付株式数 12,600株
ニトリホールディングス	39,600	19,740.00	781,704,000	
グルメ杵屋	8,800	1,051.00	9,248,800	貸付株式数 2,500株

愛 眼	1,100	142.00	156,200	
ケーユーホールディングス	6,400	1,099.00	7,033,600	
吉野家ホールディングス	42,600	3,168.00	134,956,800	貸付株式数 16,400株 (4,400株)
加藤産業	13,500	4,540.00	61,290,000	
北恵	300	794.00	238,200	貸付株式数 100株
イノテック	7,400	1,362.00	10,078,800	
イエローハット	19,200	2,672.00	51,302,400	貸付株式数 5,400株
松屋フーズHLDGS	5,100	6,760.00	34,476,000	
JBCCホールディングス	6,800	4,515.00	30,702,000	
JKホールディングス	8,200	1,036.00	8,495,200	
サガミホールディングス	17,500	1,770.00	30,975,000	貸付株式数 5,400株 (5,400株)
日 伝	6,200	3,040.00	18,848,000	貸付株式数 2,400株
ミロク情報サービス	9,400	1,927.00	18,113,800	貸付株式数 900株
北沢産業	800	352.00	281,600	貸付株式数 700株
杉本商事	9,600	1,392.00	13,363,200	貸付株式数 1,500株
因幡電機産業	30,400	3,906.00	118,742,400	
王将フードサービス	21,500	3,045.00	65,467,500	貸付株式数 4,400株
ミニストップ	8,900	1,692.00	15,058,800	貸付株式数 3,400株 (1,200株)
アークス	18,100	2,593.00	46,933,300	貸付株式数 2,000株
バローホールディングス	20,500	2,127.00	43,603,500	
東 テ ク	10,900	2,638.00	28,754,200	
ミスミグループ本社	164,400	2,414.50	396,943,800	
アルテック	600	213.00	127,800	
ベ ル ク	5,400	6,650.00	35,910,000	
大 庄	6,500	1,067.00	6,935,500	貸付株式数 2,400株 (300株)
タキヒヨー	300	1,231.00	369,300	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	61,200	52,490.00	3,212,388,000	
ソフトバンクグループ	508,700	9,434.00	4,799,075,800	
蔵王産業	200	2,434.00	486,800	
スズケン	35,900	4,679.00	167,976,100	貸付株式数 6,800株
サンドラッグ	36,600	3,937.00	144,094,200	
サックスパーホールディング グ	10,300	968.00	9,970,400	貸付株式数 3,000株
ジェコス	6,400	999.00	6,393,600	
ヤマザワ	200	1,180.00	236,000	
や ま や	300	2,868.00	860,400	貸付株式数 100株

ペルーナ	26,200	776.00	20,331,200	貸付株式数	6,600株
合計			400,098,341,150		

（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。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月18日現在 金 額（円）	2024年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,877,453,939	1,666,500,509
コール・ローン	10,490,926,784	16,316,826,115
株式	389,010,712,465	656,595,315,530
投資証券	8,581,493,156	12,506,235,965
派生商品評価勘定	263,383,037	336,584,772
未収入金	3,481,831	4,596,994
未収配当金	438,781,439	523,072,149
差入委託証拠金	8,488,313,058	9,094,372,389
流動資産合計	419,154,545,709	697,043,504,423

資産合計	419,154,545,709	697,043,504,423
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	316,522,472	91,801,958
未払解約金	109,420,000	345,686,100
流動負債合計	425,942,472	437,488,058
負債合計	425,942,472	437,488,058
純資産の部		
元本等		
元本	1 79,048,744,098	97,471,314,337
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	339,679,859,139	599,134,702,028
元本等合計	418,728,603,237	696,606,016,365
純資産合計	418,728,603,237	696,606,016,365
負債純資産合計	419,154,545,709	697,043,504,423

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19日 至2024年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首	2022年12月20日	2023年12月19日
期首元本額	69,638,060,038円	79,048,744,098円
期中追加設定元本額	13,935,683,680円	26,368,558,518円
期中一部解約元本額	4,524,999,620円	7,945,988,279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V A	252,201,357円	216,835,107円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	2,398,033円	1,350,771円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	25,425,788円	15,640,386円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,173,336円	3,401,571円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	130,046,867円	85,662,411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)	101,924,857円	114,845,246円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	89,930,302円	77,052,001円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	-円	8,670,747,397円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	730,644,158円	763,141,440円

ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス（為替ヘッジな し）	4,665,956,172円	6,049,980,216円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国株式インデックス エ マージングプラス（為替ヘッジ なし）	560,421,539円	570,811,387円
D - I ' s 外国株式インデック ス	20,707,782円	15,964,093円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2050	53,190,442円	45,602,828円
i F r e e 外国株式インデック ス（為替ヘッジなし）	7,628,470,875円	9,804,220,171円
i F r e e 8資産バランス	1,483,678,196円	1,523,216,776円
i F r e e 年金バランス	322,769,357円	347,680,301円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060	2,911,681円	18,710,984円
D Cダイワ外国株式インデック ス	47,632,499,577円	51,367,234,653円
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	500,377,466円	433,707,038円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	1,067,785,681円	1,018,865,470円
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	1,025,339,397円	997,600,353円
大和D C 海外株式インデックス ファンド	2,015,691,298円	1,098,357,050円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	12,498,122円	9,588,199円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	13,060,578円	11,192,828円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	2,142,692,877円	2,863,091,211円
ダイワつみたてインデックスバ ランス 3 0	2,057,594円	1,774,665円
ダイワつみたてインデックスバ ランス 5 0	2,504,278円	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバ ランス 7 0	5,295,411円	13,195,933円
ダイワ先進国株式インデックス （為替ヘッジなし）（投資一任 専用）	11,578,719円	16,128,054円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	52,676,509円	40,010,033円

ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	33,932,785円	28,225,334円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	900,545,333円	629,488,881円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	48,117,622円	33,701,276円
ダイワバランスファンド2021-02 （適格機関投資家専用）	140,109,625円	122,278,441円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	36,916円	330,995円
スタイル9（4資産分散・ balan ス型）	62,672円	2,357,489円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	88,640円	3,464,255円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	31,336円	136,863円
スタイル9（6資産分散・ balan ス型）	55,374円	4,334,111円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	88,833円	5,039,343円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	28,073円	192,325円
スタイル9（8資産分散・ balan ス型）	47,882円	3,078,619円
スタイル9（8資産分散・積極 型）	84,991円	9,781,176円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,390,103,806円	1,191,855,722円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	433,076,574円	426,013,289円
ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ S M A 専用）	2,336,572,680円	5,254,796,860円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	3,037,904,988円	3,267,571,895円
ダイワライフスタイル 2 5	8,563,694円	6,633,135円
ダイワライフスタイル 5 0	38,800,537円	31,382,448円
ダイワライフスタイル 7 5	32,426,160円	27,178,582円
ダイワバランスファンド2023-08 （適格機関投資家専用）	89,157,328円	76,831,150円
ダイワバランスファンド2024-01 （適格機関投資家専用）	-円	74,807,979円

ダイワバランスファンド2024-05 （適格機関投資家専用）	-円	73,610,332円
計	79,048,744,098円	97,471,314,337円
2. 期末日における受益権の総数	79,048,744,098口	97,471,314,337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19日 至2024年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------------	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	13,600,937,161	2,626,177,855
投資証券	605,967,111	738,328,149
合計	14,206,904,272	1,887,849,706

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	21,247,150,443	-	21,504,373,808	257,223,365	27,573,598,772	-	27,491,378,576	82,220,196
合計	21,247,150,443	-	21,504,373,808	257,223,365	27,573,598,772	-	27,491,378,576	82,220,196

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	10,824,965,810	-	10,514,603,010	310,362,800	15,762,598,220	-	16,089,601,230	327,003,010
アメリカ・ドル	6,537,435,720	-	6,344,549,120	192,886,600	9,734,075,170	-	9,978,085,320	244,010,150
イギリス・ポンド	368,829,410	-	359,306,400	9,523,010	1,175,821,140	-	1,207,703,580	31,882,440
オーストラリア・ドル	660,238,240	-	646,463,080	13,775,160	659,684,120	-	659,957,680	273,560
カナダ・ドル	996,957,150	-	974,235,840	22,721,310	1,716,631,230	-	1,725,598,000	8,966,770
スイス・フラン	825,467,070	-	799,299,270	26,167,800	1,308,759,250	-	1,326,447,430	17,688,180
ユーロ	1,436,038,220	-	1,390,749,300	45,288,920	1,167,627,310	-	1,191,809,220	24,181,910
合計	10,824,965,810	-	10,514,603,010	310,362,800	15,762,598,220	-	16,089,601,230	327,003,010

（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)

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額	5,2971円	7,1468円
(1万口当たり純資産額)	(52,971円)	(71,468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	229.690	1,745,644.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	42,000	201.240	8,452,080.000	
	FIRST SOLAR INC	6,600	188.270	1,242,582.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,200	166.300	1,862,560.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,400	135.800	1,140,720.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	25,500	67.190	1,713,345.000	
	ABBOTT LABORATORIES	111,966	113.290	12,684,628.140	
	HOWMET AEROSPACE INC	24,983	111.930	2,796,347.190	
	VERISK ANALYTICS INC	9,200	280.220	2,578,024.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	23,700	53.640	1,271,268.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	77,600	74.260	5,762,576.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,200	628.220	2,010,304.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,100	83.170	2,919,267.000	
	QORVO INC	6,020	70.950	427,119.000	
	AFLAC INC	34,300	102.750	3,524,325.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	7,600	165.460	1,257,496.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	10,400	137.860	1,433,744.000	

ADOBE INC	28,320	455.230	12,892,113.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,500	86.680	996,820.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,200	390.590	2,812,248.000	
GARMIN LTD	9,900	210.890	2,087,811.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,400	304.710	4,387,824.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41,800	233.130	9,744,834.000	
WR BERKLEY CORP	19,613	58.850	1,154,225.050	
AUTOZONE INC	1,120	3,319.110	3,717,403.200	
DOLLAR TREE INC	13,171	70.110	923,418.810	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	76,900	20.880	1,605,672.000	
CELANESE CORP	7,050	68.410	482,290.500	
DR HORTON INC	18,916	146.710	2,775,166.360	
AUTODESK INC	13,900	302.820	4,209,198.000	
MOODY'S CORP	10,600	485.630	5,147,678.000	
DEVON ENERGY CORP	40,300	32.170	1,296,451.000	
ALBEMARLE CORP	7,600	97.550	741,380.000	
ATMOS ENERGY CORP	10,100	141.380	1,427,938.000	
ALLIANT ENERGY CORP	16,600	59.570	988,862.000	
CITIGROUP INC	122,773	71.120	8,731,615.760	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,300	295.570	7,773,491.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,300	91.920	3,152,856.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,230	446.740	996,230.200	
HESS CORP	17,900	134.410	2,405,939.000	
DAVITA INC	2,950	147.570	435,331.500	
DANAHER CORP	41,850	233.530	9,773,230.500	
FORTIVE CORP	22,600	75.730	1,711,498.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	37,000	152.790	5,653,230.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31,000	51.490	1,596,190.000	
APPLE INC	980,500	253.480	248,537,140.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,200	173.880	2,816,856.000	
BOEING CO/THE	46,900	173.030	8,115,107.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,115	147.800	1,494,997.000	
BECTON DICKINSON AND CO	18,599	225.640	4,196,678.360	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	150.140	1,246,162.000	
NISOURCE INC	28,900	36.210	1,046,469.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,600	108.880	827,488.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	47,571	78.450	3,731,944.950	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	270,904	40.780	11,047,465.120	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	85,350	455.660	38,890,581.000	

ANSYS INC	5,700	343.070	1,955,499.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	86,217	45.130	3,890,973.210	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	46,400	183.110	8,496,304.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	130,500	57.650	7,523,325.000	
JPMORGAN CHASE & CO	183,070	238.360	43,636,565.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,400	117.890	1,697,616.000	
LKQ CORP	16,700	36.610	611,387.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,812	42.740	504,844.880	
CADENCE DESIGN SYS INC	17,700	311.350	5,510,895.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,400	541.860	3,467,904.000	
DOLLAR GENERAL CORP	14,200	76.000	1,079,200.000	
SERVICENOW INC	13,300	1,114.720	14,825,776.000	
CATERPILLAR INC	31,200	375.800	11,724,960.000	
BROWN & BROWN INC	15,700	103.180	1,619,926.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,800	37.990	638,232.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,400	189.330	643,722.000	
CMS ENERGY CORP	19,300	67.040	1,293,872.000	
MOSAIC CO/THE	20,100	25.440	511,344.000	
DELTA AIR LINES INC	10,400	60.810	632,424.000	
CORNING INC	52,400	47.760	2,502,624.000	
CISCO SYSTEMS INC	256,750	58.520	15,025,010.000	
MORGAN STANLEY	78,152	127.740	9,983,136.480	
DECKERS OUTDOOR CORP	9,900	210.370	2,082,663.000	
MSCI INC	5,100	611.500	3,118,650.000	
FAIR ISAAC CORP	1,600	2,138.180	3,421,088.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,100	657.590	1,380,939.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,000	295.060	1,180,240.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,300	76.030	1,087,229.000	
BROADCOM INC	285,620	240.230	68,614,492.600	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,800	379.690	1,063,132.000	
CNH INDUSTRIAL NV	56,500	11.600	655,400.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,800	225.970	858,686.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,300	246.580	2,046,614.000	
DTE ENERGY COMPANY	13,400	120.700	1,617,380.000	
CENTENE CORP	33,907	57.810	1,960,163.670	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,800	198.080	1,346,944.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	28,900	44.740	1,292,986.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,100	282.910	3,989,031.000	
GARTNER INC	5,050	497.420	2,511,971.000	

DOMINION ENERGY INC	54,041	53.590	2,896,057.190	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,300	51.950	2,457,235.000	
SMITH (A.O.) CORP	7,800	70.810	552,318.000	
DEERE & CO	16,800	443.590	7,452,312.000	
QUANTA SERVICES INC	9,500	336.430	3,196,085.000	
POOL CORP	2,500	358.550	896,375.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,384	114.700	1,879,244.800	
BURLINGTON STORES INC	4,100	291.220	1,194,002.000	
NASDAQ INC	27,800	79.610	2,213,158.000	
TARGA RESOURCES CORP	13,400	181.220	2,428,348.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	137.910	634,386.000	
WESTLAKE CORP	2,500	117.540	293,850.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,300	90.840	2,025,732.000	
TELEFLEX INC	3,100	178.280	552,668.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,300	177.310	939,743.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,700	334.260	1,571,022.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,300	337.850	439,205.000	
CATALENT INC	11,700	63.480	742,716.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,900	226.410	2,241,459.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	291.780	1,108,764.000	
CARLISLE COS INC	3,000	404.630	1,213,890.000	
IDEX CORP	4,900	222.190	1,088,731.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,000	93.490	4,674,500.000	
ROLLINS INC	18,707	48.220	902,051.540	
AECOM	8,600	110.400	949,440.000	
WATSCO INC	2,300	508.470	1,169,481.000	
GRACO INC	10,900	86.210	939,689.000	
AMETEK INC	14,900	186.710	2,781,979.000	
TORO CO	6,500	85.310	554,515.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,800	105.800	1,671,640.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,450	53.940	563,673.000	
HEICO CORP	2,900	259.800	753,420.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,500	488.810	1,222,025.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,800	75.440	1,267,392.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,800	607.940	1,702,232.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,560	982.080	28,048,204.800	
EPAM SYSTEMS INC	3,700	247.920	917,304.000	
RPM INTERNATIONAL INC	8,300	131.420	1,090,786.000	
RELIANCE INC	3,600	280.070	1,008,252.000	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	88,200	64.290	5,670,378.000	
CUMMINS INC	8,900	361.230	3,214,947.000	
CDW CORP/DE	8,600	176.660	1,519,276.000	
COSTAR GROUP INC	26,400	73.130	1,930,632.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12,400	198.980	2,467,352.000	
MERCADOLIBRE INC	2,990	1,809.120	5,409,268.800	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,700	177.670	835,049.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,916	250.270	3,983,297.320	
DEXCOM INC	25,800	77.800	2,007,240.000	
NORDSON CORP	3,590	224.010	804,195.900	
COPART INC	55,800	60.670	3,385,386.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	12,300	160.140	1,969,722.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,600	228.810	1,052,526.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,900	329.400	1,614,060.000	
TRANSDIGM GROUP INC	3,690	1,274.240	4,701,945.600	
BIO-TECHNE CORP	10,220	75.270	769,259.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,500	136.690	888,485.000	
KINDER MORGAN INC	128,781	26.610	3,426,862.410	
HCA HEALTHCARE INC	12,500	307.780	3,847,250.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,500	234.900	587,250.000	
COTERRA ENERGY INC	47,600	24.520	1,167,152.000	
T-MOBILE US INC	33,827	220.710	7,465,957.170	
ZILLOW GROUP INC - C	9,950	80.770	803,661.500	
EMCOR GROUP INC	3,000	476.900	1,430,700.000	
COCA-COLA CO/THE	263,550	63.400	16,709,070.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,200	77.550	1,023,660.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,150	115.920	1,060,668.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	18,200	21.340	388,388.000	
CSX CORP	124,700	32.930	4,106,371.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,025	180.640	1,449,636.000	
AMAZON.COM INC	608,200	231.150	140,585,430.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	38,800	74.120	2,875,856.000	
EXXON MOBIL CORP	285,809	108.010	30,870,230.090	
AES CORP	45,800	12.870	589,446.000	
EVEREST GROUP LTD	2,800	355.060	994,168.000	
EOG RESOURCES INC	36,600	123.150	4,507,290.000	
EQT CORP	36,400	44.200	1,608,880.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	9,800	97.360	954,128.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	2,107.940	1,475,558.000	

CENCORA INC	11,500	227.640	2,617,860.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,500	136.460	2,524,510.000	
FORD MOTOR CO	251,223	9.970	2,504,693.310	
EXACT SCIENCES CORP	11,900	60.370	718,403.000	
ENTEGRIS INC	9,800	109.360	1,071,728.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	11,900	386.420	4,598,398.000	
AERCAP HOLDINGS NV	12,200	95.110	1,160,342.000	
FORTINET INC	41,900	97.620	4,090,278.000	
MARKEL CORP	820	1,710.140	1,402,314.800	
NEXTERA ENERGY INC	132,280	72.270	9,559,875.600	
FREEPORT-MCMORAN INC	92,508	40.620	3,757,674.960	
INSULET CORP	4,600	263.350	1,211,410.000	
US BANCORP	100,500	49.980	5,022,990.000	
UNITED RENTALS INC	4,300	758.390	3,261,077.000	
F5 NETWORKS INC	3,800	259.800	987,240.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	34,000	33.800	1,149,200.000	
FASTENAL CO	36,900	77.640	2,864,916.000	
FISERV INC	37,033	204.150	7,560,286.950	
GENERAL ELECTRIC CO	69,806	165.800	11,573,834.800	
AXON ENTERPRISE INC	4,700	635.760	2,988,072.000	
GENERAL MOTORS CO	72,300	51.150	3,698,145.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,100	265.220	4,004,822.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,350	574.680	11,694,738.000	
ALPHABET INC-CL A	377,000	195.420	73,673,340.000	
ALPHABET INC-CL C	323,440	197.120	63,756,492.800	
OWENS CORNING	5,600	183.210	1,025,976.000	
GENERAL MILLS INC	35,800	65.930	2,360,294.000	
FIRSTENERGY CORP	35,218	39.840	1,403,085.120	
GENUINE PARTS CO	9,050	118.490	1,072,334.500	
FIFTH THIRD BANCORP	43,600	45.050	1,964,180.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,250	218.450	2,676,012.500	
HALLIBURTON CO	56,800	27.190	1,544,392.000	
HOME DEPOT INC	63,950	408.470	26,121,656.500	
ASSURANT INC	3,350	213.120	713,952.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,500	16.940	1,583,890.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,610	193.490	505,008.900	
HERSHEY CO/THE	9,500	177.630	1,687,485.000	
HUMANA INC	7,800	233.890	1,824,342.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,400	219.020	3,591,928.000	

HENRY SCHEIN INC	8,100	73.180	592,758.000	
HP INC	62,000	33.840	2,098,080.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	83,600	21.540	1,800,744.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	24,300	90.530	2,199,879.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,403	31.250	1,825,093.750	
ENPHASE ENERGY INC	8,600	73.400	631,240.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	59,300	228.970	13,577,921.000	
HUBBELL INC	3,500	439.530	1,538,355.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	21,300	55.240	1,176,612.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,900	73.800	583,020.000	
ZOETIS INC	29,200	170.790	4,987,068.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,599	391.790	5,719,742.210	
CHENIERE ENERGY INC	14,600	210.680	3,075,928.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	157.640	457,156.000	
ALLEGION PLC	5,650	136.640	772,016.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,500	160.120	1,200,900.000	
WASTE CONNECTIONS INC	16,637	176.260	2,932,437.620	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	37.660	636,454.000	
JM SMUCKER CO/THE	6,900	114.560	790,464.000	
JOHNSON & JOHNSON	155,000	146.410	22,693,550.000	
ABBVIE INC	113,672	175.380	19,935,795.360	
HOLOGIC INC	15,000	72.260	1,083,900.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,700	131.140	2,845,738.000	
KROGER CO	44,300	61.170	2,709,831.000	
KLA CORP	8,700	654.880	5,697,456.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	13,800	490.610	6,770,418.000	
CORPAY INC	4,300	352.100	1,514,030.000	
LOWE'S COS INC	36,500	257.750	9,407,875.000	
ELI LILLY & CO	51,985	778.620	40,476,560.700	
LAM RESEARCH CORP	83,400	77.810	6,489,354.000	
LOEWS CORP	12,000	83.640	1,003,680.000	
MCDONALD'S CORP	46,150	296.080	13,664,092.000	
3M CO	35,390	128.050	4,531,689.500	
META PLATFORMS INC CLASS A	140,700	619.440	87,155,208.000	
S&P GLOBAL INC	20,639	500.510	10,330,025.890	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,000	544.780	2,179,120.000	
PHILLIPS 66	27,000	115.830	3,127,410.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	10,300	269.790	2,778,837.000	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,750	35.370	521,707.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,300	80.310	1,309,053.000	
METLIFE INC	38,300	81.250	3,111,875.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	55,800	112.250	6,263,550.000	
ARISTA NETWORKS INC	68,800	112.950	7,770,960.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,798	461.750	4,985,976.500	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,400	1,246.880	1,745,632.000	
BAKER HUGHES CO	63,923	41.410	2,647,051.430	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,300	293.490	2,142,477.000	
MERCK & CO. INC.	163,121	100.060	16,321,887.260	
DUPONT DE NEMOURS INC	26,951	80.130	2,159,583.630	
MASCO CORP	14,100	76.580	1,079,778.000	
M & T BANK CORP	10,799	196.150	2,118,223.850	
MARSH & MCLENNAN COS	31,670	213.180	6,751,410.600	
HEICO CORP-CLASS A	4,920	202.340	995,512.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,402	289.440	4,457,954.880	
WORKDAY INC-CLASS A	13,800	278.010	3,836,538.000	
BLOCK INC CLASS A	35,812	94.550	3,386,024.600	
TRANSUNION	12,600	98.250	1,237,950.000	
VISTRA CORP	22,100	139.770	3,088,917.000	
NETAPP INC	13,200	122.490	1,616,868.000	
NIKE INC -CL B	76,600	78.000	5,974,800.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	14,600	242.470	3,540,062.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34,600	58.290	2,016,834.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,605	157.900	1,990,329.500	
ALLY FINANCIAL INC	17,700	36.590	647,643.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,000	480.290	4,322,610.000	
APTIV PLC	17,100	57.860	989,406.000	
NEWMONT CORP	73,611	39.800	2,929,717.800	
MCKESSON CORP	8,400	562.780	4,727,352.000	
XYLEM INC	15,700	120.770	1,896,089.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,100	126.040	12,616,604.000	
NUCOR CORP	15,300	120.980	1,850,994.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,400	474.370	4,933,448.000	
GODADDY INC - CLASS A	9,100	207.460	1,887,886.000	
EVERGY INC	14,850	61.500	913,275.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,724	46.560	1,896,109.440	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,650	424.340	700,161.000	
OKTA INC	10,500	85.420	896,910.000	

WIX.COM LTD	3,610	218.980	790,517.800	
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,400	46.570	950,028.000	
KKR & CO INC	40,000	151.230	6,049,200.000	
PAYCHEX INC	20,900	140.280	2,931,852.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	1,246.080	4,735,104.000	
ALTRIA GROUP INC	109,800	54.130	5,943,474.000	
P G & E CORP	130,700	19.710	2,576,097.000	
PFIZER INC	364,713	26.430	9,639,364.590	
CIGNA CORP	18,000	265.590	4,780,620.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	20,601	118.280	2,436,686.280	
XCEL ENERGY INC	35,900	68.080	2,444,072.000	
STERIS PLC	6,400	209.510	1,340,864.000	
SEA LTD-ADR	25,100	115.790	2,906,329.000	
FOX CORP - CLASS B	9,133	46.470	424,410.510	
FOX CORP - CLASS A	14,499	49.070	711,465.930	
STRYKER CORP	22,080	370.810	8,187,484.800	
DOW INC	45,118	40.570	1,830,437.260	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,500	133.290	999,675.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	16,100	84.600	1,362,060.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,300	665.990	5,527,717.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	121,800	61.030	7,433,454.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	151,167	170.330	25,748,275.110	
EXELON CORP	64,422	36.520	2,352,691.440	
INGERSOLL-RAND INC	26,008	97.550	2,537,080.400	
NVR INC	200	8,468.490	1,693,698.000	
CONOCOPHILLIPS	83,803	98.260	8,234,482.780	
TWILIO INC - A	9,800	109.760	1,075,648.000	
DOCUSIGN INC	13,100	98.170	1,286,027.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,400	232.970	792,098.000	
DAYFORCE INC	10,200	77.460	790,092.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	20,100	65.760	1,321,776.000	
PEPSICO INC	88,300	156.140	13,787,162.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,020	317.820	959,816.400	
MONGODB INC	4,800	265.100	1,272,480.000	
SNAP INC - A	67,900	11.180	759,122.000	
CORTEVA INC	44,568	58.570	2,610,347.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,000	118.890	2,734,470.000	
AMCOR PLC	93,100	9.730	905,863.000	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,000	376.420	5,646,300.000	
ROKU INC	8,200	83.390	683,798.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,600	129.180	1,627,668.000	
ACCENTURE PLC-CL A	40,300	357.300	14,399,190.000	
PENTAIR PLC	10,675	105.490	1,126,105.750	
QUALCOMM INC	71,700	157.920	11,322,864.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,900	77.540	1,155,346.000	
DATADOG INC - CLASS A	18,100	156.910	2,840,071.000	
PINTEREST INC- CLASS A	38,900	31.000	1,205,900.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,000	740.010	5,180,070.000	
REPUBLIC SERVICES INC	14,200	205.620	2,919,804.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,200	5,154.960	11,340,912.000	
ROSS STORES INC	21,400	150.850	3,228,190.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,830	232.550	1,355,766.500	
RESMED INC	9,500	242.620	2,304,890.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,230	155.490	1,124,192.700	
MODERNA INC	21,100	40.760	860,036.000	
HUBSPOT INC	3,180	741.670	2,358,510.600	
REVVITY INC	8,000	114.750	918,000.000	
CARRIER GLOBAL CORP	52,287	70.280	3,674,730.360	
OTIS WORLDWIDE CORP	25,838	96.340	2,489,232.920	
AVANTOR INC	43,800	21.980	962,724.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	14,700	51.780	761,166.000	
DYNATRACE INC	19,300	55.500	1,071,150.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	29,000	135.020	3,915,580.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	58,885	24.610	1,449,159.850	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	24,100	25.120	605,392.000	
MATCH GROUP INC	15,800	31.580	498,964.000	
CHEVRON CORP	111,818	148.110	16,561,363.980	
ZSCALER INC	5,900	200.450	1,182,655.000	
EDISON INTERNATIONAL	24,900	80.500	2,004,450.000	
TESLA INC	185,050	479.860	88,798,093.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,500	170.810	3,330,795.000	
GEN DIGITAL INC	35,300	29.380	1,037,114.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,002	82.210	822,264.420	
SYNOPSYS INC	9,900	511.870	5,067,513.000	
CARVANA CO	7,800	253.700	1,978,860.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,600	117.560	2,304,176.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,005	371.030	2,228,035.150	

VIATRIS INC	76,821	12.590	967,176.390	
DOORDASH INC - A	19,850	177.000	3,513,450.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	30,900	61.250	1,892,625.000	
AIRBNB INC-CLASS A	28,400	132.240	3,755,616.000	
CBRE GROUP INC - A	19,800	135.830	2,689,434.000	
SOUTHERN CO/THE	70,500	83.280	5,871,240.000	
SYSCO CORP	31,600	78.030	2,465,748.000	
TRAVELERS COS INC/THE	14,703	243.640	3,582,238.920	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,900	86.180	336,102.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,000	85.120	595,840.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,450	118.580	1,120,581.000	
SCHLUMBERGER LTD	91,352	38.930	3,556,333.360	
AT&T INC	461,491	22.830	10,535,839.530	
APA CORP	23,300	21.050	490,465.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,750	32.810	319,897.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	27,600	67.740	1,869,624.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,500	362.790	5,623,245.000	
SEMPRA ENERGY	40,800	86.960	3,547,968.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,300	48.540	499,962.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	131,100	74.390	9,752,529.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,650	94.490	1,289,788.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,500	311.640	3,895,500.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	58,800	188.120	11,061,456.000	
SALESFORCE.COM INC	61,566	350.970	21,607,819.020	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	25,709	176.320	4,533,010.880	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	43,034	81.850	3,522,332.900	
TERADYNE INC	10,600	128.010	1,356,906.000	
UNION PACIFIC CORP	39,280	229.880	9,029,686.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,488	137.990	2,965,129.120	
RTX CORP	85,679	117.420	10,060,428.180	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,200	127.320	6,009,504.000	
IQVIA HOLDINGS INC	11,804	196.640	2,321,138.560	
AMEREN CORPORATION	17,200	88.680	1,525,296.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,466	485.520	28,871,932.320	
APPLOVIN CORP CLASS A	13,400	337.890	4,527,726.000	
TOAST INC CLASS A	25,400	38.180	969,772.000	
VERISIGN INC	5,700	195.210	1,112,697.000	

RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	48,400	14.700	711,480.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	34,400	41.630	1,432,072.000	
VALERO ENERGY CORP	20,642	124.890	2,577,979.380	
ULTA BEAUTY INC	3,100	423.570	1,313,067.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	16,788	58.330	979,244.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,830	182.600	699,358.000	
ELEVANCE HEALTH INC	15,000	366.300	5,494,500.000	
WALT DISNEY CO/THE	116,762	113.020	13,196,441.240	
WELLS FARGO & CO	218,822	70.810	15,494,785.820	
WASTE MANAGEMENT INC	25,900	209.000	5,413,100.000	
WILLIAMS COS INC	78,500	53.690	4,214,665.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,000	275.210	1,926,470.000	
WALMART INC	284,500	95.420	27,146,990.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,100	108.060	1,415,586.000	
WYNN RESORTS LTD	6,400	91.960	588,544.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	143,300	5.140	736,562.000	
WABTEC CORP	11,311	198.190	2,241,727.090	
TJX COMPANIES INC	72,600	123.060	8,934,156.000	
WATERS CORP	3,900	373.720	1,457,508.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,400	395.000	1,343,000.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	47,300	9.970	471,581.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,563	310.530	2,038,008.390	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,200	198.210	1,625,322.000	
WESTERN DIGITAL CORP	22,400	64.640	1,447,936.000	
WEC ENERGY GROUP INC	20,400	94.710	1,932,084.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,100	85.450	2,742,945.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	107,850	318.300	34,328,655.000	
PPL CORP	47,500	32.260	1,532,350.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	20,124	234.240	4,713,845.760	
PULTEGROUP INC	13,350	115.890	1,547,131.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	149,953	11.350	1,701,966.550	
PPG INDUSTRIES INC	15,100	122.060	1,843,106.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,000	104.710	1,361,230.000	
NVIDIA CORP	1,580,200	130.390	206,042,278.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	25,613	198.300	5,079,057.900	

DRAFTKINGS INC CLASS A	28,200	40.720	1,148,304.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,900	249.250	473,575.000	
TYSON FOODS INC-CL A	18,400	59.400	1,092,960.000	
NETFLIX INC	27,690	919.130	25,450,709.700	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,600	528.840	13,009,464.000	
NRG ENERGY INC	13,350	91.420	1,220,457.000	
TEXTRON INC	12,000	80.070	960,840.000	
NEWS CORP - CLASS A	24,487	28.250	691,757.750	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,203.660	1,624,941.000	
OMNICOM GROUP	12,600	88.970	1,121,022.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,020	134.660	1,079,973.200	
ORACLE CORP	107,033	169.710	18,164,570.430	
MASTERCARD INC - A	53,100	531.010	28,196,631.000	
ONEOK INC	37,600	101.780	3,826,928.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,900	536.750	3,703,575.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,300	65.960	415,548.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	12,200	178.330	2,175,626.000	
EXPAND ENERGY CORP	13,500	96.750	1,306,125.000	
HF SINCLAIR CORP	10,500	35.760	375,480.000	
OVINTIV INC	17,000	38.980	662,660.000	
YUM! BRANDS INC	18,100	134.730	2,438,613.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11,400	185.930	2,119,602.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,700	59.250	693,225.000	
BANK OF AMERICA CORP	449,301	45.050	20,241,010.050	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,100	470.660	1,459,046.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,300	67.190	826,437.000	
AMERICAN EXPRESS CO	36,600	301.340	11,029,044.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	29,535	79.250	2,340,648.750	
LINDE PLC	30,746	430.200	13,226,929.200	
ANALOG DEVICES INC	31,991	213.820	6,840,315.620	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	24,300	19.320	469,476.000	
MONDAYCOM LTD	2,600	251.800	654,680.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	104,227	125.020	13,030,459.540	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	29.990	515,828.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	13,600	94.900	1,290,640.000	
KENVUE INC	123,300	22.040	2,717,532.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	6,800	56.820	386,376.000	

VERALTO CORP	15,916	103.460	1,646,669.360	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,372	71.220	2,946,513.840	
BUNGE GLOBAL LTD	9,200	81.270	747,684.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	23,000	120.690	2,775,870.000	
NUTANIX INC CLASS A	17,100	66.140	1,130,994.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,300	90.740	934,622.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,800	242.070	3,824,706.000	
AVERY DENNISON CORP	5,230	191.460	1,001,335.800	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	31,900	81.030	2,584,857.000	
EMERSON ELECTRIC CO	36,900	128.080	4,726,152.000	
AON PLC-CLASS A	12,600	358.880	4,521,888.000	
AMGEN INC	34,600	265.950	9,201,870.000	
SAMSARA INC CLASS A	14,100	46.780	659,598.000	
EATON CORP PLC	25,636	347.080	8,897,742.880	
COOPER INC	12,900	94.490	1,218,921.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,600	233.090	2,470,754.000	
APPLIED MATERIALS INC	53,100	170.340	9,045,054.000	
CME GROUP INC	23,200	235.990	5,474,968.000	
ECOLAB INC	16,500	246.170	4,061,805.000	
EQUIFAX INC	8,000	273.670	2,189,360.000	
GILEAD SCIENCES INC	80,200	92.800	7,442,560.000	
KEURIG DR PEPPER INC	74,500	33.040	2,461,480.000	
HORMEL FOODS CORP	19,500	32.150	626,925.000	
STATE STREET CORP	19,013	98.700	1,876,583.100	
SOLVENTUM CORP	9,472	68.600	649,779.200	
GE VERNOVA	17,726	328.340	5,820,154.840	
SCHWAB (CHARLES) CORP	103,340	76.760	7,932,378.400	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	44,000	97.230	4,278,120.000	
LABCORP HOLDINGS	5,500	230.950	1,270,225.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	32,900	29.640	975,156.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	33,500	53.930	1,806,655.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,000	185.050	2,405,650.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,500	273.250	3,142,375.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	12,500	43.050	538,125.000	
CROWN HOLDINGS INC	7,780	85.370	664,178.600	
TE CONNECTIVITY LTD	19,595	147.950	2,899,080.250	
BLACKROCK INC	9,600	1,049.220	10,072,512.000	
CARDINAL HEALTH INC	15,600	115.820	1,806,792.000	
FEDEX CORP	15,000	277.430	4,161,450.000	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,654	181.180	4,466,811.720	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16,513	86.770	1,432,833.010	
INTEL CORP	275,300	20.440	5,627,132.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	24,200	29.170	705,914.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,850	109.050	2,055,592.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	19,100	267.880	5,116,508.000	
ILLUMINA INC	10,300	143.120	1,474,136.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	22,900	545.160	12,484,164.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,050	187.710	1,135,645.500	
SNAP-ON INC	3,400	348.820	1,185,988.000	
CARMAX INC	10,000	83.120	831,200.000	
DUKE ENERGY CORP	49,728	107.890	5,365,153.920	
TARGET CORP	29,700	131.600	3,908,520.000	
DOVER CORP	8,900	196.540	1,749,206.000	
VW GRAINGER INC	2,900	1,120.310	3,248,899.000	
JABIL INC	7,300	133.960	977,908.000	
CINTAS CORP	23,400	208.380	4,876,092.000	
CONAGRA BRANDS INC	30,800	27.880	858,704.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	9,100	82.320	749,112.000	
CLOROX COMPANY	8,000	163.320	1,306,560.000	
ENTERGY CORP	27,600	74.840	2,065,584.000	
MICROSOFT CORP	454,400	454.460	206,506,624.000	
INCYTE CORP	10,600	69.400	735,640.000	
CVS HEALTH CORP	80,969	44.040	3,565,874.760	
MEDTRONIC PLC	82,598	81.370	6,720,999.260	
MICRON TECHNOLOGY INC	71,400	108.600	7,754,040.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,000	31.710	1,331,820.000	
KELLOGG CO	17,800	80.590	1,434,502.000	
KEYCORP	60,700	17.800	1,080,460.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	86,011	61.340	5,275,914.740	
CHUBB LTD	24,699	276.690	6,833,966.310	
ALLSTATE CORP	17,000	193.400	3,287,800.000	
EBAY INC	31,400	64.230	2,016,822.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	62,450	90.860	5,674,207.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,600	95.350	724,660.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,100	78.180	1,180,518.000	
TRIMBLE INC	15,800	72.890	1,151,662.000	
LENNAR CORP-A	15,400	151.470	2,332,638.000	
PROGRESSIVE CORP	37,700	247.530	9,331,881.000	

	PACCAR INC	33,755	111.660	3,769,083.300	
	BIOGEN INC	9,400	150.640	1,416,016.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	5,300	427.090	2,263,577.000	
	STARBUCKS CORP	73,000	92.090	6,722,570.000	
	PTC INC	7,800	196.900	1,535,820.000	
	EVERSOURCE ENERGY	23,100	58.510	1,351,581.000	
	INTUIT INC	18,080	677.770	12,254,081.600	
	BEST BUY CO INC	13,150	87.480	1,150,362.000	
	BALL CORP	19,504	57.750	1,126,356.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	94,797	90.430	8,572,492.710	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,200	154.790	2,507,598.000	
	VULCAN MATERIALS CO	8,500	272.650	2,317,525.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,700	469.240	7,836,308.000	
	CARNIVAL CORP	67,000	25.720	1,723,240.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	248,490	38.800	9,641,412.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,900	41.370	450,933.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	74,900	4.410	330,309.000	
アメリカ・ドル 小計				3,377,555,666.740 (519,265,408,205)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	383,106	24.135	9,246,263.310	
	HALEON PLC	478,287	3.847	1,839,970.080	
	WISE PLC CLASS A	41,324	9.910	409,520.840	
	BP PLC	998,128	3.801	3,793,884.520	
	UNILEVER PLC	153,476	46.520	7,139,703.520	
	BARCLAYS PLC	894,022	2.645	2,365,135.200	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	525,954	5.810	3,055,792.740	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	139,100	3.889	540,959.900	
	PRUDENTIAL PLC	166,101	6.362	1,056,734.560	
	NATWEST GROUP PLC	439,038	3.993	1,753,078.730	
	BAE SYSTEMS PLC	186,884	11.700	2,186,542.800	
	AVIVA PLC	165,520	4.676	773,971.520	
	GSK	256,394	13.335	3,419,013.990	
	INFORMA PLC	82,266	8.158	671,126.020	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	79,673	5.380	428,640.740	
	AUTO TRADER GROUP PLC	54,168	8.072	437,244.090	
	DCC PLC	6,000	53.150	318,900.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,537	70.200	318,497.400	
	HALMA PLC	23,492	27.830	653,782.360	

ENTAIN PLC	37,644	7.520	283,082.880	
JD SPORTS FASHION PLC	157,238	0.962	151,325.850	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,485	5.040	219,164.400	
M&G PLC	140,210	1.944	272,638.340	
ENDEAVOUR MINING PLC	11,149	14.470	161,326.030	
RELX PLC	115,161	37.070	4,269,018.270	
DIAGEO PLC	137,617	25.360	3,489,967.120	
RIO TINTO PLC	69,763	48.200	3,362,576.600	
STANDARD CHARTERED PLC	129,547	9.900	1,282,515.300	
TESCO PLC	423,328	3.740	1,583,246.720	
SMITH & NEPHEW PLC	54,049	9.802	529,788.290	
GLENCORE PLC	641,359	3.627	2,326,209.090	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,583	10.940	236,118.020	
SMITHS GROUP PLC	21,328	17.440	371,960.320	
PEARSON PLC	36,465	12.760	465,293.400	
SAINSBURY (J) PLC	110,288	2.750	303,292.000	
NEXT PLC	7,260	98.060	711,915.600	
TAYLOR WIMPEY PLC	219,530	1.246	273,644.140	
WHITBREAD PLC	11,175	29.160	325,863.000	
BUNZL PLC	20,780	33.560	697,376.800	
VODAFONE GROUP PLC	1,369,469	0.676	925,761.040	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,048	33.710	271,298.080	
KINGFISHER PLC	111,437	2.527	281,601.290	
WPP PLC	66,707	8.564	571,278.740	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	41,285	10.700	441,749.500	
SEVERN TRENT PLC	16,741	25.740	430,913.340	
RENTOKIL INITIAL PLC	156,167	4.052	632,788.680	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	42,667	48.430	2,066,362.810	
SCHRODERS PLC	50,139	3.124	156,634.230	
SSE PLC	68,310	16.170	1,104,572.700	
BARRATT REDROW PLC	83,251	4.358	362,807.850	
ASTRAZENECA PLC	95,878	105.060	10,072,942.680	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	360,719	2.266	817,389.250	
3I GROUP PLC	60,243	36.170	2,178,989.310	
ASHTAD GROUP PLC	27,078	50.860	1,377,187.080	
SAGE GROUP PLC/THE	62,153	13.050	811,096.650	
NATIONAL GRID PLC	302,654	9.366	2,834,657.360	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,778,874	0.542	2,048,905.480	
IMPERIAL BRANDS PLC	49,174	25.470	1,252,461.780	

	CENTRICA PLC	317,757	1.265	401,962.600	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	6,307	39.320	247,991.240	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	123,236	29.440	3,628,067.840	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,360	20.720	421,859.200	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,123,966	7.577	8,516,290.380	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,545	24.300	1,908,643.500	
	MONDI PLC	27,400	11.850	324,690.000	
	COMPASS GROUP PLC	104,878	26.720	2,802,340.160	
	PERSIMMON PLC	19,842	12.390	245,842.380	
	BT GROUP PLC	400,162	1.474	589,838.780	
	COCA-COLA HBC AG-DI	13,456	27.020	363,581.120	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,766	99.420	970,935.720	
	INTERTEK GROUP PLC	9,770	47.420	463,293.400	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,546	115.400	3,409,608.400	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,116	19.150	193,721.400	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,763	26.070	410,941.410	
	ANTOFAGASTA PLC	23,883	16.425	392,278.270	
	EXPERIAN PLC	56,849	35.910	2,041,447.590	
イギリス・ポンド 小計				117,697,815.730 (23,000,507,152)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	83,833	24.610	2,063,130.130	
	AZRIELI GROUP LTD	2,916	292.500	852,930.000	
	ICL GROUP LTD	52,523	17.750	932,283.250	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,818	927.800	1,686,740.400	
	BANK HAPOALIM BM	85,712	42.700	3,659,902.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	102,278	42.530	4,349,883.340	
	NICE LTD	4,254	671.900	2,858,262.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,481	160.000	1,676,960.000	
イスラエル・シュケル 小計				18,080,092.120 (771,844,556)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	130,838	5.150	673,815.700	
	TELSTRA GROUP LTD	243,639	4.000	974,556.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	179,129	29.420	5,269,975.180	
	SGH LTD	11,606	46.280	537,125.680	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	161,885	3.780	611,925.300	
	BHP GROUP LTD	305,712	40.240	12,301,850.880	
	SOUTH32 LTD	272,748	3.400	927,343.200	

WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	114,396	23.520	2,690,593.920	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,972	18.670	1,903,817.240	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	185,047	38.190	7,066,944.930	
WESTPAC BANKING CORP	206,888	32.640	6,752,824.320	
SANTOS LTD	195,603	6.430	1,257,727.290	
RIO TINTO LTD	22,336	118.510	2,647,039.360	
ORIGIN ENERGY LTD	103,789	10.440	1,083,557.160	
XERO LTD	8,695	171.110	1,487,801.450	
PRO MEDICUS LTD	3,466	257.240	891,593.840	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,391	35.020	503,972.820	
COLES GROUP LTD	80,744	18.800	1,517,987.200	
WISETECH GLOBAL LTD	11,166	120.600	1,346,619.600	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	69,302	16.080	1,114,376.160	
REECE LTD	13,293	23.740	315,575.820	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	92,025	4.230	389,265.750	
SEEK LTD	20,978	24.010	503,681.780	
TREASURY WINE ESTATES LTD	49,025	11.550	566,238.750	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	100,813	161.130	16,243,998.690	
ORICA LTD	29,452	17.410	512,759.320	
QBE INSURANCE GROUP LTD	90,688	18.980	1,721,258.240	
WOOLWORTHS GROUP LTD	73,541	30.820	2,266,533.620	
QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	9.070	402,091.240	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	25,870	53.690	1,388,960.300	
MACQUARIE GROUP LTD	21,855	227.430	4,970,482.650	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,067	69.250	2,359,139.750	
CSL LTD	29,205	278.920	8,145,858.600	
WESFARMERS LTD	68,356	74.300	5,078,850.800	
COCHLEAR LTD	3,939	298.290	1,174,964.310	
BLUESCOPE STEEL LTD	26,558	20.150	535,143.700	
SUNCORP GROUP LTD	76,617	19.350	1,482,538.950	
ASX LTD	11,659	67.200	783,484.800	
COMPUTERSHARE LTD	31,960	33.170	1,060,113.200	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	142,734	8.590	1,226,085.060	
SONIC HEALTHCARE LTD	27,610	28.060	774,736.600	
BRAMBLES LTD	83,864	19.320	1,620,252.480	
CARSales.COM LTD	22,876	38.150	872,719.400	
MINERAL RESOURCES LTD	10,688	34.690	370,766.720	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,801	36.470	393,912.470	
REA GROUP LTD	3,200	243.250	778,400.000	

オーストラリア・ドル 小計				107,499,260.230 (10,462,902,999)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	44,400	80.110	3,556,884.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	20,881	82.810	1,729,155.610	
	IMPERIAL OIL LTD	10,800	94.210	1,017,468.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,200	4,656.930	5,588,316.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	18,087	96.580	1,746,842.460	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,600	85.550	2,275,630.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,450	260.080	2,717,836.000	
	BCE INC	4,130	33.790	139,552.700	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,300	170.310	1,924,503.000	
	SUNCOR ENERGY INC	73,830	51.350	3,791,170.500	
	METRO INC/CN	12,300	91.540	1,125,942.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	20,000	132.580	2,651,600.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	72,600	78.370	5,689,662.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	55,300	94.120	5,204,836.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	102,500	75.210	7,709,025.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	16,500	47.370	781,605.000	
	MEG ENERGY CORP	15,100	23.190	350,169.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	82,950	177.070	14,687,956.500	
	TOURMALINE OIL CORP	20,900	61.520	1,285,768.000	
	TC ENERGY CORP	60,850	65.900	4,010,015.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	34,029	53.000	1,803,537.000	
	BARRICK GOLD CORP	102,700	23.250	2,387,775.000	
	CAE INC	18,800	33.730	634,124.000	
	THOMSON REUTERS CORP	9,241	237.980	2,199,173.180	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,600	44.390	337,364.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,200	125.670	402,144.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,850	73.990	654,811.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	23,900	28.440	679,716.000	
	HYDRO ONE LTD	19,400	44.190	857,286.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,960	192.140	1,721,574.400	
	STANTEC INC	6,600	116.160	766,656.000	
	WSP GLOBAL INC	7,700	248.060	1,910,062.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,900	112.300	550,270.000	
	PARKLAND CORP	8,300	34.330	284,939.000	
	QUEBECOR INC -CL B	9,200	31.140	286,488.000	

EMERA INC	17,000	54.170	920,890.000	
TFI INTERNATIONAL INC	4,800	214.580	1,029,984.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,500	35.150	263,625.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	21,100	45.340	956,674.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	44,400	17.640	783,216.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	29,517	117.000	3,453,489.000	
AIR CANADA	10,200	22.590	230,418.000	
KINROSS GOLD CORP	72,100	13.700	987,770.000	
BANK OF MONTREAL	42,800	140.480	6,012,544.000	
POWER CORP OF CANADA	33,000	45.900	1,514,700.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	71,100	170.880	12,149,568.000	
NUTRIEN LTD	29,019	66.360	1,925,700.840	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	8,000	41.870	334,960.000	
CAMECO CORP	25,600	76.480	1,957,888.000	
FIRSTSERVICE CORP	2,400	267.000	640,800.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,500	63.800	861,300.000	
TELUS CORP	10,800	20.110	217,188.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	26,700	60.220	1,607,874.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,100	154.760	479,756.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	123,800	43.800	5,422,440.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	1,993.680	2,591,784.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,700	62.310	978,267.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,537	228.750	809,088.750	
PAN AMERICAN SILVER CORP	21,400	31.470	673,458.000	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,100	170.750	870,825.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,900	85.220	2,888,958.000	
ENBRIDGE INC	127,700	59.240	7,564,948.000	
BROOKFIELD CORP	80,225	84.440	6,774,199.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	102,900	44.020	4,529,658.000	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	54,720	105.190	5,755,996.800	
IA FINANCIAL CORP INC	5,400	132.450	715,230.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	69.370	575,771.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,350	147.400	4,620,990.000	
CGI INC - CLASS A	12,000	157.090	1,885,080.000	
ONEX CORPORATION	3,600	112.740	405,864.000	
IGM FINANCIAL INC	4,700	46.620	219,114.000	
TMX GROUP LTD	16,400	44.430	728,652.000	
OPEN TEXT CORP	15,400	40.960	630,784.000	
SAPUTO INC	15,000	25.580	383,700.000	

	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,700	18.810	765,567.000	
	FORTIS INC	29,100	59.990	1,745,709.000	
	RB GLOBAL INC	10,800	133.920	1,446,336.000	
	LUNDIN MINING CORP	38,900	12.290	478,081.000	
	CENOVUS ENERGY INC	79,700	21.130	1,684,061.000	
	DOLLARAMA INC	16,500	141.650	2,337,225.000	
	ALTAGAS LTD	17,600	32.150	565,840.000	
	KEYERA CORP	13,500	42.920	579,420.000	
	ARC RESOURCES LTD	34,200	24.380	833,796.000	
カナダ・ドル 小計				179,249,044.240 (19,253,139,841)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	158,800	2.610	414,468.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	85,800	36.700	3,148,860.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	135,140	44.210	5,974,539.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,975	6.390	645,230.250	
	KEPPEL CORP LTD	98,800	6.800	671,840.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	175,200	2.820	494,064.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	229,600	16.950	3,891,720.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	410,000	0.760	311,600.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	503,950	3.130	1,577,363.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	105,900	4.520	478,668.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	60,600	5.400	327,240.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	58,200	12.310	716,442.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,300	3.040	396,112.000	
シンガポール・ドル 小計				19,048,147.150 (2,170,155,404)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	24,336	37.060	901,892.160	
	GALDERMA GROUP N AG	3,485	94.940	330,865.900	
	AVOLTA AG	5,344	36.680	196,017.920	
	UBS GROUP AG-REG	195,634	28.170	5,511,009.780	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,953	273.000	533,169.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	398	621.500	247,357.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,081	22.660	228,435.460	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	41,826	257.800	10,782,742.800	
	SIKA AG-REG	9,038	226.200	2,044,395.600	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	97,800.000	684,600.000	
	ABB LTD-REG	94,086	51.880	4,881,181.680	
	SWISS RE AG	17,985	131.950	2,373,120.750	

	NESTLE SA-REG	155,813	75.220	11,720,253.860	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,313	1,267.000	1,663,571.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,459	257.600	633,438.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,239	58.480	715,736.720	
	SGS SA-REG	8,915	90.520	806,985.800	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,361	250.500	340,930.500	
	TEMENOS AG - REG	3,332	64.650	215,413.800	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,158	145.000	312,910.000	
	VAT GROUP AG	1,568	351.400	550,995.200	
	BKW AG	1,274	148.400	189,061.600	
	ALCON INC	29,765	76.320	2,271,664.800	
	SIG GROUP N AG	17,784	17.830	317,088.720	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,680	160.850	270,228.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,683	551.200	4,786,069.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	163.600	429,286.400	
	CLARIANT AG-REG	12,962	10.180	131,953.160	
	NOVARTIS AG-REG	117,237	88.720	10,401,266.640	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	1,253.000	265,636.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,976	64.050	126,562.800	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	31,964	137.350	4,390,255.400	
	SWISSCOM AG-REG	1,501	507.000	761,007.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,706	82.700	141,086.200	
	GEBERIT AG-REG	2,037	533.800	1,087,350.600	
	GIVAUDAN-REG	532	4,061.000	2,160,452.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,672	118.550	790,965.600	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,042	297.300	904,386.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,027	74.860	675,761.220	
	LONZA GROUP AG-REG	4,286	541.400	2,320,440.400	
	HOLCIM LTD	31,012	88.860	2,755,726.320	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,665	692.000	1,152,180.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,908	202.600	589,160.800	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,478	97.350	435,933.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	9,915.000	584,985.000	
スイス・フラン 小計				83,613,531.490 (14,408,283,746)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	14,863	227.600	3,382,818.800	
	ERICSSON LM-B SHS	188,367	89.860	16,926,658.620	
	VOLVO AB-B SHS	107,747	275.700	29,705,847.900	

SKF AB-B SHARES	23,083	215.400	4,972,078.200	
TELE2 AB-B SHS	37,061	112.900	4,184,186.900	
GETINGE AB-B SHS	15,558	171.400	2,666,641.200	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	107,545	153.850	16,545,798.250	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	98,755	113.400	11,198,817.000	
SWEDBANK AB - A SHARES	57,604	216.200	12,453,984.800	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,431	152.150	5,847,276.650	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	41,123	140.350	5,771,613.050	
SKANSKA AB-B SHS	23,045	235.000	5,415,575.000	
SANDVIK AB	72,305	205.400	14,851,447.000	
INVESTOR AB-B SHS	117,358	295.450	34,673,421.100	
ATLAS COPCO AB-A SHS	182,109	176.800	32,196,871.200	
VOLVO AB-A SHS	13,595	276.400	3,757,658.000	
HOLMEN AB-B SHARES	5,187	413.200	2,143,268.400	
SECURITAS AB-B SHS	33,354	137.250	4,577,836.500	
TELIA CO AB	159,946	30.420	4,865,557.320	
ALFA LAVAL AB	19,616	465.400	9,129,286.400	
ATLAS COPCO AB-B SHS	105,851	155.600	16,470,415.600	
ASSA ABLOY AB-B	67,924	338.800	23,012,651.200	
TRELLEBORG AB-B SHS	14,434	389.200	5,617,712.800	
SAAB AB-B	21,739	223.700	4,863,014.300	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,245	356.200	2,936,869.000	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	44,935	78.060	3,507,626.100	
INDUTRADE AB	18,567	281.800	5,232,180.600	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,243	310.600	4,113,275.800	
LUNDBERGS AB-B SHS	5,174	507.500	2,625,805.000	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,085	276.900	2,792,536.500	
LIFCO AB-B SHS	15,838	334.600	5,299,394.800	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	102,777	42.680	4,386,522.360	
BEIJER REF AB	26,093	169.300	4,417,544.900	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	41,334	297.800	12,309,265.200	
BOLIDEN AB	18,584	321.400	5,972,897.600	
EPIROC AB-A	44,685	203.400	9,088,929.000	
EPIROC AB-B	26,397	179.900	4,748,820.300	
EQT AB	25,224	317.900	8,018,709.600	
EVOLUTION AB	11,473	923.200	10,591,873.600	
HEXAGON AB-B SHS	140,739	105.500	14,847,964.500	
ADDTECH AB-B SHARES	17,593	316.000	5,559,388.000	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	356.000	3,865,804.000	

スウェーデン・クローナ 小計				385,545,843.050 (5,413,063,636)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	213,987	769.900	164,748,591.300	
	DANSKE BANK A/S	46,742	203.600	9,516,671.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	187	11,120.000	2,079,440.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68,428	94.400	6,459,603.200	
	CARLSBERG AS-B	6,514	702.200	4,574,130.800	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	23,918	412.700	9,870,958.600	
	COLOPLAST-B	8,571	816.200	6,995,650.200	
	DSV PANALPINA A/S	13,856	1,516.500	21,012,624.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	599	2,604.000	1,559,796.000	
	DEMANT A/S	6,039	259.000	1,564,101.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	301	11,540.000	3,473,540.000	
	TRYG A/S	22,999	151.800	3,491,248.200	
	PANDORA A/S	5,558	1,258.000	6,991,964.000	
	GENMAB A/S	4,267	1,427.500	6,091,142.500	
	ZEALAND PHARMA A/S	4,339	799.000	3,466,861.000	
	ORSTED A/S	11,406	339.200	3,868,915.200	
デンマーク・クローネ 小計				255,765,237.200 (5,534,759,733)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	88,421	5.740	507,536.540	
	MERCURY NZ LTD	47,473	5.945	282,226.980	
	INFRATIL LTD	62,300	12.380	771,274.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	102,597	8.240	845,399.280	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,694	38.240	1,517,898.560	
ニュージーランド・ドル 小計				3,924,335.360 (347,146,706)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	60,750	229.100	13,917,825.000	
	NORSK HYDRO ASA	95,339	63.860	6,088,348.540	
	ORKLA ASA	47,532	98.600	4,686,655.200	
	TELENOR ASA	41,757	128.400	5,361,598.800	
	EQUINOR ASA	56,779	253.300	14,382,120.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,226	314.900	3,535,067.400	
	MOWI ASA	31,524	199.250	6,281,157.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,578	202.200	2,745,471.600	
	AKER BP ASA	21,464	216.500	4,646,956.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,949	1,276.000	7,590,924.000	

	SALMAR ASA	4,513	561.500	2,534,049.500	
ノルウェー・クローネ 小計				71,770,173.740 (985,404,486)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	51,857	24.900	1,291,239.300	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,125	37.270	1,160,028.750	
	EXOR NV	6,288	89.250	561,204.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,168	59.480	426,352.640	
	DSM FIRMINICH AG	11,673	100.050	1,167,883.650	
	FERROVIAL	29,720	40.740	1,210,792.800	
	LOTUS BAKERIES NV	25	10,780.000	269,500.000	
	SYENQO SA	4,547	72.610	330,157.670	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	14,400	21.800	313,920.000	
	COVESTRO V AG	11,566	58.000	670,828.000	
	BAYER AG-REG	61,899	19.330	1,196,507.670	
	EVONIK INDUSTRIES AG	15,701	16.875	264,954.370	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	119,323	16.790	2,003,433.170	
	COMMERZBANK AG	59,422	15.380	913,910.360	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,012	86.660	1,127,619.920	
	SIEMENS AG-REG	47,898	192.920	9,240,482.160	
	E.ON SE	141,342	11.320	1,599,991.440	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,111	78.360	1,419,177.960	
	GEA GROUP AG	9,811	48.700	477,795.700	
	CONTINENTAL AG	6,941	65.200	452,553.200	
	BASF SE	56,200	43.630	2,452,006.000	
	ALLIANZ SE-REG	24,668	299.100	7,378,198.800	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	10,655	84.700	902,478.500	
	RHEINMETALL AG	2,761	612.800	1,691,940.800	
	RWE AG	39,781	28.330	1,126,995.730	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,885	6.436	243,827.860	
	BRENNTAG SE	7,967	58.160	463,360.720	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	26,647	34.050	907,330.350	
	SAP SE	65,778	239.050	15,724,230.900	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,384	514.200	4,311,052.800	
	ZALANDO SE	14,145	33.930	479,939.850	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,557	123.200	1,054,222.400	
	RATIONAL AG	306	844.500	258,417.000	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	81.800	310,840.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,607	217.300	349,201.100	

TALANX AG	3,951	82.650	326,550.150	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,387	35.690	335,022.030	
DELIVERY HERO SE	11,722	29.200	342,282.400	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,594	47.760	123,889.440	
BECHTLE AG	5,223	31.060	162,226.380	
NEMETSCHEK SE	3,634	91.900	333,964.600	
SCOUT24 AG	4,599	86.200	396,433.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,757	53.300	946,448.100	
KNORR-BREMSE AG	4,442	70.050	311,162.100	
SIEMENS ENERGY AG	40,302	51.100	2,059,432.200	
BEIERSDORF AG	6,274	124.650	782,054.100	
MERCK KGAA	8,107	140.050	1,135,385.350	
ADIDAS AG	10,212	242.200	2,473,346.400	
PUMA SE	6,466	45.000	290,970.000	
HENKEL AG & CO KGAA	6,571	75.000	492,825.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	219,851	29.800	6,551,559.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	12,965	45.100	584,721.500	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,136	54.050	2,547,700.800	
QIAGEN N.V.	13,970	43.220	603,783.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,194	32.985	2,711,169.090	
HANNOVER RUECK SE	3,790	251.000	951,290.000	
DHL GROUP	64,185	34.090	2,188,066.650	
DEUTSCHE BOERSE AG	11,825	225.300	2,664,172.500	
MTU AERO ENGINES AG	3,393	324.400	1,100,689.200	
SYMRISE AG	8,328	104.800	872,774.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,505	72.650	254,638.250	
VONOVIA SE	46,599	29.830	1,390,048.170	
LEG IMMOBILIEN SE	4,566	81.000	369,846.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	50,277	23.830	1,198,100.910	
NN GROUP NV	17,062	41.870	714,385.940	
ARCELORMITTAL	29,514	22.910	676,165.740	
HEINEKEN NV	18,115	69.740	1,263,340.100	
AEGON LTD	85,054	5.616	477,663.260	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	58,511	31.930	1,868,256.230	
AKZO NOBEL N.V.	10,737	56.880	610,720.560	
WOLTERS KLUWER	14,999	163.700	2,455,336.300	
ING GROEP NV	207,983	14.692	3,055,686.230	
KONINKLIJKE KPN NV	241,485	3.567	861,376.990	
ASML HOLDING NV	25,150	703.400	17,690,510.000	

ABN AMRO BANK NV-CVA	28,945	14.485	419,268.320	
IMCD NV	3,592	144.150	517,786.800	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,713	128.500	605,620.500	
ASR NEDERLAND NV	10,012	44.400	444,532.800	
ADYEN NV	1,328	1,503.000	1,995,984.000	
PROSUS NV	85,918	40.350	3,466,791.300	
JDE PEET'S NV	7,685	16.990	130,568.150	
INPOST SA	14,300	16.190	231,517.000	
ASM INTERNATIONAL NV	2,974	551.600	1,640,458.400	
RANDSTAD NV	6,852	40.600	278,191.200	
HEINEKEN HOLDING NV	8,128	58.250	473,456.000	
TOTALENERGIES SE	135,905	51.680	7,023,570.400	
MICHELIN (CGDE)	42,054	32.330	1,359,605.820	
AIR LIQUIDE SA	36,365	158.900	5,778,398.500	
KERING	4,655	239.150	1,113,243.250	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,449	245.900	8,471,009.100	
BOUYGUES SA	11,619	28.530	331,490.070	
BNP PARIBAS	64,063	58.250	3,731,669.750	
THALES SA	5,789	136.500	790,198.500	
DANONE	40,692	64.940	2,642,538.480	
CARREFOUR SA	34,145	13.740	469,152.300	
L'OREAL	15,118	344.850	5,213,442.300	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	28,554	87.040	2,485,340.160	
LEGRAND SA	16,540	94.360	1,560,714.400	
PERNOD RICARD SA	12,803	111.350	1,425,614.050	
EURAZEO SE	2,599	69.100	179,590.900	
REXEL SA	14,143	24.160	341,694.880	
SOCIETE GENERALE SA	45,311	26.690	1,209,350.590	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,330	635.600	11,014,948.000	
ACCOR SA	12,225	46.800	572,130.000	
CAPGEMINI SE	9,805	153.650	1,506,538.250	
PUBLICIS GROUPE	14,406	104.600	1,506,867.600	
BUREAU VERITAS SA	20,039	29.800	597,162.200	
EIFFAGE	4,669	83.900	391,729.100	
SODEXO SA	5,616	80.150	450,122.400	
IPSEN	2,311	110.300	254,903.300	
AMUNDI SA	3,852	64.200	247,298.400	
TELEPERFORMANCE	3,431	80.080	274,754.480	
EURONEXT NV	4,921	108.200	532,452.200	

EUROFINS SCIENTIFIC	8,265	47.410	391,843.650	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,790	186.400	333,656.000	
SEB SA	1,488	89.300	132,878.400	
ESSILORLUXOTTICA	18,689	233.300	4,360,143.700	
DASSAULT AVIATION SA	1,289	189.400	244,136.600	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	6,098	37.620	229,406.760	
AXA SA	110,566	33.740	3,730,496.840	
EDENRED	15,273	31.040	474,073.920	
RENAULT SA	12,080	44.500	537,560.000	
HERMES INTERNATIONAL	2,041	2,303.000	4,700,423.000	
STMICROELECTRONICS NV	43,022	24.510	1,054,469.220	
DASSAULT SYSTEMES SE	42,143	34.270	1,444,240.610	
ORANGE	117,209	9.576	1,122,393.380	
ALSTOM	21,803	22.270	485,552.810	
SANOFI	71,927	91.740	6,598,582.980	
VINCI SA	31,507	99.520	3,135,576.640	
AIRBUS SE	37,456	158.540	5,938,274.240	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,401	27.280	1,211,259.280	
CREDIT AGRICOLE SA	67,084	13.050	875,446.200	
BIOMERIEUX	2,542	101.300	257,504.600	
ENGIE	115,034	14.875	1,711,130.750	
SAFRAN SA	23,010	211.700	4,871,217.000	
ARKEMA	3,434	72.300	248,278.200	
ADP	2,122	111.400	236,390.800	
GETLINK SE	19,144	15.160	290,223.040	
BOLLORE	43,698	5.750	251,263.500	
UCB SA	7,939	185.900	1,475,860.100	
KBC GROUP NV	14,445	72.960	1,053,907.200	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,201	64.950	337,804.950	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,575	49.570	2,804,422.750	
AGEAS	10,078	46.820	471,851.960	
D' IETEREN GROUP	1,322	164.000	216,808.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,802	76.300	137,492.600	
SOFINA	931	213.400	198,675.400	
ARGENX SE	3,739	599.400	2,241,156.600	
PRYSMIAN SPA	17,730	61.080	1,082,948.400	
GENERAL I	58,894	27.650	1,628,419.100	
MEDIOBANCA SPA	31,488	14.330	451,223.040	
TENARIS SA	25,343	18.145	459,848.730	

UNICREDIT SPA	92,732	38.200	3,542,362.400	
UNIPOL GRUPPO SPA	26,800	11.830	317,044.000	
TELECOM ITALIA SPA	612,014	0.273	167,569.430	
INTESA SANPAOLO	921,048	3.866	3,561,232.090	
POSTE ITALIANE SPA	28,013	13.800	386,579.400	
MONCLER SPA	14,751	51.340	757,316.340	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,409	50.600	324,295.400	
ENI SPA	144,794	12.784	1,851,046.490	
BPER BANCA	67,500	6.126	413,505.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	38,820	6.084	236,180.880	
BANCO BPM SPA	81,084	7.960	645,428.640	
DIASORIN SPA	1,344	100.700	135,340.800	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	20,601	9.625	198,284.620	
NEXI SPA	32,152	5.590	179,729.680	
AMPLIFON SPA	7,824	24.750	193,644.000	
LEONARDO SPA	25,455	25.690	653,938.950	
ENEL SPA	512,156	6.955	3,562,044.980	
SNAM SPA	126,955	4.307	546,795.180	
TERNA SPA	88,571	7.690	681,110.990	
FINECOBANK SPA	38,474	16.835	647,709.790	
STELLANTIS NV	122,988	12.758	1,569,080.900	
FERRARI NV	7,916	414.700	3,282,765.200	
TELEFONICA SA	249,904	4.045	1,010,861.680	
ENDESA SA	19,465	20.580	400,589.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	362,894	9.520	3,454,750.880	
IBERDROLA SA	380,468	13.200	5,022,177.600	
BANCO DE SABADELL SA	342,595	1.883	645,106.380	
REPSOL SA	74,479	11.025	821,130.970	
GRIFOLS SA	18,913	9.770	184,780.010	
BANCO SANTANDER SA	975,665	4.460	4,351,465.900	
AMADEUS IT GROUP SA	28,359	67.600	1,917,068.400	
CAIXABANK SA	253,450	5.090	1,290,060.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,247	47.940	539,181.180	
AENA SME SA	4,688	198.300	929,630.400	
CELLNEX TELECOM SA	33,399	30.970	1,034,367.030	
ACCIONA SA	1,472	108.700	160,006.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	68,731	50.200	3,450,296.200	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	24,877	16.570	412,211.890	
UPM-KYMMENE OYJ	33,648	26.080	877,539.840	

	NOKIA OYJ	335,838	4.220	1,417,236.360	
	WARTSILA OYJ ABP	31,673	17.185	544,300.500	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	35,682	9.750	347,899.500	
	ELISA OYJ	8,714	42.120	367,033.680	
	SAMPO OYJ-A SHS	31,415	39.160	1,230,211.400	
	FORTUM OYJ	27,499	13.125	360,924.370	
	KESKO OYJ-B SHS	17,250	18.140	312,915.000	
	KONE OYJ-B	21,393	47.810	1,022,799.330	
	NESTE OYJ	25,885	12.240	316,832.400	
	ORION OYJ-CLASS B	6,816	42.680	290,906.880	
	METSO CORPORATION	38,123	9.016	343,716.960	
	NORDEA BANK ABP	198,712	10.560	2,098,398.720	
	VERBUND AG	4,249	68.700	291,906.300	
	OMV AG	9,024	36.540	329,736.960	
	ERSTE GROUP BANK AG	21,198	58.440	1,238,811.120	
	AIB GROUP PLC	117,515	5.270	619,304.050	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	62,250	8.606	535,723.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,753	69.000	672,957.000	
	JERONIMO MARTINS	17,354	18.530	321,569.620	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	197,570	3.199	632,026.430	
	GALP ENERGIA SGPS SA	29,235	16.680	487,639.800	
	EDP RENOVAVEIS SA	18,553	9.845	182,654.280	
	KERRY GROUP PLC-A	9,656	91.950	887,869.200	
ユーロ 小計				322,240,517.920 (52,003,174,782)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	94,000	50.750	4,770,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	34.250	5,103,250.000	
	MTR CORP	106,000	27.100	2,872,600.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	98,500	74.000	7,289,000.000	
	SINO LAND CO	264,000	7.780	2,053,920.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	182,169	41.300	7,523,579.700	
	WHARF HOLDINGS LTD	73,000	22.400	1,635,200.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	28,000	68.150	1,908,200.000	
	CLP HOLDINGS LTD	111,500	64.150	7,152,725.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	98,507	23.900	2,354,317.300	
	HONG KONG & CHINA GAS	759,475	6.090	4,625,202.750	
	HANG SENG BANK LTD	51,100	93.900	4,798,290.000	
	WH GROUP LTD	565,500	6.260	3,540,030.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,700	300.600	24,559,020.000	

	CK ASSET HOLDINGS LTD	130,669	30.850	4,031,138.650	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	43,000	53.050	2,281,150.000	
	AIA GROUP LTD	741,400	54.700	40,554,580.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	92,000	19.660	1,808,720.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	114,000	19.780	2,254,920.000	
	SANDS CHINA LTD	164,800	21.150	3,485,520.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	93,500	103.800	9,705,300.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	251,000	24.900	6,249,900.000	
香港・ドル 小計				150,557,063.400 (2,979,524,284)	
合計				656,595,315,530 [656,595,315,530]	

(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	2,096,244.780	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	21,007	3,780,419.720	
		BXP INC	9,700	779,492.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,000	1,462,930.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,000	1,600,940.000	
		EQUINIX INC	6,108	5,868,810.720	
		AMERICAN TOWER CORP	30,100	5,817,126.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	45,243	846,948.960	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	21,200	782,280.000	
		KIMCO REALTY CORP	43,400	1,054,620.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,700	867,123.000	
		INVITATION HOMES INC	37,400	1,211,760.000	
		VICI PROPERTIES INC	67,400	2,025,370.000	
		VENTAS INC	26,800	1,613,896.000	
		WEYERHAEUSER CO	46,814	1,375,395.320	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,000	2,656,640.000	
		IRON MOUNTAIN INC	18,900	2,080,701.000	
		SUN COMMUNITIES INC	8,100	994,680.000	
		PROLOGIS INC	59,654	6,494,530.980	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,200	1,043,562.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,900	818,271.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,200	1,235,220.000	
		WELLTOWER INC	39,900	5,156,277.000	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,000	939,150.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,600	1,186,132.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,500	790,625.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	34,800	677,904.000	
	REALTY INCOME CORP	56,095	3,058,299.400	
	PUBLIC STORAGE	10,200	3,196,272.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,000	830,500.000	
	UDR INC	20,200	897,082.000	
	WP CAREY INC	14,100	794,676.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,100	3,903,500.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,700	2,116,513.000	
アメリカ・ドル 小計			70,053,891.880 (10,770,085,337)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	43,890	251,050.800	
	SEGRO PLC	79,485	555,918.090	
イギリス・ポンド 小計			806,968.890 (157,697,860)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	187,089	2,467,703.910	
	APA GROUP	78,315	562,301.700	
	SCENTRE GROUP	313,440	1,093,905.600	
	GPT GROUP	112,602	502,204.920	
	MIRVAC GROUP	238,518	467,495.280	
	STOCKLAND	144,307	718,648.860	
	GOODMAN GROUP	103,698	3,810,901.500	
	VICINITY CENTRES	227,463	466,299.150	
オーストラリア・ドル 小計			10,089,460.920 (982,007,231)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,800	211,056.000	
カナダ・ドル 小計			211,056.000 (22,669,525)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	253,500	646,425.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	395,270	762,871.100	
シンガポール・ドル 小計			1,409,296.100 (160,561,105)	

ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,457	542,720.460	
	GECINA SA	2,908	260,266.000	
	KLEPIERRE	13,182	366,195.960	
	COVIVIO	3,349	163,833.080	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,363	218,851.380	
ユーロ 小計			1,551,866.880 (250,440,277)	
香港・ドル	LINK REIT	174,700	5,791,305.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	257,000	2,433,790.000	
香港・ドル 小計			8,225,095.000 (162,774,630)	
投資証券 合計			12,506,235,965 [12,506,235,965]	
合計			12,506,235,965 [12,506,235,965]	

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	98%	2.0%	79.2%
	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・シェケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 46銘柄	91.4%	8.6%	1.7%
	投資証券 8銘柄			
カナダ・ドル	株式 83銘柄	99.9%	0.1%	2.9%
	投資証券 1銘柄			
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	93.1%	6.9%	0.3%
	投資証券 2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%	-%	0.1%
ユーロ	株式	214銘柄	99.5%	0.5%	7.8%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	22銘柄	94.8%	5.2%	0.5%
	投資証券	2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

	2023年12月18日現在 金 額 (円)	2024年12月18日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,170,100,784	3,171,608,678
コール・ローン	1,716,112,297	1,335,347,355
国債証券	274,040,930,032	324,394,571,828
派生商品評価勘定	251,140	19,916,088
未収入金	-	3,462,085
未収利息	1,877,679,010	2,482,543,434
前払費用	93,256,788	153,891,904
流動資産合計	280,898,330,051	331,561,341,372
資産合計	280,898,330,051	331,561,341,372
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,266,097	337,728
未払金	220,125	14,265
未払解約金	57,540,544	309,636,718
流動負債合計	103,026,766	309,988,711
負債合計	103,026,766	309,988,711

純資産の部		
元本等		
元本	1	82,652,055,717
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		198,143,247,568
元本等合計		280,795,303,285
純資産合計		280,795,303,285
負債純資産合計		280,898,330,051
		331,561,341,372

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19日 至2024年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首	2022年12月20日	2023年12月19日
期首元本額	76,482,606,084円	82,652,055,717円
期中追加設定元本額	11,616,498,414円	16,450,147,562円
期中一部解約元本額	5,447,048,781円	9,555,008,113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V A	378,265,789円	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)	7,319,300円	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)	39,693,753円	30,065,328円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,003,665円	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)	202,530,565円	165,405,939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)	575,818,396円	862,368,326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)	-円	626,597,140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)	800,186,267円	981,378,486円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	3,784,307,962円	6,255,603,498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）	844,233,964円	1,141,672,928円
D - I ' s 外国債券インデックス	2,560,063円	1,854,652円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	19,940,223円	21,957,522円
i F r e e 外国債券インデックス	2,147,340,748円	1,366,095,940円
i F r e e 8資産バランス	2,287,197,948円	2,814,766,620円
i F r e e 年金バランス	501,734,675円	671,427,825円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	297,564円	2,389,602円
D Cダイワ外国債券インデックス	51,328,969,323円	51,472,893,222円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,157,832,760円	1,196,484,774円
ダイワ・ライフ・バランス50	818,375,038円	934,115,462円
ダイワ・ライフ・バランス70	625,354,205円	750,649,313円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）	696,882,920円	742,484,165円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）	550,480,847円	609,463,845円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）	219,646,890円	292,026,114円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	37,370,856円	36,746,467円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	18,942,184円	22,755,567円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,961,861,578円	2,478,042,791円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,614,349円	5,041,201円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,938,861円	2,514,030円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,291,159円	10,205,784円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	1,152,992,870円	2,584,397,859円
ダイワ世界バランスファンド40 V A	94,521,436円	89,069,708円

ダイワ世界バランスファンド 60 V A	26,095,640円	26,929,432円
ダイワ・バランスファンド 35 V A	2,806,836,890円	2,415,693,402円
ダイワ・バランスファンド 25 V A（適格機関投資家専用）	174,580,938円	150,818,032円
スタイル9（4資産分散・保守型）	19,262円	237,164円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	48,912円	2,681,759円
スタイル9（4資産分散・積極型）	50,401円	2,477,850円
スタイル9（6資産分散・保守型）	9,170円	52,155円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	17,475円	1,827,207円
スタイル9（6資産分散・積極型）	8,872円	641,559円
スタイル9（8資産分散・保守型）	8,872円	81,076円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	19,559円	1,766,798円
スタイル9（8資産分散・積極型）	13,635円	2,017,872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）	-円	2,705,214円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	156,788,408円	127,039,766円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	67,315,692円	68,146,721円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワ S M A 専用）	3,217,888,980円	4,105,335,628円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,820,063,374円	6,026,779,896円
ダイワライフスタイル 25	26,705,094円	24,997,512円
ダイワライフスタイル 50	59,474,710円	58,284,801円
ダイワライフスタイル 75	16,603,675円	17,181,528円
計	82,652,055,717円	89,547,195,166円
2. 期末日における受益権の総数	82,652,055,717口	89,547,195,166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19日 至2024年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	6,832,474,204	2,282,920,276
合計	6,832,474,204	2,282,920,276

(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	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,730,758,000	-	1,685,743,043	45,014,957	1,044,836,940	-	1,064,415,300	19,578,360
アメリカ・ドル	315,181,225	-	312,748,847	2,432,378	157,201,956	-	159,885,120	2,683,164
イギリス・ポンド	21,051,745	-	20,843,146	208,599	23,424,418	-	24,157,456	733,038
オフショア・人民元	1,046,331,594	-	1,008,761,922	37,569,672	492,890,369	-	502,671,610	9,781,241
カナダ・ドル	10,070,572	-	10,167,513	96,941	49,991,058	-	50,164,920	173,862
シンガポール・ドル	19,520,002	-	18,838,729	681,273	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	11,630,489	-	11,889,468	258,979
ニュージーランド・ドル	25,779,248	-	25,037,809	741,439	52,620,253	-	52,491,257	128,996

ノルウェー・	-	-	-	-	25,831,178	-	26,163,883	332,705
クローネ								
ポーランド・	27,875,525	-	26,970,398	905,127	-	-	-	-
ズロチ								
メキシコ・ペソ	46,764,863	-	45,544,678	1,220,185	108,926,260	-	112,484,941	3,558,681
ユーロ	218,183,226	-	216,830,001	1,353,225	122,320,959	-	124,506,645	2,185,686
合計	1,730,758,000	-	1,685,743,043	45,014,957	1,044,836,940	-	1,064,415,300	19,578,360

（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）

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.3973円	3.6992円
（1万口当たり純資産額）	(33,973円)	(36,992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	872,766.900	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	746,229.590	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	764,435.160	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	781,237.380	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,532,666.750	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,194,780.720	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	894,076.260	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	543,500.920	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	520,557.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	938,813.040	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,086,887.970	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,054,032.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,185,751.600	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,016,009.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	678,000.000	663,111.120	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,005,061.930	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,412,840.130	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,277,061.060	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,330,915.950	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,366,301.220	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,195,510.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,334,024.850	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,088,123.190	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,029,386.990	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,248,987.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,125,930.820	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,783,546.740	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,789,494.880	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,835,337.950	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,723,702.990	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,102,285.820	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,536,718.560	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,137,678.620	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,863,000.000	2,750,417.370	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,422,767.250	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,418,048.300	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	508,556.890	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,721,041.860	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	807,227.680	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,452,997.410	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,978,076.100	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,163,642.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,849,005.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,083,230.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	747,460.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,491,961.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,788,695.650	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,129,216.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,521,700.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,610,015.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,775,662.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,203,935.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,807,800.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,071,679.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,269,860.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,936,678.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,219,915.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,389,187.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,427,236.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,549,891.000	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,433,787.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,960,850.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,475,145.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,191,460.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,455,175.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,531,674.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,448,425.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,437,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	3,039,709.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,608,319.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,730,196.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,910,750.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,702,644.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,408,375.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,186,854.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,409,870.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,669,604.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,388,850.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,860,650.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,768,776.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,960,235.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,902,800.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,380,350.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,365,600.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,141,720.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,646,424.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	280,509.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,475,552.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,612,856.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,199,552.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	492,980.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	4,000,000.000	2,466,840.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,197,425.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,189,235.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,542,800.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,525,750.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,143,090.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,056,900.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,169,670.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,599,040.000	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,075,396.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,600,440.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,685,260.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,233,196.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,915,992.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,504,100.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,491,400.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,805,050.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,291,740.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,408,371.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,900,795.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,788,350.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,537,100.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,223,072.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,868,690.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,636,080.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,826,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,401,786.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,292,190.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,440,260.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,170,944.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,759,788.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,428,080.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,184,796.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,512,100.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,751,350.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,482,565.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,314,845.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,781,893.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,662,260.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,458,750.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,467,550.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,715,400.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,478,200.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,298,680.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,248,800.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,784,770.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,750,920.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,387,880.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,610,030.000	

1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	5,000,000.000	4,721,650.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,042,184.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,575,760.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,769,280.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,587,030.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,894,682.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,342,377.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,820,750.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,544,200.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,753,900.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,778,750.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,813,750.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,441,703.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,624,600.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,249,215.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,834,940.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,900,970.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,633,400.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,925,540.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,833,560.000	

3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,930,970.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,921,485.700	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,519,885.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,869,216.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,690,340.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,130,545.600	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,429,775.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,330,390.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,457,225.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,490,970.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,992,260.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,609,014.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,337,141.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,964,780.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,455,950.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,970,810.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,302,825.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,491,460.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,494,015.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,910,800.000	

3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,485,195.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,823,800.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,488,905.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,531,200.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,259,375.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,789,900.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,621,153.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	3,949,680.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,978,490.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,510,525.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,745,082.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,631,402.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,986,940.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,889,060.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,953,900.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,966,080.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,258,212.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,719,736.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,252,825.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,626,925.000	

3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,461,645.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,994,780.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,921,880.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,472,630.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,019,100.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,485,370.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,605,100.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,010,980.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,612,100.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,215,452.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,958,030.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,073,960.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,011,280.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,018,210.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,525,425.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,252,542.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,006,420.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,128,520.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,087,600.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,825,726.000	

4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,325,691.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,192,132.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,426,246.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,518,830.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,011,400.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,015,840.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,004,840.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,967,260.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,369,005.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	3,000,000.000	2,999,580.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	5,997,840.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,751,808.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	980,890.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	995,150.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	7,959,904.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	3,990,280.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,153,864.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,931,090.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,588,300.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	5,019,500.000	

4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,196,620.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,001,150.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	4,971,250.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,979,400.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,214,612.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,028,000.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,520,200.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,488,015.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,023,400.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,535,200.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,627,248.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	7,035,000.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,472,630.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,652,808.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,042,750.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,339,169.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,541,805.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,021,680.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,490,750.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	99,910.000	

4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,207,546.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,207,686.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,208,368.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,944,200.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,074,225.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,915,720.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	4,500,000.000	4,253,175.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,867,640.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,667,520.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,462,695.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,865,400.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	978,100.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,442,130.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	773,680.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,206,551.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,297,712.200	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	4,968,750.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	2,300,000.000	2,273,573.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,188,156.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,600,000.000	2,565,056.000	

	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,686,149.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,732,430.000	
アメリカ・ドル 小計			997,167,296.120 (153,304,500,106)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	741,124.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,403,440.700	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	937,640.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,049,510.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	884,547.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,420,696.700	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,365,735.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	728,120.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	666,347.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,150,000.000	556,025.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,285,290.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	703,980.200	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,045,096.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	2,750,000.000	773,850.000	
	0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,437,555.000	
	0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,414,848.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	642,940.000	

0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,489,952.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,929,875.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,500,000.000	705,600.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,518,911.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	817,020.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,329,783.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,324,430.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	4,000,000.000	2,987,920.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	613,990.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,871,756.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	277,619.200	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,988,000.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	907,890.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,389,894.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,010,250.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	831,900.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,209,526.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	2,000,000.000	2,018,180.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,460,250.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,872,184.000	

4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,080,000.000	970,542.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	1,500,000.000	1,465,455.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,079,357.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,100,000.000	1,077,604.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	900,000.000	857,817.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	799,256.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,010,495.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,033,624.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,319,778.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,758,809.710	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,504,064.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,227,487.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,233,182.720	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,012,316.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,356,235.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,196,344.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,743,307.020	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,559,656.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	986,042.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,474,573.850	

	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,256,964.800	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,945,920.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,035,716.220	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,238,707.200	
イギリス・ポンド 小計			85,754,933.720 (16,758,229,147)	
イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,865,412.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,437,864.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,714,698.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,086,368.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,119,528.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,042,616.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,000,000.000	2,162,070.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	191,492.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,872,775.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	1,720,000.000	1,192,441.600	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,950,650.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	969,000.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,471,900.000	
イスラエル・シュケル 小計			23,076,814.600 (985,156,138)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,028,183.300	

3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,320,258.320	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,302,866.460	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,754,362.720	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,045,463.160	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,134,841.960	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	688,303.440	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,622,140.960	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,118,416.760	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	953,761.080	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,440,180.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,801,485.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,666,344.800	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,096,362.500	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,425,729.200	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,202,741.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,679,440.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	764,666.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,034,800.000	
0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,131,576.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,337,856.000	

	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,542,665.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,919,580.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,497,456.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	897,039.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,098,218.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	800,000.000	793,984.000	
オーストラリア・ドル 小計			40,298,720.660 (3,922,274,481)	
オフショア・人 民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,306,496.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,364,600.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,421,550.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,154,250.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,462,000.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,655,360.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,514,410.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	12,216,565.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,547,560.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,767,625.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,166,390.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	9,953,623.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,395,990.000	

3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	22,801,590.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,177,128.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,609,665.000	
2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	18,000,000.000	18,435,600.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,123,950.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,860,910.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,431,150.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,889,790.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,699,620.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	11,882,112.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	21,000,000.000	26,558,070.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,813,060.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	15,053,960.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,334,560.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,404,090.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,731,936.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,843,900.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,435,450.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,979,720.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,373,400.000	

2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,227,720.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,383,960.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	34,061,120.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	10,017,370.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,757,452.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	23,954,970.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,945,830.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	20,204,790.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,803,600.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,574,560.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,336,800.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,980,400.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	26,033,500.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	19,000,000.000	23,725,300.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,107,660.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	42,935,200.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,895,190.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	36,257,900.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	42,526,800.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,485,700.000	

2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	26,011,750.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	21,142,600.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	43,709,760.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,877,800.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	61,321,800.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,786,040.000	
2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,203,760.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,699,000.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	60,212,120.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,621,600.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,415,040.000	
1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,258,700.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	44,000,000.000	45,744,600.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,984,140.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	86,266,500.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	22,011,780.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,360,450.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,930,000.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,621,880.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,472,050.000	

	2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,478,840.000	
	1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,506,880.000	
	1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	10,032,600.000	
	1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,014,290.000	
	1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	13,078,390.000	
	2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,057,140.000	
オフショア・人民元 小計			1,725,401,412.000 (36,400,793,589)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	755,000.000	692,591.700	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,099,731.250	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,332,190.050	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,200,616.560	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,007,796.790	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,003,601.130	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,233,489.460	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	949,571.550	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,185,675.600	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	631,020.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,896,508.300	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,189,060.800	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,148,711.500	

0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,728,180.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,031,771.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	290,343.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,094,884.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,921,674.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,120,822.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,896,111.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,393,050.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	96,843.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,193,772.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,175,545.300	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,321,892.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	599,670.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,655,613.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	817,083.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,212,852.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,010,260.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,874,790.000	
4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,031,220.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,681,776.000	

	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	1,012,720.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,544,580.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	819,048.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	710,654.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	1,100,000.000	1,109,999.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,707,582.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	1,500,000.000	1,483,830.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	800,000.000	800,280.000	
カナダ・ドル 小計			56,907,408.990 (6,112,424,800)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	783,811.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	812,883.200	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	398,400.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	591,856.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	627,975.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	684,422.400	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	445,455.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	708,375.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	547,470.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	616,252.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	454,140.000	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	558,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	416,500.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	194,398.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	236,760.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	659,990.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,290.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	401,400.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	606,000.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	314,439.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	110,209.000	
シンガポール・ドル 小計			10,269,026.200 (1,169,950,155)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,181,831.700	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,059,806.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,857,494.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,343,164.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,042,112.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,437,500.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,944,080.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	1,200,000.000	1,210,800.000	
スウェーデン・クローナ 小計			33,076,788.500 (464,398,110)	

デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,729,177.400	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,930,068.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,848,894.500	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,139,095.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	442,185.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	2,052,980.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,513.000	
デンマーク・クローネ 小計			31,192,912.900 (675,014,636)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	609,726.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,406,670.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	400,462.300	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	577,776.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	449,938.200	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	225,806.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	975,469.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	477,765.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	375,548.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	252,342.800	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	196,528.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	510,370.000	

	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	688,142.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	497,485.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,255,917.000	
ニュージーランド・ドル 小計			8,899,946.100 (787,289,232)	
ノルウェー・ク ローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,214,140.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,257,270.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,308,095.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,525,599.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,238,736.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,996,840.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,528,572.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,404,100.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,421,610.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,470,215.000	
ノルウェー・クローネ 小計			32,365,177.500 (444,373,887)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,208,222.880	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,967,627.200	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,287,175.200	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,364,120.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,016,652.000	

	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,377,990.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	484,805.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,342,700.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,056,900.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,874,900.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,938,540.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,218,795.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	1,985,700.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	901,320.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	835,666.960	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,370,994.000	
ポーランド・ズロチ 小計			43,232,108.240 (1,634,212,601)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,374,305.150	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,513,221.340	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,534,772.080	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,336,309.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,229.590	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,429,725.570	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,896,297.560	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,443,806.000	

4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,263,615.000	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,013,755.800	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,565,686.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,203,006.700	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,105,727.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,335,828.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,190,920.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	655,590.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,334,717.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,340,604.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,001,620.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,702,627.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,614,834.500	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,685,376.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,381,324.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,052,361.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,175.000	
4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,463,294.000	
3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	999,280.000	
4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,213,164.000	

	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	813,592.000	
マレーシア・リングット 小計			46,721,763.790 (1,610,158,129)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	35,685,411.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	16,723,695.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,437,200.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	28,621,350.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	25,691,100.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	22,088,970.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,356,750.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,548,300.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,709,719.680	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	8,782,242.840	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,231,064.640	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	16,432,300.740	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,242,450.300	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	23,130,120.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	6,780,442.320	
メキシコ・ペソ 小計			299,461,116.820 (2,283,031,662)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	328,601.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	793,425.630	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	272,095.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	766,168.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	411,423.900	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	469,140.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	459,695.000	

0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	231,318.900	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	268,752.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	436,830.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	197,260.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	514,470.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	192,744.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	298,453.500	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	742,000.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	265,253.400	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	396,752.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	309,150.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,023,080.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	402,576.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	102,847.000	
2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	503,825.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	610,769.420	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	609,991.200	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	152,596.800	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,232,422.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	428,500.800	

0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,147,164.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,190,348.800	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	868,574.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	739,404.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	256,692.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	156,019.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,034,484.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	448,932.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	144,549.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,652,814.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,343,535.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	247,869.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	299,319.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,332,435.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	520,610.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,025,640.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	844,936.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	511,435.000	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	520,465.000	
2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	806,536.000	

1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,612,654.700	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	663,462.240	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,437,178.050	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	916,355.280	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	549,316.800	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,063,524.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	448,862.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	504,510.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,417,839.300	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	582,491.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,407,255.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	506,667.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	193,844.200	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	573,207.200	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,128,144.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,344,768.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	221,010.000	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,182,748.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	516,544.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	770,832.000	

3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,531,050.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	588,534.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	721,490.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,102,475.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	1,013,060.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,390.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,296,665.370	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,394,328.520	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,039,689.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,337,941.830	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,635,715.360	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,806,406.650	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	771,000.000	902,756.190	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,326,571.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,253,952.680	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,304,983.180	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,724,681.280	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,703,057.420	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,092,976.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,342,777.800	

0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,122,758.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,181,233.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,739,773.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,818,262.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,860,314.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,387,074.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,741,250.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,549,288.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,581,982.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,662,255.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,891,020.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,611,234.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,074,408.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,681,063.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,845,792.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,854,600.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	925,548.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,400,176.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	612,759.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,283,162.000	

1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,344,352.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,626,587.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	2,042,432.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,207,808.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,428,536.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,720,995.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	870,780.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,480,712.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,526,940.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,399,880.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,800,000.000	1,819,026.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	500,000.000	508,715.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,613,190.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,089,816.000	
3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	302,529.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	803,832.000	
2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	809,384.000	
2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,010,920.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	99,928.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,143,394.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,702,672.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,962,608.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,948,640.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	422,720.100	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	100,730.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,486.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,296.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,103,531.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,200.700	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,725,780.830	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,227,000.000	2,680,372.660	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,058,700.880	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	3,207,522.240	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,575,410.160	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,630,310.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,867,992.980	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,706,268.380	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,160,799.880	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,088,000.000	1,066,849.280	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,061,259.780	

1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,761,651.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,281,580.390	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,430,920.240	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	873,823.870	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,901,770.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,301,565.300	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,299,258.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,967,376.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,109,534.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,426,528.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,634,041.500	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,913,946.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	6,350,000.000	5,816,536.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,708,264.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,457,684.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,922,240.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,461,658.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,280,400.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	529,307.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,000,000.000	1,791,330.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,811,744.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,800,000.000	4,573,344.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,336,868.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,931,480.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,357,790.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,086,806.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,852,073.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	880,370.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,894,221.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,215,104.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,629,026.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,339,431.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,335,200.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	650,076.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,113,981.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,131,072.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	1,006,340.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	2,700,000.000	2,693,979.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,252,820.270	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,018,741.400	

3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,998,568.390	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,484,309.480	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,987,641.600	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	134,686.620	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,129,314.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,286,995.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,100,712.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	892,260.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,239,406.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,205,700.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	642,500.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,122,836.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	643,788.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	825,525.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	97,739.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	525,096.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	1,062,996.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	907,452.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,318,551.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	657,822.000	

2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	1,004,100.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,210,421.700	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,661,100.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,390,966.020	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,889,000.050	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,883,599.040	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,352,544.900	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,363,690.900	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,066,152.200	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,047,430.320	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	771,050.720	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,422,555.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,505,877.700	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,556,989.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,680,074.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,216,189.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,073,540.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,577,336.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,275,080.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,450,377.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,947,009.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,094,981.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,170,725.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,770,458.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,282,226.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,207,651.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,230,525.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,808,480.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,962,261.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,116,950.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,666,289.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,158,210.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,682,963.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	791,316.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	527,331.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,769,337.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,549,638.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,517,142.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,068,705.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	660,000.000	435,613.200	

0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	745,784.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,661,284.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,989,547.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	863,770.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,383,498.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	573,928.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	291,732.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	805,120.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,536,576.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,226,630.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	201,262.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,596,270.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,339,468.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,061,436.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	315,441.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,541,655.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,738,032.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	876,512.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	509,230.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	960,426.000	

3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,252,788.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,286,354.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	729,764.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	922,455.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,260,335.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,590,435.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	633,930.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,384.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,032,300.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,110,100.000	
3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	100,887.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	411,072.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	732,543.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	52,856.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	500,000.000	513,880.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,538,325.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,174.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	521,450.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	202,330.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	736,141.000	

3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,309,542.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	805,104.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,402,925.040	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,367,603.470	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,141,181.250	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,625,717.780	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,903,276.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,783,150.160	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,588,534.150	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,122,971.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,597,859.500	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,053,802.660	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,409,676.900	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,527,080.900	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,263,341.920	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,104,000.000	1,255,623.360	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,028,267.240	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	850,239.000	

3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	690,639.870	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	761,372.280	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	969,264.600	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	827,333.150	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,056,250.470	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	495,319.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	770,048.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	687,900.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	710,040.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	907,487.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	466,860.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	282,047.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	478,685.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	711,568.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	683,608.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	286,776.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,859.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	209,302.000	
2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	302,382.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	908,217.750	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,568,254.330	
4.85% Austria Government Bond 20260315	300,000.000	309,660.000	

3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	406,049.540	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	748,572.510	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	757,484.370	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	396,511.590	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	393,906.810	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,028,557.480	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,993,210.200	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,723,762.460	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,808,157.120	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,050,000.000	1,017,271.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,589,629.500	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,869,790.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,692,880.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,003,649.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,330,016.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,945,834.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,807,722.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,537,856.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	2,025,022.500	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,479,964.000	

0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,307,481.600	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	826,322.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	400,000.000	385,316.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,232,864.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	968,461.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	487,570.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,883,970.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	344,812.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,328,000.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	535,682.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,650,530.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	417,492.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	859,230.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,828,008.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,154,496.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,345,048.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,680,484.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,008,200.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,673,086.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,317,572.000	

3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,260,209.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,584,060.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	626,766.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,678,936.000	
2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,112.000	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,081,350.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,672,400.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	400,000.000	411,608.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	201,968.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,636,895.060	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,954,903.160	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,226,534.300	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,327,153.500	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,078,753.850	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,950,079.800	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,631,829.780	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	550,000.000	619,454.000	
4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	712,606.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	850,197.600	
3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	680,985.900	

	2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,300,845.000	
	4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	470,000.000	534,197.300	
	2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	697,312.800	
	1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	991,120.000	
	0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	813,501.000	
	0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	597,698.600	
	0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	550,000.000	454,657.500	
	1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	530,000.000	322,812.400	
	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	653,407.500	
	1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	386,516.000	
	1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	538,461.900	
	3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	530,805.000	
	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	638,467.200	
	3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	254,954.400	
	ユーロ 小計		606,288,047.810 (97,842,765,155)	
国債証券 合計			324,394,571,828 [324,394,571,828]	
合計			324,394,571,828 [324,394,571,828]	

（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%	47.3%
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シェケル	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%	11.2%
カナダ・ドル	国債証券 41銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 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・リンギット	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。

「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

	2023年12月18日現在 金 額（円）	2024年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,490,491,252	6,739,841,082
投資証券 2	396,524,083,100	253,282,199,744
未収入金	3,845,463,875	1,090,085,949
未収配当金	2,183,738,409	1,671,925,406
前払金	28,280,000	58,240,000

差入委託証拠金	522,937,908	477,207,668
流動資産合計	406,594,994,544	263,319,499,849
資産合計	406,594,994,544	263,319,499,849
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	115,696,000	81,256,000
未払解約金	55,330,000	1,036,039,000
流動負債合計	171,026,000	1,117,295,000
負債合計	171,026,000	1,117,295,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 126,407,264,091	86,235,422,547
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	280,016,704,453	175,966,782,302
元本等合計	406,423,968,544	262,202,204,849
純資産合計	406,423,968,544	262,202,204,849
負債純資産合計	406,594,994,544	263,319,499,849

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19日 至2024年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首	2022年12月20日	2023年12月19日
期首元本額	147,074,195,757円	126,407,264,091円
期中追加設定元本額	15,840,714,197円	6,954,092,175円
期中一部解約元本額	36,507,645,863円	47,125,933,719円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	4,182,047,912円	3,409,516,133円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	108,317,971,329円	65,612,425,608円
（毎月分配型）		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	435,013,976円	740,904,069円
（年1回決算型）		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー	20,894,901円	26,039,587円
2050		
ｉＦｒｅｅＪ－ＲＥＩＴイン	676,381,336円	602,624,144円
デックス		
ｉＦｒｅｅ８資産バランス	2,387,649,719円	3,343,787,945円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	2,514,869円	106,813,641円
（奇数月決算型）		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー	50,619円	402,452円
2060		
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオー	5,432,509,358円	5,235,391,280円
ブン		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー	8,504,119円	9,854,023円
2030		
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー	8,667,097円	10,974,561円
2040		
ダイワ国内ＲＥＩＴインデック	3,390,101円	5,833,615円
ス（投資一任専用）		
ダイワ・ノーロードＪ－ＲＥＩ	98,969,094円	80,451,279円
Ｔファンド		

	ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス	2,960,929,609円	4,413,686,051円
	ダイワ J - R E I T インデックス (ダイワ S M A 専用)	531,516,611円	1,316,355,536円
	ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス	483,088,653円	635,940,818円
	スタイル9 (6資産分散・保守型)	12,261円	78,153円
	スタイル9 (6資産分散・バランス型)	26,062円	3,016,134円
	スタイル9 (6資産分散・積極型)	19,007円	1,622,065円
	スタイル9 (8資産分散・保守型)	10,721円	106,132円
	スタイル9 (8資産分散・バランス型)	23,012円	2,184,396円
	スタイル9 (8資産分散・積極型)	7,948円	1,188,682円
	ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T	857,065,777円	676,226,243円
計		126,407,264,091円	86,235,422,547円
2.	期末日における受益権の総数	126,407,264,091口	86,235,422,547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 1,652,550,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 679,000,000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19日 至2024年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）

投資証券	17,958,716,272	21,350,591,373
合計	17,958,716,272	21,350,591,373

（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	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	10,018,680,000	-	9,903,600,000	115,080,000	9,004,240,000	-	8,923,600,000	80,640,000
合計	10,018,680,000	-	9,903,600,000	115,080,000	9,004,240,000	-	8,923,600,000	80,640,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.2152円	3.0405円
（1万口当たり純資産額）	(32,152円)	(30,405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	5,964	648,286,800	
	サンケイリアルエステート	8,633	633,662,200	
	SOSILA物流リート投	13,445	1,380,801,500	
	東海道リート投資法	4,604	472,370,400	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	9,305	5,294,545,000	
	森ヒルズリート	31,689	3,847,044,600	
	産業ファンド	49,340	5,516,212,000	
	アドバンス・レジデンス	26,484	7,571,775,600	
	A P I 投資法人	13,098	4,093,125,000	
	G L P 投資法人	90,518	10,970,781,600	
	コンフォリア・レジデンシャル	13,645	3,693,701,500	
	日本プロロジスリート	46,945	10,384,234,000	
	星野リゾート・リート	11,397	2,548,369,200	
	O n e リート投資法人	4,701	1,046,912,700	
	イオンリート投資	33,056	4,065,888,000	
	ヒューリックリート投資法	23,812	3,078,891,600	
	日本リート投資法人	8,753	2,652,159,000	
	積水ハウス・リート投資	80,977	6,024,688,800	
	トーセイ・リート投資法人	5,859	713,626,200	
	ヘルスケア&メディカル投資	6,644	684,332,000	
	サムティ・レジデンシャル	7,342	653,438,000	
	野村不動産マスターF	86,262	11,714,379,600	
	いちごホテルリート投資	4,460	666,770,000	
	ラサールロジポート投資	34,501	4,785,288,700	
	スターアジア不動産投	49,660	2,502,864,000	
	マリモ地方創生リート	4,893	514,254,300	
	三井不ロジパーク	58,740.944	5,827,101,644	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法 人	5,683	354,050,900	
	投資法人みらい	37,108	1,452,778,200	
	三菱地所物流REIT	9,305	3,135,785,000	
	CREロジスティクスファンド	11,601	1,604,418,300	
	ザイマックス・リート	4,614	507,078,600	
	タカラレーベン不動産投	17,599	1,462,476,900	
	日本ビルファンド	157,186	19,302,440,800	

ジャパンリアルエステイト	27,681	14,920,059,000	
日本都市ファンド投資法人	139,736	12,059,216,800	
オリックス不動産投資	53,694	8,655,472,800	
日本プライムリアルティ	18,429	5,888,065,500	
NTT都市開発リート投資法人	27,390	3,182,718,000	
東急リアル・エステート	18,068	2,780,665,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	19,515	1,863,682,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	60,281	8,168,075,500	
森トラストリート投資法人	51,943	3,100,997,100	
インヴィンシブル投資法人	148,474	9,680,504,800	
フロンティア不動産投資	9,999	3,894,610,500	
平和不動産リート	19,760	2,278,328,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	18,106	4,682,211,600	
福岡リート投資法人	15,205	2,134,782,000	
KDX不動産投資法人	75,392	10,901,683,200	
いちごオフィスリート投資法人	19,663	1,512,084,700	
大和証券オフィス投資法人	11,165	3,219,986,000	
阪急阪神リート投資法人	12,848	1,518,633,600	
スターツプロシード投資法人	4,671	798,741,000	
大和ハウスリート投資法人	40,414	9,117,398,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	99,000	7,009,200,000	
大和証券リビング投資法人	39,801	3,458,706,900	
ジャパンエクセレント投資法人	23,140	2,651,844,000	
投資証券 合計		253,282,199,744	
合計		253,282,199,744	

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

	2023年12月18日現在 金 額（円）	2024年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	530,744,114	384,813,214
コール・ローン	201,790,101	477,425,849
投資信託受益証券	1,190,063,836	2,436,751,481
投資証券	34,096,995,311	44,581,526,801
派生商品評価勘定	53,139,370	10,905,213
未収入金	162,779,094	8,188,260
未収配当金	120,067,844	152,190,003
差入委託証拠金	286,867,758	458,266,664
流動資産合計	36,642,447,428	48,510,067,485
資産合計	36,642,447,428	48,510,067,485
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,624,652	11,154,736
未払金	251,754,199	70,119,584
未払解約金	16,411,000	22,453,000
流動負債合計	274,789,851	103,727,320
負債合計	274,789,851	103,727,320
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,445,718,817	11,802,580,977
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,921,938,760	36,603,759,188
元本等合計	36,367,657,577	48,406,340,165
純資産合計	36,367,657,577	48,406,340,165
負債純資産合計	36,642,447,428	48,510,067,485

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19日 至2024年12月18日
----	------------------------------

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首	2022年12月20日	2023年12月19日
期首元本額	9,133,427,619円	10,445,718,817円
期中追加設定元本額	2,187,181,975円	2,291,480,579円
期中一部解約元本額	874,890,777円	934,618,419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）	92,408,770円	81,228,434円
ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジ なし）	1,721,650,522円	2,220,179,211円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス （為替ヘッジなし）	271,581,866円	348,458,085円
D - I ' s グローバル R E I T インデックス	1,522,467円	1,418,982円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2050	17,406,934円	19,354,919円
i F r e e 外国 R E I T イン デックス	708,540,551円	639,683,559円
i F r e e 8 資産バランス	2,396,093,659円	2,505,567,342円

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	369,788,330円	399,772,618円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	254,293,639円	233,694,425円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	556,964円	3,988,687円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,036,311,343円	4,465,154,844円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	8,311,324円	7,266,352円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,548,978円	8,113,100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）	3,261,395円	4,512,917円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	143,999,267円	128,911,402円
スタイル9（6資産分散・保守型）	9,610円	36,802円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	20,459円	1,875,063円
スタイル9（6資産分散・積極型）	22,574円	1,571,462円
スタイル9（8資産分散・保守型）	8,401円	45,990円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	18,041円	1,219,504円
スタイル9（8資産分散・積極型）	9,006円	1,269,394円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	239,359,246円	188,715,773円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	66,749,561円	61,268,444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）	13,065,384円	241,581,630円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	92,180,526円	80,995,964円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	-円	78,847,818円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	-円	77,848,256円

計	10,445,718,817円	11,802,580,977円
2. 期末日における受益権の総数	10,445,718,817口	11,802,580,977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19日 至2024年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	85,687,359	113,934,008
投資証券	2,838,757,054	2,303,581,204
合計	2,924,444,413	2,417,515,212

（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	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	1,029,127,460	-	1,082,266,830	53,139,370	1,454,680,152	-	1,443,525,416	11,154,736
合計	1,029,127,460	-	1,082,266,830	53,139,370	1,454,680,152	-	1,443,525,416	11,154,736

（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。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2023年12月18日現在				2024年12月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	191,748,233	-	185,123,581	6,624,652	510,745,240	-	521,650,453	10,905,213
アメリカ・ドル	107,228,605	-	103,382,162	3,846,443	348,313,004	-	355,763,494	7,450,490
ユーロ	75,405,578	-	72,628,019	2,777,559	162,432,236	-	165,886,959	3,454,723
香港・ドル	9,114,050	-	9,113,400	650	-	-	-	-
合計	191,748,233	-	185,123,581	6,624,652	510,745,240	-	521,650,453	10,905,213

（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)

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.4816円	4.1013円
(1万口当たり純資産額)	(34,816円)	(41,013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	170,300	15,849,821.000	
	アメリカ・ドル 小計			15,849,821.000 (2,436,751,481)	
投資信託受益証券 合計				2,436,751,481 [2,436,751,481]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,585	341,746.650	
		URBAN EDGE PROPERTIES	23,660	527,144.800	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,880	317,086.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,797	6,308,251.180	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	60,130	10,820,994.800	
		BXP INC	28,462	2,287,206.320	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,900	213,891.000	
		VORNADO REALTY TRUST	32,400	1,450,872.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTY	18,648	217,062.720	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,656	561,944.400	
		UNITI GROUP INC	46,942	275,080.120	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,288	191,544.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	66,857	4,865,183.890	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,798	701,643.960	
		EPR PROPERTIES	14,806	664,641.340	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	42,375.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	37,994	276,976.260	
		EQUINIX INC	18,606	17,877,389.040	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18,098	508,734.780	

CHATHAM LODGING TRUST	8,953	85,948.800	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,743	1,301,241.830	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	24,893	434,382.850	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,748	89,499.800	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	35,741.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	137,786	2,579,353.920	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	61,689	2,276,324.100	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,116	84,873.080	
RLJ LODGING TRUST	30,035	317,770.300	
FARMLAND PARTNERS INC	7,936	100,152.320	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	13,053	141,363.990	
KIMCO REALTY CORP	132,185	3,212,095.500	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,995	101,477.700	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	71,003	1,243,262.530	
WHITESTONE REIT	8,817	134,194.740	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	53,836	2,637,425.640	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU- A	23,773	224,179.390	
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,784	631,744.160	
INVITATION HOMES INC	111,725	3,619,890.000	
OUTFRONT MEDIA INC	26,900	493,884.000	
LAMAR ADVERTISING CO-A	17,200	2,210,028.000	
JBG SMITH PROPERTIES	16,961	279,347.670	
ALEXANDER & BALDWIN INC	14,194	264,718.100	
GLADSTONE LAND CORP	6,132	68,985.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	51,043	1,139,279.760	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	40,915.140	
VICI PROPERTIES INC	205,400	6,172,270.000	
BRT APARTMENTS CORP	2,049	38,931.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,539	560,879.140	

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	34,295	1,120,760.600	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,517	143,574.700	
BROADSTONE NET LEASE INC	36,819	617,454.630	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,816	143,630.400	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,128	251,020.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	43,931	930,458.580	
PARAMOUNT GROUP INC	35,039	173,443.050	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	26,374	291,696.440	
NETSTREIT CORP	14,791	220,829.630	
CTO REALTY GROWTH INC	3,700	75,961.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	42,824	1,709,534.080	
STAG INDUSTRIAL INC	35,577	1,258,714.260	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	35,659.160	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,925	52,830.500	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	23,963	933,598.480	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	36,463.440	
DIGITAL CORE REIT UNITS	169,000	98,020.000	
VENTAS INC	81,045	4,880,529.900	
CARETRUST REIT INC	32,800	935,784.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	14,800	456,580.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	59,091	1,692,957.150	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	9,465.980	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	45,776	807,946.400	
UMH PROPERTIES INC	13,139	253,714.090	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,816	86,535.680	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	6,019	42,373.760	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,900	89,976.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,829	91,687.890	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	29,100	824,985.000	

LINEAGE INC	11,600	702,554.000	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	25,104.000	
CURLINE PROPERTIES	18,444	427,531.920	
IRON MOUNTAIN INC	57,513	6,331,606.170	
TERRENO REALTY CORP	18,927	1,173,095.460	
SUN COMMUNITIES INC	22,907	2,812,979.600	
ACADIA REALTY TRUST	20,544	516,887.040	
ALEXANDER'S INC	393	83,842.620	
PROLOGIS INC	181,600	19,770,792.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30,460	3,116,362.600	
BRANDYWINE REALTY TRUST	33,041	192,959.440	
SAUL CENTERS INC	2,261	90,824.370	
VERIS RESIDENTIAL INC	15,496	271,644.880	
CAMDEN PROPERTY TRUST	20,868	2,474,736.120	
COUSINS PROPERTIES INC	29,716	929,516.480	
SITE CENTERS CORP	9,022	139,119.240	
EASTGROUP PROPERTIES INC	9,542	1,600,384.240	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,567	3,695,954.700	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,842	1,344,042.420	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,663	1,676,420.790	
GETTY REALTY CORP	9,698	311,693.720	
WELLTOWER INC	113,535	14,672,128.050	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	138,040	2,880,894.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,674	646,062.500	
SERVICE PROPERTIES TRUST	30,381	77,775.360	
EQUITY COMMONWEALTH	20,957	35,207.760	
KILROY REALTY CORP	20,667	868,634.010	
LTC PROPERTIES INC	8,490	309,969.900	
LXP INDUSTRIAL TRUST	57,532	505,130.960	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,891	3,572,598.370	
MACERICH CO/THE	46,000	982,560.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,566	2,513,912.500	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,456	606,887.120	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	35,942	1,505,250.960	
REALTY INCOME CORP	170,816	9,312,888.320	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	21,964	705,922.960	

	PUBLIC STORAGE	30,903	9,683,764.080	
	REGENCY CENTERS CORP	32,007	2,416,528.500	
	SAFEHOLD INC	8,705	180,976.950	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	21,335	755,472.350	
	SL GREEN REALTY CORP	13,762	1,019,901.820	
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,467	98,739.480	
	UDR INC	58,860	2,613,972.600	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,429	93,710.820	
	WP CAREY INC	42,876	2,416,491.360	
	ELME	16,897	268,662.300	
	AGREE REALTY CORP	19,686	1,443,180.660	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,553	1,988,755.020	
	CUBESMART	44,111	2,008,814.940	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,752	492,129.760	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	60,304	11,156,240.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	41,521	6,414,579.290	
	CENTERSPACE	2,959	202,070.110	
	KITE REALTY GROUP TRUST	42,907	1,115,152.930	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,892	83,202.840	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,128	135,493.760	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	40,119	389,154.300	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,379	465,994.630	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	33,290.400	
	DOUGLAS EMMETT INC	32,658	663,610.560	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	33,482.870	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	29,089.500	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	155,920	27,130.080	
アメリカ・ドル 小計			230,349,580.770 (35,413,944,547)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	77,771	62,139.020	
	HELICAL PLC	20,666	38,397.420	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	23,249.000	

	HAMMERSON REIT PLC	93,880	264,366.080	
	ASSURA PLC	615,774	235,964.590	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	121,852	101,015.300	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	7,312.720	
	CLS HOLDINGS PLC	29,656	23,902.730	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	112,420	72,735.740	
	REGIONAL REIT LTD	31,830	37,495.740	
	NEWRIVER REIT PLC	59,545	46,861.910	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	400,976	508,437.560	
	CUSTODIAN REIT PLC	90,504	69,326.060	
	PRS REIT PLC/THE	107,892	114,797.080	
	CARE REIT PLC	85,680	69,400.800	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	37,508.060	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	125,239	104,198.840	
	AEW UK REIT PLC	27,617	27,948.400	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	255,846	177,557.120	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	95,301	99,303.640	
	HOME REIT PLC	117,587	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	154,025	881,023.000	
	SEGR0 PLC	279,635	1,955,767.190	
	UNITE GROUP PLC/THE	85,276	691,161.980	
	BRITISH LAND CO PLC	206,235	737,083.890	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	83,989	248,607.440	
	DERWENT LONDON PLC	23,052	454,585.440	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	276,353	253,830.230	
	WORKSPACE GROUP PLC	28,401	143,425.050	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	44,854	299,848.990	
	BIG YELLOW GROUP PLC	40,322	389,107.300	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	422,277	764,321.370	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	46,149.100	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	509,269	672,235.080	
イギリス・ボンド 小計			9,659,063.870 (1,887,574,262)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	156,103	312,206.000	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	46,479	453,635.040	

	REIT 1 LTD	40,686	800,700.480	
イスラエル・シュケル 小計			1,566,541.520 (66,876,128)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	230,363	1,541,128.470	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	91,312.590	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	115,395	131,550.300	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	71,065	182,637.050	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	274,625	101,611.250	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	111,495	319,990.650	
	RURAL FUNDS GROUP	79,145	137,712.300	
	WAYPOINT REIT	142,830	342,792.000	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	142,454	531,353.420	
	CENTURIA OFFICE REIT	86,351	98,440.140	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	175,165	321,778.100	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	383,161	448,298.370	
	REGION GROUP	248,839	532,515.460	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	55,242	134,238.060	
	NATIONAL STORAGE REIT	291,323	690,435.510	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	43,255	112,895.550	
	SCENTRE GROUP	1,112,672	3,883,225.280	
	ARENA REIT	82,725	318,491.250	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	41,492	157,254.680	
	BWP TRUST	116,344	390,915.840	
	GPT GROUP	410,276	1,829,830.960	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	109,971	355,206.330	
	MIRVAC GROUP	845,119	1,656,433.240	
	STOCKLAND	511,281	2,546,179.380	
	ABACUS GROUP UNIT	90,924	102,744.120	
	GOODMAN GROUP	406,123	14,925,020.250	
	VICINITY CENTRES	828,750	1,698,937.500	
	CHARTER HALL GROUP	101,305	1,480,066.050	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	79,716	377,056.680	
オーストラリア・ドル 小計			35,440,050.780 (3,449,380,143)	

カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	54,250.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	9,941	159,254.820	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	72,324.000	
	SLATE GROCERY REIT	6,100	87,718.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,400	218,860.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	52,689.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	25,600	119,040.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,500	473,915.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	28,200	344,886.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,800	154,660.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	22,200	391,386.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	34,400	473,000.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	67,944.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,200	164,864.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	15,100	383,540.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17,400	765,078.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,766	260,433.180	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,200	581,568.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	29,947.500	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,100	343,638.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	11,000	152,680.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,100	235,276.000	

カナダ・ドル 小計			5,586,951.500 (600,094,461)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	380,983	819,113.450	
	AIMS APAC REIT	134,700	168,375.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	623,090	551,434.650	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	114,700	79,716.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	363,740	198,238.300	
	EC WORLD REIT	36,500	5,110.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	753,377	1,921,111.350	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,157,522	2,234,017.460	
	SUNTEC REIT	465,200	553,588.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	716,900	910,463.000	
	KEPPEL REIT	508,800	432,480.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	544,056	478,769.280	
	ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,271,302	324,182.010	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,400	121,040.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	250,276	530,585.120	
	STARHILL GLOBAL REIT	293,700	145,381.500	
	CAPITALAND CHINA TRUST	242,242	173,203.030	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	82,300	302,864.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	440,069	976,953.180	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	492,084	595,421.640	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	217,000	132,370.000	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	469,400	131,432.000	
シンガポール・ドル 小計			11,785,849.470 (1,342,761,830)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	218,742	440,765.130	
ニュージーランド・ドル 小計			440,765.130 (38,990,083)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,680	172,416.000	

	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,201	187,496.050	
	HAMBORNER REIT AG	12,056	76,314.480	
	WERELDHAVE NV	6,098	83,054.760	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,741	1,291,189.980	
	NSI NV	3,090	59,698.800	
	ICADE	5,324	114,998.400	
	CARMILA	9,521	150,812.640	
	ALTAREA	837	77,422.500	
	GECINA SA	9,170	820,715.000	
	KLEPIERRE	38,853	1,079,336.340	
	COVIVIO	9,424	461,022.080	
	MERCIALYS	15,523	155,385.230	
	AEDIFICA	8,364	460,020.000	
	COFINIMMO	6,701	356,493.200	
	RETAIL ESTATES	2,180	126,004.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,099	598,966.740	
	CARE PROPERTY INVEST	6,301	69,689.060	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,912	172,926.000	
	MONTEA NV	3,565	222,812.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,559	25,187.960	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,412	69,483.120	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	59,589	305,393.620	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	69,411	698,274.660	
	CROMWELL REIT EUR	59,320	93,725.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	88,042	78,181.290	
ユーロ 小計			8,007,020.010 (1,292,172,889)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	29,133	130,224,510.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,401	122,413,720.000	
	LOTTE REIT CO LTD	29,483	93,313,695.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	44,436,660.000	
	JR REIT XXVII	37,352	110,748,680.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	40,519,675.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	33,975	146,432,250.000	

韓国・ウォン 小計			688,089,190.000 (73,625,543)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	501,000	480,960.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	331,230.000	
	FORTUNE REIT	313,000	1,233,220.000	
	LINK REIT	551,800	18,292,170.000	
	CHAMPION REIT	398,000	688,540.000	
香港・ドル 小計			21,026,120.000 (416,106,915)	
投資証券 合計			44,581,526,801 [44,581,526,801]	
合計			47,018,278,282 [47,018,278,282]	

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	6.4%	93.6%	80.5%
	投資証券 141銘柄			
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-%	100%	4.0%
イスラエル・シェケル	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 22銘柄	-%	100%	2.9%
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%	2.7%
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。

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月18日現在 金 額（円）	2024年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,124,512	5,111,467
国債証券	451,939,790	527,947,150
未収利息	101,590	157,545
前払費用	12,583	115,729
流動資産合計	457,178,475	533,331,891
資産合計	457,178,475	533,331,891
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,000	-
流動負債合計	1,000	-
負債合計	1,000	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 438,719,306	514,496,492
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,458,169	18,835,399
元本等合計	457,177,475	533,331,891
純資産合計	457,177,475	533,331,891
負債純資産合計	457,178,475	533,331,891

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19日 至2024年12月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1. 1 期首	2022年12月20日	2023年12月19日
期首元本額	347,622,118円	438,719,306円
期中追加設定元本額	126,667,022円	156,102,799円
期中一部解約元本額	35,569,834円	80,325,613円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2050	65,190,584円	89,130,290円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2060	985,533円	8,503,653円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	89,325,506円	70,567,206円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	201,611,475円	242,410,057円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	81,606,208円	103,885,286円
計	438,719,306円	514,496,492円
2. 期末日における受益権の総数	438,719,306口	514,496,492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19日 至2024年12月18日
----	------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	626,450	2,109,630
合計	626,450	2,109,630

（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

2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2023年12月18日現在	2024年12月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0421円 (10,421円)	1.0366円 (10,366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	463 2年国債	41,000,000	40,897,910	
	147 5年国債	14,000,000	13,916,420	
	148 5年国債	29,000,000	28,770,900	
	149 5年国債	58,000,000	57,440,880	
	150 5年国債	52,000,000	51,428,000	
	152 5年国債	63,000,000	62,356,140	
	153 5年国債	62,000,000	61,135,720	
	154 5年国債	40,000,000	39,479,600	
	155 5年国債	55,000,000	54,529,200	
	342 10年国債	70,000,000	69,664,700	
	343 10年国債	35,000,000	34,773,200	
	97 20年国債	5,000,000	5,221,600	
	98 20年国債	8,000,000	8,332,880	
国債証券 合計			527,947,150	
合計			527,947,150	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2024年12月19日から2025年6月18日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

D C ダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2025年6月18日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,013,439
親投資信託受益証券	524,143,287
未収入金	20,000
流動資産合計	526,176,726
資産合計	526,176,726
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,906
未払受託者報酬	82,044
未払委託者報酬	903,151
その他未払費用	20,430
流動負債合計	1,019,531
負債合計	1,019,531
純資産の部	
元本等	
元本	1 202,861,920
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	322,295,275
（分配準備積立金）	98,827,128
元本等合計	525,157,195
純資産合計	525,157,195
負債純資産合計	526,176,726

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2024年12月19日	
至 2025年6月18日	
営業収益	
受取利息	3,477
有価証券売買等損益	6,731,604
営業収益合計	6,735,081
営業費用	
受託者報酬	82,044
委託者報酬	903,151
その他費用	20,430
営業費用合計	1,005,625
営業利益又は営業損失（ ）	5,729,456
経常利益又は経常損失（ ）	5,729,456
中間純利益又は中間純損失（ ）	5,729,456
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	220,523
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	300,193,330
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,524,526
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,524,526
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,372,560
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,372,560
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	322,295,275

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2024年12月19日 至2025年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2025年6月18日現在
1. 1 期首元本額	192,283,666円
期中追加設定元本額	19,784,104円
期中一部解約元本額	9,205,850円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	202,861,920口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2024年12月19日 至2025年6月18日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2025年6月18日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2025年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5887円 (25,887円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,281,256,141
株式 2 3	436,146,175,920
派生商品評価勘定	48,035,100
未収入金	3,551,300

未収配当金		3,198,610,837
前払金		1,235,000
その他未収収益	4	62,189,358
流動資産合計		451,741,053,656
資産合計		451,741,053,656
負債の部		
流動負債		
未払解約金		149,704,840
未払利息		2,217,207
受入担保金		8,866,659,017
流動負債合計		9,018,581,064
負債合計		9,018,581,064
純資産の部		
元本等		
元本	1	211,781,518,930
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		230,940,953,662
元本等合計		442,722,472,592
純資産合計		442,722,472,592
負債純資産合計		451,741,053,656

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年12月19日 至2025年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 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 ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 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 ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 国内株式ファンド（適格機関投資家専用） 日本株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用） 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） D - I ' s T O P I X インデックス D C ダイワ・ターゲットイヤー2050 i F r e e T O P I X インデックス i F r e e 8 資産バランス i F r e e 年金バランス D C ダイワ・ターゲットイヤー2060 D C ダイワ日本株式インデックス	2024年12月19日 202,918,715,077円 25,063,540,036円 16,200,736,183円 2,812,212,612円 3,541,629,668円 901,515円 8,694,234円 102,184,836円 9,684,377円 256,901,047円 1,491,494,139円 940,236,623円 838,959,109円 10,776,801円 238,605,302円 11,008,673,230円 5,503,552,457円 1,273,526,505円 5,575,019円 72,543,951,806円

ダイワ・ライフ・バランス 3 0	2,924,361,788円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	5,227,815,275円
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	6,293,043,785円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,735,213,498円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2030	38,232,962円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2040	72,797,436円
ダイワつみたてインデックス日本株式	7,384,387,762円
ダイワつみたてインデックスバランス 3 0	12,589,096円
ダイワつみたてインデックスバランス 5 0	14,921,757円
ダイワつみたてインデックスバランス 7 0	286,223,905円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	29,241,384,863円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	41,004,364円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	18,674,040円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	2,591,104,623円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	258,958,330円
ダイワ国内バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	33,642,397円
ダイワ国内バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家専用）	49,301,187円
ダイワ・ノーロード T O P I X ファンド	228,986,324円
ダイワファンドラップ T O P I X インデックス	18,091,410,275円
ダイワ T O P I X インデックス（ダイワ S M A 専用）	14,995,150,527円
ダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックス	3,338,272,221円
スタイル9（4資産分散・保守型）	1,413,470円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	9,423,522円
スタイル9（4資産分散・積極型）	13,898,072円
スタイル9（6資産分散・保守型）	580,614円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	17,703,789円
スタイル9（6資産分散・積極型）	19,708,013円
スタイル9（8資産分散・保守型）	941,077円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	15,512,922円
スタイル9（8資産分散・積極型）	40,252,540円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	6,099,620円
ダイワ・インデックスセレクト T O P I X	921,019,302円
ダイワライフスタイル 2 5	85,281,713円
ダイワライフスタイル 5 0	413,454,203円
ダイワライフスタイル 7 5	370,161,705円
D C ・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）	7,401,032,673円

計	211,781,518,930円
2. 期末日における受益権の総数	211,781,518,930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 8,498,332,850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 933,890,000円
5. 4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				

株価指数 先物取引				
買建	6,071,105,000	-	6,119,260,000	48,155,000
合計	6,071,105,000	-	6,119,260,000	48,155,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2025年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.0905円
（1万口当たり純資産額）	（20,905円）

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,082,228,031
コール・ローン	6,136,631,503
株式	662,905,906,413
投資証券	12,414,701,424
派生商品評価勘定	115,147,600
未収入金	20,533,250
未収配当金	646,335,409

差入委託証拠金		12,801,216,459
流動資産合計		697,122,700,089
資産合計		697,122,700,089
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		109,311,656
未払解約金		507,803,800
流動負債合計		617,115,456
負債合計		617,115,456
純資産の部		
元本等		
元本	1	100,178,745,932
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		596,326,838,701
元本等合計		696,505,584,633
純資産合計		696,505,584,633
負債純資産合計		697,122,700,089

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年12月19日 至2025年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月18日現在
1. 1 期首	2024年12月19日
期首元本額	97,471,314,337円
期中追加設定元本額	8,277,498,787円
期中一部解約元本額	5,570,067,192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V A	202,330,718円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	1,294,757円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	13,050,157円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	2,898,468円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	79,141,486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)	132,603,269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)	9,833,780,510円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	802,650,942円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	6,930,576,568円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	629,673,372円
D-I's 外国株式インデックス	16,199,367円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	46,218,358円

i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	10,992,365,468円
i F r e e 8資産バランス	1,662,261,191円
i F r e e 年金バランス	384,329,560円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	28,395,212円
D Cダイワ外国株式インデックス	51,363,644,059円
ダイワ・ライフ・バランス30	448,032,037円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,058,635,477円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,050,740,402円
大和D C 海外株式インデックスファンド	1,034,164,599円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	8,234,898円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	12,250,965円
ダイワつみたてインデックス外国株式	3,189,095,683円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,936,492円
ダイワつみたてインデックスバランス50	3,052,509円
ダイワつみたてインデックスバランス70	47,593,509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）	19,142,811円
ダイワ世界バランスファンド40V A	37,716,041円
ダイワ世界バランスファンド60V A	28,624,114円
ダイワ・バランスファンド35V A	580,600,536円
ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）	32,496,251円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	105,554,382円
スタイル9（4資産分散・保守型）	554,846円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	3,756,515円
スタイル9（4資産分散・積極型）	5,619,112円
スタイル9（6資産分散・保守型）	208,767円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	7,046,907円
スタイル9（6資産分散・積極型）	7,854,358円
スタイル9（8資産分散・保守型）	298,104円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	5,409,548円
スタイル9（8資産分散・積極型）	14,758,318円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カンントリー）	116,186,184円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,108,117,225円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	406,017,903円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワS M A専用）	4,176,920,249円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,353,320,038円
ダイワライフスタイル25	6,355,804円

ダイワライフスタイル 5 0	31,139,422円
ダイワライフスタイル 7 5	27,721,857円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	64,513,249円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	63,663,358円
計	100,178,745,932円
2. 期末日における受益権の総数	100,178,745,932口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1 年超		
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買建	21,089,813,961	-	20,986,763,965	103,049,996

合計	21,089,813,961	-	20,986,763,965	103,049,996

（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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	6,109,954,260	-	6,218,840,200	108,885,940
アメリカ・ドル	2,449,786,520	-	2,494,744,760	44,958,240
イギリス・ポンド	366,614,770	-	370,166,930	3,552,160
オーストラリア・ドル	508,265,450	-	517,269,500	9,004,050
カナダ・ドル	1,211,739,650	-	1,231,421,200	19,681,550
スイス・フラン	839,659,670	-	854,360,160	14,700,490
ユーロ	733,888,200	-	750,877,650	16,989,450
合計	6,109,954,260	-	6,218,840,200	108,885,940

（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)

	2025年6月18日現在
1口当たり純資産額	6.9526円
(1万口当たり純資産額)	(69,526円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年6月18日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,503,782,992
コール・ローン	1,399,705,595
国債証券	334,121,826,958
派生商品評価勘定	12,917,660
未収入金	3,077,310
未収利息	2,637,827,167
前払費用	168,745,934
流動資産合計	340,847,883,616
資産合計	340,847,883,616
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定		7,812
未払金		35,510
未払解約金		280,928,123
流動負債合計		280,971,445
負債合計		280,971,445
純資産の部		
元本等		
元本	1	92,877,405,357
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		247,689,506,814
元本等合計		340,566,912,171
純資産合計		340,566,912,171
負債純資産合計		340,847,883,616

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年12月19日 至2025年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月18日現在
1. 1 期首	2024年12月19日
期首元本額	89,547,195,166円
期中追加設定元本額	8,013,291,639円
期中一部解約元本額	4,683,081,448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V A	277,526,071円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,730,030円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	24,929,273円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	12,385,718円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	147,712,078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)	968,836,973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)	667,057,238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)	1,028,574,741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)	7,161,838,910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)	1,077,714,342円

D - I ' s 外国債券インデックス	1,389,137円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	26,007,029円
i F r e e 外国債券インデックス	1,314,135,838円
i F r e e 8資産バランス	3,112,915,025円
i F r e e 年金バランス	723,223,684円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	3,583,910円
D Cダイワ外国債券インデックス	50,837,836,033円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,217,184,241円
ダイワ・ライフ・バランス50	976,953,343円
ダイワ・ライフ・バランス70	793,160,880円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）	776,153,686円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ分散コース）	634,712,584円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）	302,956,186円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	32,805,622円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	27,157,786円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,710,319,170円
ダイワつみたてインデックスバランス30	5,257,691円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,866,171円
ダイワつみたてインデックスバランス70	36,230,705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）	2,918,122,982円
ダイワ世界バランスファンド40VA	83,002,090円
ダイワ世界バランスファンド60VA	26,997,549円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,217,197,658円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	146,975,221円
スタイル9（4資産分散・保守型）	319,889円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	3,765,765円
スタイル9（4資産分散・積極型）	3,954,571円
スタイル9（6資産分散・保守型）	119,317円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,651,329円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,654,488円
スタイル9（8資産分散・保守型）	182,363円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,301,739円
スタイル9（8資産分散・積極型）	2,399,993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）	2,825,120円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	117,194,557円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	67,509,555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）	6,164,517,082円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,108,912,809円
ダイワライフスタイル25	24,225,069円
ダイワライフスタイル50	58,146,255円
ダイワライフスタイル75	17,275,861円
計	92,877,405,357円
2. 期末日における受益権の総数	92,877,405,357口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,245,120,937	-	1,258,030,785	12,909,848

アメリカ・ドル	121,404,759	-	122,271,501	866,742
イギリス・ポンド	26,393,809	-	26,496,158	102,349
イスラエル・シェケル	44,810,036	-	45,426,111	616,075
オフショア・人民元	620,721,263	-	627,337,409	6,616,146
カナダ・ドル	233,241,297	-	236,305,482	3,064,185
シンガポール・ドル	29,822,378	-	30,155,594	333,216
スウェーデン・クローナ	17,962,692	-	18,194,385	231,693
ユーロ	150,764,703	-	151,844,145	1,079,442
合計	1,245,120,937	-	1,258,030,785	12,909,848

（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）

	2025年6月18日現在
1口当たり純資産額	3.6668円
（1万口当たり純資産額）	（36,668円）

「ダイワ」- R E I T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

	2025年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,792,995,205
投資証券	2 243,789,600,400
派生商品評価勘定	173,656,000
未収入金	1,368,377,809
未収配当金	1,521,207,410
差入委託証拠金	396,472,844
流動資産合計	255,042,309,668
資産合計	255,042,309,668
負債の部	
流動負債	
前受金	210,672,000
未払解約金	1,184,466,600
流動負債合計	1,395,138,600
負債合計	1,395,138,600
純資産の部	
元本等	
元本	1 73,777,884,536
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	179,869,286,532
元本等合計	253,647,171,068
純資産合計	253,647,171,068
負債純資産合計	255,042,309,668

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年12月19日 至2025年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	投資証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月18日現在
1. 1 期首	2024年12月19日
期首元本額	86,235,422,547円
期中追加設定元本額	2,148,015,789円
期中一部解約元本額	14,605,553,800円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - R E I Tオープン	3,108,777,090円
ダイワJ - R E I Tオープン（毎月分配型）	53,124,799,526円
ダイワJ - R E I Tオープン（年1回決算型）	697,721,391円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	27,910,142円
i F r e e J - R E I Tインデックス	511,016,454円
i F r e e 8資産バランス	3,375,783,490円
ダイワJ - R E I Tオープン（奇数月決算型）	91,231,866円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	454,370円
D C・ダイワJ - R E I Tオープン	5,241,156,302円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	8,366,461円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	9,248,257円
ダイワ国内R E I Tインデックス（投資一任専用）	6,138,369円

ダイワ・ノーロード J - R E I Tファンド	71,908,674円
ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス	4,944,130,665円
ダイワ J - R E I Tインデックス（ダイワ S M A専用）	1,260,708,374円
ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス	674,295,728円
スタイル9（6資産分散・保守型）	50,544円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,087,757円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,523,314円
スタイル9（8資産分散・保守型）	58,166円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,258,085円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,266,088円
ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T	613,993,423円
計	73,777,884,536円
2. 期末日における受益権の総数	73,777,884,536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 738,000,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	9,676,128,000	-	9,850,400,000	174,272,000
合計	9,676,128,000	-	9,850,400,000	174,272,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2025年6月18日現在
1口当たり純資産額	3.4380円
(1万口当たり純資産額)	(34,380円)

「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

	2025年6月18日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	448,484,570

コール・ローン	357,147,977
投資信託受益証券	1,600,323,768
投資証券	45,718,545,241
派生商品評価勘定	11,310,049
未収入金	1,622,607
未収配当金	149,248,054
差入委託証拠金	436,034,401
流動資産合計	48,722,716,667
資産合計	48,722,716,667
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,500,193
未払解約金	8,499,200
流動負債合計	10,999,393
負債合計	10,999,393
純資産の部	
元本等	
元本	12,519,163,925
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	36,192,553,349
元本等合計	48,711,717,274
純資産合計	48,711,717,274
負債純資産合計	48,722,716,667

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年12月19日 至2025年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 期末元本額の内訳 ファンド名 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） 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） D-I's グローバルREITインデックス DCダイワ・ターゲットイヤー2050 iFree 外国REITインデックス iFree 8資産バランス グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型） グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型） DCダイワ・ターゲットイヤー2060 DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド DCダイワ・ターゲットイヤー2030	2024年12月19日 11,802,580,977円 1,279,738,332円 563,155,384円 2,634,746,900円 270,753,879円 1,355,510円 21,399,314円 615,021,174円 2,923,402,239円 443,542,447円 225,808,392円 6,319,708円 4,587,779,758円 7,382,541円

DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,119,265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）	5,148,264円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	124,495,154円
スタイル9（6資産分散・保守型）	21,106円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	2,130,152円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,793,579円
スタイル9（8資産分散・保守型）	34,191円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,439,083円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,128,960円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	171,536,049円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	56,484,702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）	255,140,870円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	76,089,763円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	75,090,925円
計	12,519,163,925円
2. 期末日における受益権の総数	12,519,163,925口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	1,365,166,135	-	1,367,626,436	2,460,301
合計	1,365,166,135	-	1,367,626,436	2,460,301

(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	2025年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	345,342,452	-	351,692,007	6,349,555
アメリカ・ドル	177,382,000	-	179,833,108	2,451,108

ユーロ	167,960,452	-	171,858,899	3,898,447
合計	345,342,452	-	351,692,007	6,349,555

（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）

	2025年6月18日現在
1口当たり純資産額	3.8910円
（1万口当たり純資産額）	（38,910円）

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,399,101
国債証券	549,503,360
未収利息	636,209

前払費用		191,338
流動資産合計		554,730,008
資産合計		554,730,008
負債の部		
流動負債		
未払解約金		244,900
流動負債合計		244,900
負債合計		244,900
純資産の部		
元本等		
元本	1	534,307,357
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,177,751
元本等合計		554,485,108
純資産合計		554,485,108
負債純資産合計		554,730,008

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年12月19日 至2025年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月18日現在
1. 1 期首	2024年12月19日
期首元本額	514,496,492円
期中追加設定元本額	80,962,348円

期中一部解約元本額	61,151,483円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	90,843,596円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	12,521,783円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	67,143,568円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	244,493,675円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	119,304,735円
計	534,307,357円
2. 期末日における受益権の総数	534,307,357口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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

2025年6月18日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2025年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.0378円
(1万口当たり純資産額)	(10,378円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年6月30日

資産総額	530,683,942円
負債総額	69,878円
純資産総額（ - ）	530,614,064円
発行済数量	202,929,424口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.6148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

2025年6月30日

資産総額	459,587,091,119円
負債総額	9,218,983,783円
純資産総額（ - ）	450,368,107,336円
発行済数量	211,810,895,374口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1263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

2025年6月30日

資産総額	713,474,499,796円
負債総額	465,968,478円
純資産総額（ - ）	713,008,531,318円
発行済数量	100,051,862,818口
1単位当たり純資産額（ / ）	7.1264円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	252,411,674,169円
負債総額	779,441,662円
純資産総額（ - ）	251,632,232,507円
発行済数量	73,147,029,216口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.4401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

2025年6月30日

資産総額	48,433,584,176円
負債総額	44,121,053円
純資産総額（ - ）	48,389,463,123円
発行済数量	12,535,791,670口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.8601円

（参考）ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	558,032,535円
負債総額	18,800円
純資産総額（ - ）	558,013,735円
発行済数量	537,439,915口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0383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

2025年6月30日

資産総額	345,223,672,760円
負債総額	230,987,150円
純資産総額（ - ）	344,992,685,610円
発行済数量	93,346,453,709口

1 単位当たり純資産額（ / ）

3.6958円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2025年6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。

2025年6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	85	407,533
追加型株式投資信託	796	31,415,365
株式投資信託 合計	881	31,822,898
単位型公社債投資信託	70	129,191
追加型公社債投資信託	14	1,377,645
公社債投資信託 合計	84	1,506,836
総合計	965	33,329,734

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。
- 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、当事業年度(2024年4月1日から2025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。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満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 (2024年 3 月31日)	当事業年度 (2025年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,813	13,153
有価証券	503	1,194
前払費用	481	513
未収委託者報酬	16,513	19,097
未収収益	78	110
関係会社短期貸付金	23,400	70,000
その他	88	94
流動資産計	45,878	104,164
固定資産		
有形固定資産	1	61
建物	2	0
器具備品	174	59
建設仮勘定	0	0
無形固定資産	1,342	1,160
ソフトウェア	1,063	1,062
ソフトウェア仮勘定	279	97
その他	-	0
投資その他の資産	13,660	14,856
投資有価証券	8,448	9,348
関係会社株式	3,475	3,414
出資金	177	34
長期差入保証金	1,021	1,049
繰延税金資産	524	995
その他	12	13

固定資産計	15,180	16,077
資産合計	61,058	120,241

(単位:百万円)

	前事業年度 (2024年 3 月31日)	当事業年度 (2025年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	158	134
未払金	6,187	6,757
未払収益分配金	39	62
未払償還金	12	12
未払手数料	5,849	6,660
その他未払金	2 285	22
未払費用	5,035	5,997
未払法人税等	3,842	4,121
未払消費税等	872	763
賞与引当金	1,048	1,456
その他	1	0
流動負債計	17,146	19,233
固定負債		
退職給付引当金	2,227	2,300
役員退職慰労引当金	62	58
固定負債計	2,289	2,358
負債合計	19,435	21,592
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	41,424
資本剰余金		
資本準備金	11,495	37,745
資本剰余金合計	11,495	37,745
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,048	17,743
利益剰余金合計	13,422	18,117
株主資本合計	40,092	97,287
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	1,530	1,361
評価・換算差額等合計	1,530	1,361
純資産合計	41,623	98,649
負債・純資産合計	61,058	120,241

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,221	91,634
その他営業収益	717	1,233
営業収益計	76,939	92,868
営業費用		
支払手数料	31,497	37,180
広告宣伝費	947	1,124
調査費	10,709	13,135
調査費	1,700	1,954
委託調査費	9,009	11,180
委託計算費	1,783	1,957
営業雑経費	2,285	3,114
通信費	163	167
印刷費	514	483
協会費	51	57
諸会費	18	18
その他営業雑経費	1,538	2,388
営業費用計	47,224	56,512
一般管理費		
給料	6,601	7,599
役員報酬	483	453
給料・手当	4,543	5,116
賞与	527	572
賞与引当金繰入額	1,048	1,456
福利厚生費	969	1,070
交際費	96	108
旅費交通費	192	247
租税公課	508	1,004
不動産賃借料	1,269	1,298
退職給付費用	334	349
役員退職慰労引当金繰入額	6	6

固定資産減価償却費	478	444
諸経費	1,888	2,164
一般管理費計	12,346	14,293
営業利益	17,368	22,061

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
営業外収益		
受取配当金	32	959
投資有価証券売却益	220	387
有価証券償還益	40	183
受取利息	4	95
その他	89	76
営業外収益計	388	1,703
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	176
有価証券償還損	196	4
その他	18	54
営業外費用計	215	235
経常利益	17,540	23,528
特別利益		
投資有価証券売却益	-	1 380
固定資産売却益	-	2 110
特別利益計	-	491
特別損失		
固定資産売却損	-	3 101
システム刷新関連費用	153	-
投資有価証券評価損	132	-
特別損失計	286	101
税引前当期純利益	17,253	23,918
法人税、住民税及び事業税	5,533	7,763
法人税等調整額	139	397
法人税等合計	5,394	7,366
当期純利益	11,859	16,552

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当期変動額						
新株の発行	26,250	26,250	-	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	-	△ 11,858	△ 11,858	△ 11,858
当期純利益	-	-	-	16,552	16,552	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	26,250	26,250	-	4,694	4,694	57,195
当期末残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当期変動額			
新株の発行	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	△ 11,858
当期純利益	-	-	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 168	△ 168	△ 168
当期変動額合計	△ 168	△ 168	57,026
当期末残高	1,361	1,361	98,649

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。

５．その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

リースに関する会計基準等

・「リースに関する会計基準」(企業会計基準第34号 2024年 9月13日 企業会計基準委員会) 等

- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

（１）概要

IFRS第16号の主要な定めを採り入れた新リース会計基準であります。借手の会計処理として、全てのリースについて使用権資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

（２）適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（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「受取利息」は、金額的重要性が増したため、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93百万円は、「受取利息」4百万円、「その他」89百万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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
建物	39百万円	40百万円
器具備品	308百万円	269百万円

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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
未払金	236百万円	- 百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2025年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,341百万円に対して保証を行っております。

(損益計算書関係)

1 投資有価証券売却益の項目

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
投資有価証券売却益		
非上場株式	- 百万円	380百万円

2 固定資産売却益の項目

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
固定資産売却益		
美術品	- 百万円	83百万円
ゴルフ会員権	- 百万円	26百万円

3 固定資産売却損の項目

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
固定資産売却損		
美術品	- 百万円	85百万円
ゴルフ会員権	- 百万円	15百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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	652	-	3,260
合 計	2,608	652	-	3,260

2024年10月1日付で株式会社かんぽ生命保険より第三者割当増資に係る払込を受け、株式を発行しております。

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
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

(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

2025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	16,551百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,076円
基準日	2025年3月31日
効力発生日	2025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。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おります。

前事業年度(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

当事業年度(2025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	2,230	7,968	-	10,199
資産合計	2,230	7,968	-	10,199

(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

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	342
子会社株式	1,448	1,386
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(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。

当事業年度(2025年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,386百万円)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(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。

当事業年度(2025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	120	55	65
(2)その他	7,230	5,161	2,068
小計	7,350	5,216	2,134
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,848	3,020	172
小計	2,848	3,020	172
合計	10,199	8,236	1,962

(注)非上場株式(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。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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	704	380	-
(2)その他 証券投資信託	3,039	387	176
合計	3,744	767	176

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132百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,276百万円	2,227百万円
勤務費用	138	149
退職給付の支払額	266	166
その他	78	89
退職給付債務の期末残高	2,227	2,300

(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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,227百万円	2,300百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,227	2,300
退職給付引当金	2,227	2,300
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,227	2,300

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
勤務費用	138百万円	149百万円
その他	9	8
確定給付制度に係る退職給付費用	147	158

(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187百万円、当事業年度191百万円であります。

(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

	前事業年度 (2024年 3月31日)	当事業年度 (2025年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	681	724
賞与引当金	262	340
未払事業税	197	260
投資有価証券評価損	204	171
株式報酬費用	115	150
関係会社株式評価損	155	87
出資金評価損	94	14
システム関連費用	25	-
その他	173	157
繰延税金資産小計	1,910	1,907
評価性引当額	486	277
繰延税金資産合計	1,424	1,629
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	740	633
連結法人間取引(譲渡益)	159	-
繰延税金負債合計	899	633
繰延税金資産の純額	524	995

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(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。

当事業年度(2025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．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(令和7年法律第13号)が2025年 3月31日に国会で成立し、2026年 4月 1日以後に開始する事業年度から防衛特別法人税の創設に伴う法人税率等の引上げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.62%から2026年 4月 1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については31.52%となります。

この税率変更により、繰延税金資産が22百万円増加、法人税等調整額が22百万円減少しております。

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が91,634百万円、その他1,233百万円であります。

(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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

前事業年度(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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	㈱大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持 株会社 業	被所有 100.0	あり	経営管 理	資金の貸付	11,100	関係会 社 短期貸 付金	23,400
								利息の受取 (注)	0	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2024年 4 月 1 日 至 2025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(%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	㈱大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持 株会社 業	被所有 80.0	あり	経営管 理	資金の貸付	63,600	関係会 社 短期貸 付金	70,000
								利息の受取 (注１)	89	-	-
その他の 関係 会社	㈱かんぼ 生命保険	東京都 千代田 区	500,000	生命保 険業	被所有 20.0	あり	投資顧 問契約 の締結	投資顧問 報酬 (注２)	215	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１) 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。

(注２) 投資顧問報酬については市場実勢を勘案して合理的に決定しております。

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(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				
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商 品取引 業	所有 直接100.0	なし	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。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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				
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商 品取引 業	所有 直接100.0	なし	経営管 理	債務保証 (注)	2,341	-	-

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 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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
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	-	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	証券投資信 託の代行手 数料 (注2)	13,749	未払手 数料	3,491
							本社ビル の管理	不動産の賃 借料(注3)	1,030	長期差 入保証 金	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	-	なし	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。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上の関係				
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	-	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	15,779	未払手数料	3,657
							本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,038	長期差入保証金	1,037
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	-	なし	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守 (注4)	857	未払費用	77

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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,956.63円	1株当たり純資産額	30,254.44円
1株当たり当期純利益	4,546.57円	1株当たり当期純利益	5,642.31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いません。

(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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,859	16,552
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,933,697

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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、株式会社かんば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、かんば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。

2025年3月31日、株式会社大和証券グループ本社、株式会社かんば生命保険、三井物産株式会社、三井物産かんばアセットマネジメント株式会社及び三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社と、オルタナティブ資産運用分野における資本業務提携を締結いたしました。

2025年7月1日、株式譲渡取引により大和かんばオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化いたしました。

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

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(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【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

独立監査人の監査報告書

2025年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年2月7日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040の2023年12月19日から2024年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040の2024年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年8月8日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040の2024年12月19日から2025年6月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040の2025年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年12月19日から2025年6月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) １． 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) ２． XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。