【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】	2026年2月26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】	ダイワつみたてインデックスバランス３０
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワつみたてインデックスバランス３０

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2026年2月27日から2026年8月28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、内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式					
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			日経225
債券					
一般	年4回	北米	ファミリーファンド	あり（　　）	
公債					
社債		欧州			
その他債券	年6回（隔月）	アジア			TOPIX
クレジット属性（　　）					
		オセアニア			
不動産投信	年12回（毎月）	中南米			
その他資産					
（投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券））	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他（合成インデックス）
		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　資産配分固定型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分変更型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回		目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

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

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

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

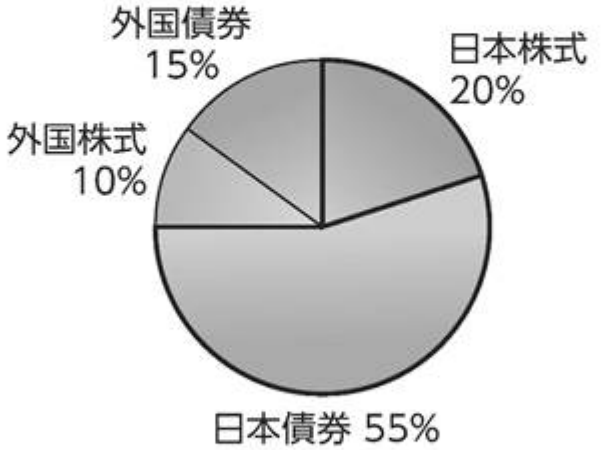
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国　内	海　外	合　計
株　式	20%	10%	30%
債　券	55%	15%	70%
合　計	75%	25%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

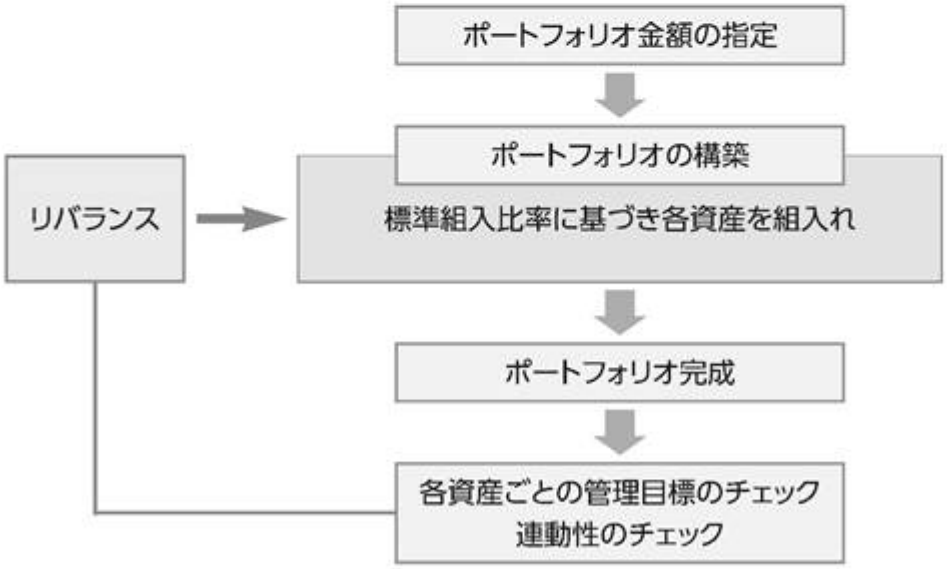
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

- 市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。
- 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。

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

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

3 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。

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

（注）第1計算期間は、2020年6月5日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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。

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

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

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

NOMURA-BPI総合指数とは
NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
NOMURA-BPIの知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等ならびに当ファンドおよび同指数に関連して行なわれる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

3．外国株式インデックスマザーファンド

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

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

MSCIコクサイ指数とは
MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。なお、MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）は、MSCIコクサイ指数（配当込み、米ドルベース）をもとに、MSCI Inc.の承諾を得て委託会社が計算したものです。
本ファンドは、ＭＳＣＩ Inc.（「ＭＳＣＩ」）によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、ＭＳＣＩは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。
〔https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html〕

4．外国債券インデックスマザーファンド

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

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2019年6月12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】

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

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

＜委託会社の概況（2025年12月末日現在）＞

・資本金の額　414億2,454万1,896円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
2024年10月 1日	株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携
2025年 7月 1日	大和かんぽ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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

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

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

② 投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券：信託財産の純資産総額の55%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧、⑨および⑩に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

14．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

22．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

25．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前23.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前5.の証券または証書ならびに前16．および前21.の証券または証書のうち前5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前6.から前10.までの証券ならびに前18．の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前16．および前21.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券（新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

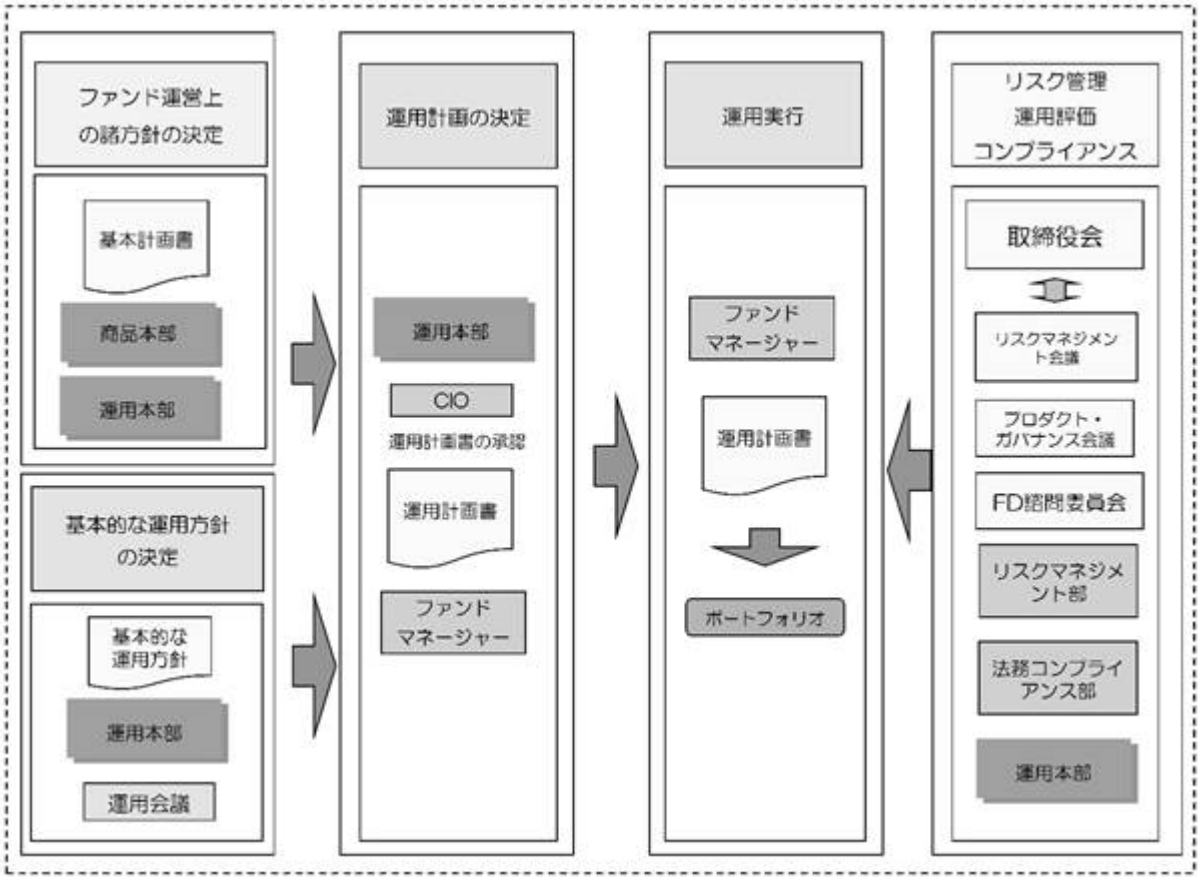
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品本部長の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の承認

運用担当チームは、基本的な運用方針を作成し、運用会議にて承認を受けます。

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承認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、CIOの承認を受けます。

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の承認

・運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する各信託財産等の運用計画書および変更運用計画書の承認

・その他信託財産等の運用に関する事項の決定

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）

運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する運用計画書および変更運用計画書を確認します。

ホ．運用チームリーダー

次の職務を遂行します。

- **運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の立案**
- **運用計画書および変更運用計画書の作成または運用チームメンバーへの作成の指示**
- **運用計画に基づく運用プロセス等の実行および運用チームメンバーへの実行の指示**

ヘ．ファンドマネージャー

次の職務を遂行します。

- **運用チームリーダーの指示に基づく運用計画書および変更運用計画書の作成**
- **運用計画に基づく運用プロセス等の実行**

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2025年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

② 株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 新株引受権証券等（信託約款）

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

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

④ 投資信託証券（信託約款）

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

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

⑤ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑥ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑦ 信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

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

⑧　先物取引等（信託約款）

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額の範囲内とします。

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

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

⑨　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額

にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑩　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑪　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑬　外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の75を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の75を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑭　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

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

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信

託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資には、制限を設けません。

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

3．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

② ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合に

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

(3)その他の留意点

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

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

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

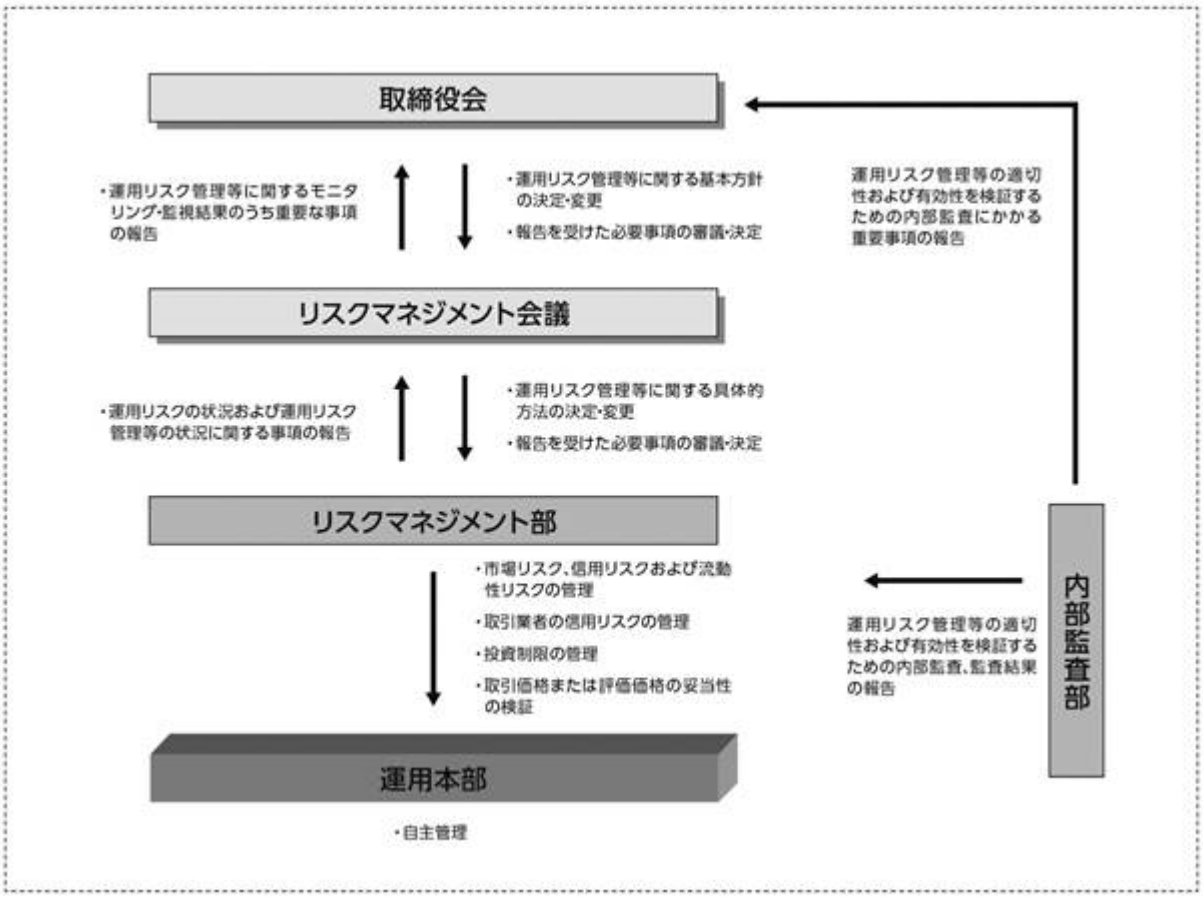
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

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

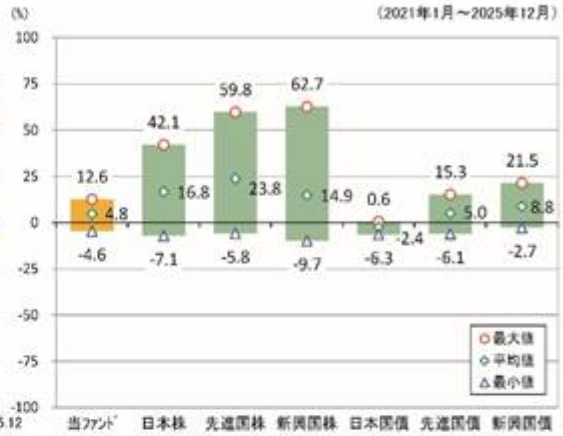
・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜0.14%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」について

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

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

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

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

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2025年12月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2025年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		145,965,442	99.70
	内 日本	145,965,442	99.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		435,965	0.30
純資産総額		146,401,407	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12月30日現在）

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	日本	親投資信託受益証券	70,915,334	1.1558 81,969,366	1.1203 79,446,448	54.27
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,518,163	2.0518 23,632,978	2.5696 29,597,071	20.22
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	5,369,991	3.6043 19,355,070	4.0774 21,895,601	14.96
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	1,743,294	6.8270 11,901,478	8.6195 15,026,322	10.26

（注） 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.70%
合計	99.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2020年6月5日)	60,266,944	60,266,944	1.0273	1.0273
第2計算期間末(2021年6月7日)	73,816,414	73,816,414	1.1147	1.1147
第3計算期間末(2022年6月6日)	79,071,901	79,071,901	1.1224	1.1224
第4計算期間末(2023年6月5日)	96,693,887	96,693,887	1.1712	1.1712
第5計算期間末(2024年6月5日)	120,217,134	120,217,134	1.2608	1.2608
2024年12月末日	126,489,709	－	1.2859	－
2025年1月末日	127,321,667	－	1.2771	－
2月末日	124,770,440	－	1.2521	－
3月末日	124,765,224	－	1.2434	－
4月末日	123,955,211	－	1.2397	－
5月末日	127,509,540	－	1.2534	－
第6計算期間末(2025年6月5日)	127,394,302	127,394,302	1.2512	1.2512
6月末日	129,555,780	－	1.2726	－
7月末日	133,197,982	－	1.2845	－
8月末日	133,733,323	－	1.2948	－
9月末日	135,562,334	－	1.3107	－
10月末日	140,955,884	－	1.3440	－

11月末日	144,039,126	－	1.3458	－
12月末日	146,401,407	－	1.3432	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
2025年6月6日～ 2025年12月5日	－

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	8.5
第3計算期間	0.7
第4計算期間	4.3
第5計算期間	7.7
第6計算期間	△0.8
2025年6月6日～ 2025年12月5日	6.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	66,744,581	9,080,108
第2計算期間	26,052,246	18,495,143
第3計算期間	17,541,102	13,311,356
第4計算期間	18,945,126	6,835,011
第5計算期間	23,373,848	10,589,018
第6計算期間	13,723,262	7,247,806
2025年6月6日～ 2025年12月5日	9,982,557	4,184,352

(注)　当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		569,635,341,660	97.83
	内 日本	569,635,341,660	97.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,658,743,679	2.17
純資産総額		582,294,085,339	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）		12,561,680,000	2.16
	内 日本	12,561,680,000	2.16

(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12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	6,278,300	2,931.05 18,402,028,857	3,356.00 21,069,974,800	3.62
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,337,900	2,343.42 17,195,852,157	2,493.00 18,293,384,700	3.14
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	4,074,100	3,476.12 14,162,082,513	4,024.00 16,394,178,400	2.82
4	日 立	日本	株式	電気機器	3,035,200	3,912.65 11,875,691,361	4,902.00 14,878,550,400	2.56
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,555,400	4,161.62 10,634,615,360	5,041.00 12,881,771,400	2.21
6	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2,270,400	4,623.15 10,496,421,774	4,400.00 9,989,760,000	1.72

7	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,649,500	4,875.38 8,041,951,305	5,700.00 9,402,150,000	1.61
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,491,100	3,582.89 8,925,344,333	3,586.00 8,933,084,600	1.53
9	三菱重工業	日本	株式	機械	2,235,000	3,769.38 8,424,566,020	3,840.00 8,582,400,000	1.47
10	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	250,000	25,976.16 6,494,041,577	34,320.00 8,580,000,000	1.47
11	三井物産	日本	株式	卸売業	1,796,700	3,739.95 6,719,578,475	4,643.00 8,342,078,100	1.43
12	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	4,200,000	1,744.12 7,325,324,720	1,975.00 8,295,000,000	1.42
13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	897,900	7,944.21 7,133,112,250	8,847.00 7,943,721,300	1.36
14	任 天 堂	日本	株式	その他製品	745,600	12,803.82 9,546,528,799	10,595.00 7,899,632,000	1.36
15	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	372,200	15,257.45 5,678,826,188	19,635.00 7,308,147,000	1.26
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,195,800	6,266.07 7,492,977,606	5,817.00 6,955,968,600	1.19
17	キーエンス	日本	株式	電気機器	118,200	55,751.05 6,589,775,228	56,680.00 6,699,576,000	1.15
18	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,306,600	3,843.02 5,021,290,542	4,585.00 5,990,761,000	1.03
19	HOYA	日本	株式	精密機器	227,300	20,668.29 4,697,903,948	23,685.00 5,383,600,500	0.92
20	NTT	日本	株式	情報･通信業	32,523,200	157.78 5,131,691,535	157.70 5,128,908,640	0.88
21	信越化学	日本	株式	化学	1,052,000	4,641.52 4,882,881,630	4,873.00 5,126,396,000	0.88
22	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,054,000	4,472.08 4,713,573,586	4,835.00 5,096,090,000	0.88
23	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	84,300	46,173.96 3,892,465,230	56,940.00 4,800,042,000	0.82
24	富 士 通	日本	株式	電気機器	1,097,600	3,684.65 4,044,273,006	4,329.00 4,751,510,400	0.82
25	KDDI	日本	株式	情報･通信業	1,664,600	2,475.49 4,120,715,840	2,708.50 4,508,569,100	0.77
26	日本電気	日本	株式	電気機器	783,300	4,726.25 3,702,075,593	5,310.00 4,159,323,000	0.71

27	丸 紅	日本	株式	卸売業	953,500	3,637.02 3,467,902,834	4,353.00 4,150,585,500	0.71
28	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	19,049,800	228.34 4,349,947,222	214.80 4,091,897,040	0.70
29	住友商事	日本	株式	卸売業	749,000	4,384.11 3,283,703,723	5,412.00 4,053,588,000	0.70
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	706,600	4,804.43 3,394,811,977	5,640.00 3,985,224,000	0.68

(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	97.83%
合計	97.83%

(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	0.34%
建設業	2.44%
食料品	2.70%
繊維製品	0.33%
パルプ・紙	0.14%
化学	4.40%
医薬品	3.66%
石油・石炭製品	0.48%
ゴム製品	0.63%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.78%
非鉄金属	1.62%
金属製品	0.44%
機械	5.77%
電気機器	18.00%
輸送用機器	6.82%
精密機器	1.90%
その他製品	2.44%
電気・ガス業	1.37%
陸運業	2.19%

海運業	0.52%
空運業	0.30%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.01%
卸売業	7.56%
小売業	4.37%
銀行業	9.92%
証券、商品先物取引業	0.99%
保険業	3.11%
その他金融業	1.16%
不動産業	1.93%
サービス業	3.63%
合計	97.83%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX　先物 0803月	買建	368	12,509,319,000	12,561,680,000	2.16%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2025年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		99,954,721,680	85.69
	内 日本	99,954,721,680	85.69
地方債証券		4,973,418,013	4.26

	内 日本	4,973,418,013	4.26
特殊債券		4,370,645,578	3.75
	内 日本	4,370,645,578	3.75
社債券		6,906,287,000	5.92
	内 日本	6,906,287,000	5.92
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		448,059,052	0.38
純資産総額		116,653,131,323	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12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	158 5年国債	日本	国債証券	2,350,000,000	97.90 2,300,774,500	97.69 2,295,738,500	0.100000 2028/03/20	1.97
2	154 5年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	98.45 1,870,588,000	98.31 1,868,004,000	0.100000 2027/09/20	1.60
3	163 5年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	98.10 1,864,030,000	97.81 1,858,428,000	0.400000 2028/09/20	1.59
4	156 5年国債	日本	国債証券	1,870,000,000	98.38 1,839,762,100	98.20 1,836,358,700	0.200000 2027/12/20	1.57
5	360 10年国債	日本	国債証券	1,620,000,000	94.08 1,524,241,800	93.51 1,514,959,200	0.100000 2030/09/20	1.30
6	153 5年国債	日本	国債証券	1,520,000,000	98.60 1,498,765,600	98.51 1,497,443,200	0.005000 2027/06/20	1.28
7	362 10年国債	日本	国債証券	1,530,000,000	93.31 1,427,704,200	92.66 1,417,728,600	0.100000 2031/03/20	1.22
8	373 10年国債	日本	国債証券	1,440,000,000	91.74 1,321,059,400	90.63 1,305,201,600	0.600000 2033/12/20	1.12
9	369 10年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	92.67 1,297,507,500	91.79 1,285,102,000	0.500000 2032/12/20	1.10
10	365 10年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	91.92 1,286,910,500	91.22 1,277,122,000	0.100000 2031/12/20	1.09
11	161 5年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	98.11 1,275,482,000	97.84 1,271,946,000	0.300000 2028/06/20	1.09

12	370 10年国債	日本	国債証券	1,370,000,000	92.27 1,264,099,000	91.33 1,251,248,400	0.500000 2033/03/20	1.07
13	367 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	91.62 1,236,870,000	90.79 1,225,786,500	0.200000 2032/06/20	1.05
14	371 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	91.15 1,230,538,500	90.17 1,217,362,500	0.400000 2033/06/20	1.04
15	358 10年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	94.90 1,214,784,000	94.40 1,208,435,200	0.100000 2030/03/20	1.04
16	372 10年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	93.53 1,197,241,400	92.54 1,184,550,400	0.800000 2033/09/20	1.02
17	377 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	94.95 1,186,894,500	93.70 1,171,362,500	1.200000 2034/12/20	1.00
18	164 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	97.22 1,166,748,000	96.89 1,162,752,000	0.200000 2028/12/20	1.00
19	178 5年国債	日本	国債証券	1,175,000,000	98.65 1,159,231,500	98.06 1,152,228,500	1.000000 2030/03/20	0.99
20	181 5年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	99.63 1,096,029,000	98.90 1,087,933,000	1.300000 2030/09/20	0.93
21	374 10年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	92.84 1,086,321,600	91.70 1,072,948,500	0.800000 2034/03/20	0.92
22	376 10年国債	日本	国債証券	1,150,000,000	92.92 1,068,662,500	91.67 1,054,228,000	0.900000 2034/09/20	0.90
23	366 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	92.04 1,049,346,200	91.30 1,040,831,400	0.200000 2032/03/20	0.89
24	368 10年国債	日本	国債証券	1,150,000,000	91.16 1,048,363,000	90.31 1,038,634,000	0.200000 2032/09/20	0.89
25	364 10年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	92.38 1,034,658,000	91.72 1,027,308,800	0.100000 2031/09/20	0.88
26	361 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	93.75 1,031,338,000	93.11 1,024,221,000	0.100000 2030/12/20	0.88
27	378 10年国債	日本	国債証券	1,075,000,000	96.39 1,036,214,000	95.00 1,021,293,000	1.400000 2035/03/20	0.88
28	359 10年国債	日本	国債証券	1,060,000,000	94.50 1,001,721,200	93.95 995,944,200	0.100000 2030/06/20	0.85
29	348 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.45 984,520,000	98.31 983,160,000	0.100000 2027/09/20	0.84
30	174 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.95 979,510,000	97.43 974,300,000	0.700000 2029/09/20	0.84

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	85.69%
地方債証券	4.26%
特殊債券	3.75%
社債券	5.92%
合計	99.62%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		863,612,760,447	93.80
	内 香港	4,589,563,284	0.50
	内 シンガポール	3,813,271,005	0.41
	内 イスラエル	2,602,551,016	0.28
	内 ノルウェー	1,354,844,596	0.15
	内 スウェーデン	8,759,023,316	0.95
	内 デンマーク	4,583,417,918	0.50
	内 イギリス	32,846,254,841	3.57
	内 アイルランド	1,077,514,538	0.12
	内 オランダ	11,094,475,209	1.20
	内 ベルギー	2,485,151,752	0.27
	内 フランス	23,476,818,184	2.55
	内 ドイツ	21,676,262,988	2.35
	内 スイス	20,843,742,150	2.26

	内 ポルトガル	438,097,171	0.05
	内 スペイン	8,737,536,908	0.95
	内 イタリア	7,305,030,147	0.79
	内 フィンランド	2,600,218,350	0.28
	内 オーストリア	610,040,484	0.07
	内 カナダ	29,297,374,499	3.18
	内 アメリカ	662,427,253,143	71.95
	内 オーストラリア	12,582,908,534	1.37
	内 ニュージーランド	411,410,414	0.04
投資証券		13,888,422,385	1.51
	内 香港	200,225,219	0.02
	内 シンガポール	228,313,713	0.02
	内 イギリス	199,174,532	0.02
	内 フランス	322,889,149	0.04
	内 アメリカ	11,765,228,376	1.28
	内 オーストラリア	1,172,591,396	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		43,217,262,781	4.69
純資産総額		920,718,445,613	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）		44,902,896,365	4.88
	内 イギリス	2,487,334,406	0.27
	内 ドイツ	7,844,666,036	0.85
	内 カナダ	4,067,594,100	0.44
	内 アメリカ	29,018,513,420	3.15
	内 オーストラリア	1,484,788,403	0.16
為替予約取引（買建）		26,750,093,020	2.91
	内 日本	26,750,093,020	2.91

(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12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,739,700	27,711.12 48,209,035,464	29,467.72 51,264,998,051	5.57
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,062,400	43,656.75 46,380,937,574	42,859.86 45,534,321,213	4.95
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	505,660	77,029.08 38,950,527,424	76,260.37 38,561,821,728	4.19
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	687,400	36,512.92 25,098,983,408	36,332.87 24,975,221,162	2.71
5	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	416,500	50,127.38 20,878,054,103	49,090.95 20,446,382,174	2.22
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	321,300	63,087.41 20,269,987,275	54,700.49 17,575,270,136	1.91
7	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	349,940	50,117.98 17,538,288,441	49,220.89 17,224,361,186	1.87
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	155,360	101,443.05 15,760,192,559	103,124.50 16,021,423,314	1.74
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	202,190	67,347.41 13,616,973,879	71,961.23 14,549,842,792	1.58
10	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	196,830	49,015.80 9,647,780,859	50,686.30 9,976,584,429	1.08
11	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	57,605	168,375.58 9,699,275,470	168,885.96 9,728,676,233	1.06
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	98,770	80,442.09 7,945,265,585	78,444.38 7,747,952,203	0.84
13	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	121,590	52,359.92 6,366,443,451	55,517.74 6,750,402,201	0.73
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	305,209	18,148.43 5,539,065,759	18,870.17 5,759,347,791	0.63

15	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	172,500	32,395.39 5,588,205,672	32,495.59 5,605,489,896	0.61
16	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	314,000	17,301.44 5,432,653,918	17,617.69 5,531,956,795	0.60
17	MASTERCARD INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	61,060	86,190.97 5,262,821,043	90,476.02 5,524,466,025	0.60
18	PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A	アメリカ	株式	情報技術	163,000	26,372.53 4,298,722,716	28,835.22 4,700,140,990	0.51
19	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	126,472	35,648.71 4,508,563,904	36,140.31 4,570,737,337	0.50
20	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	27,068	166,523.72 4,507,464,107	167,150.44 4,524,428,218	0.49
21	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	304,710	16,842.72 5,132,146,674	14,740.12 4,491,463,184	0.49
22	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	503,601	8,399.44 4,229,968,398	8,665.59 4,364,002,811	0.47
23	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	31,720	143,031.65 4,536,963,951	135,869.03 4,309,765,644	0.47
24	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	116,227	34,056.49 3,958,284,454	33,755.90 3,923,347,175	0.43
25	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	71,290	55,879.39 3,983,642,084	54,396.77 3,877,945,876	0.42
26	PROCTER & GAMBLE	アメリカ	株式	生活必需品	167,567	23,195.92 3,886,872,335	22,633.87 3,792,691,236	0.41
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	122,533	31,617.29 3,874,161,641	30,588.69 3,748,124,295	0.41
28	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	80,400	37,023.30 2,976,674,028	46,086.56 3,705,360,003	0.40
29	GE AEROSPACE	アメリカ	株式	資本財･サービス	75,906	46,725.33 3,546,733,051	48,780.96 3,702,767,914	0.40
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	283,050	12,045.72 3,409,542,858	12,178.80 3,447,210,019	0.37

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.80%

投資証券	1.51%
合計	95.31%

(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	3.25%
素材	3.01%
資本財・サービス	9.73%
一般消費財・サービス	9.21%
生活必需品	5.02%
ヘルスケア	9.48%
金融	16.13%
情報技術	26.80%
コミュニケーション・サービス	8.42%
公益事業	2.50%
不動産	0.25%
合計	93.80%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 26	買建	533	28,742,890,996	29,018,513,420	3.15%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 26	買建	119	2,463,484,521	2,487,334,406	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 26	買建	65	1,458,928,522	1,484,788,403	0.16%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 26	買建	95	4,021,251,108	4,067,594,100	0.44%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 26	買建	86	2,223,649,642	2,241,487,488	0.24%
		EURO STOXX 50 MAR 26	買建	526	5,598,457,120	5,603,178,548	0.61%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2026年1月	買建	116,000,000	18,019,037,960	18,140,010,400	1.97%

		豪ドル買/円売 2026年1月	買建	8,000,000	815,830,820	837,631,200	0.09%
		カナダ・ドル買/円売 2026年1月	買建	20,600,000	2,297,960,910	2,352,985,560	0.26%
		英ポンド買/円売 2026年1月	買建	6,600,000	1,361,730,650	1,393,777,440	0.15%
		ユーロ買/円売 2026年1月	買建	14,100,000	2,557,414,980	2,597,324,340	0.28%
		スイス・フラン買/円売 2026年1月	買建	7,200,000	1,400,109,010	1,428,364,080	0.16%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		384,547,383,419	97.67
	内 ユーロ	114,220,665,364	29.01
	内 中国	44,781,903,843	11.37
	内 シンガポール	1,402,420,098	0.36
	内 マレーシア	1,999,404,589	0.51
	内 イスラエル	1,436,902,105	0.36
	内 ノルウェー	557,837,256	0.14
	内 スウェーデン	640,963,533	0.16
	内 デンマーク	780,556,876	0.20
	内 イギリス	22,658,356,811	5.75
	内 ポーランド	2,664,447,667	0.68
	内 カナダ	7,684,121,500	1.95
	内 アメリカ	176,946,551,010	44.94
	内 メキシコ	3,197,009,880	0.81
	内 オーストラリア	4,628,799,899	1.18
	内 ニュージーランド	947,442,988	0.24

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,191,431,037	2.33
純資産総額	393,738,814,456	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）		2,525,066,072	0.64
	内 日本	2,525,066,072	0.64
為替予約取引（売建）		77,106,400	△0.02
	内 日本	77,106,400	△0.02

(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12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	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	100.69 1,912,624,264	100.72 1,913,194,103	1.850000 2027/05/15	0.49
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	98.56 1,774,585,681	98.64 1,776,026,033	2.875000 2028/05/15	0.45
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.76 1,660,143,215	101.95 1,663,193,750	2.050000 2029/04/15	0.42
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	99.61 1,637,485,306	98.97 1,627,079,546	3.875000 2034/08/15	0.41
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	104.38 1,634,298,528	103.74 1,624,184,752	4.500000 2033/11/15	0.41
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	102.07 1,630,000,016	101.57 1,622,079,333	4.125000 2032/11/15	0.41
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	100.81 1,609,910,863	100.20 1,600,121,793	4.000000 2034/02/15	0.41
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.26 1,601,092,152	101.58 1,590,414,760	4.250000 2034/11/15	0.40
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,600,000	104.92 1,577,042,823	104.35 1,568,370,485	4.625000 2035/02/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	102.08 1,518,330,622	101.38 1,507,874,762	4.250000 2035/05/15	0.38

11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	88.41 1,481,037,247	88.31 1,479,362,055	1.125000 2031/02/15	0.38
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	87.58 1,412,432,185	87.41 1,409,642,442	1.250000 2031/08/15	0.36
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	100.21 1,412,027,164	99.64 1,404,080,179	3.875000 2033/08/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	94.00 1,398,080,800	93.61 1,392,324,871	2.750000 2032/08/15	0.35
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	99.98 1,377,456,124	100.05 1,378,499,527	3.500000 2027/10/31	0.35
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	87.63 1,372,029,216	87.42 1,368,757,112	1.375000 2031/11/15	0.35
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	103.40 1,376,112,300	102.73 1,367,169,593	4.375000 2034/05/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.45 1,350,122,558	101.39 1,349,337,409	4.000000 2029/01/31	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	87.72 1,345,908,119	87.65 1,344,926,175	0.875000 2030/11/15	0.34
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.77 1,332,043,730	102.90 1,333,767,547	2.370000 2029/01/15	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	101.57 1,319,875,322	101.45 1,318,393,951	4.000000 2029/07/31	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.54 1,259,318,540	100.62 1,260,257,900	3.875000 2027/07/31	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.01 1,252,617,772	99.98 1,252,329,702	3.500000 2028/10/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.05 1,228,156,838	97.60 1,222,533,203	3.500000 2033/02/15	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	101.68 1,193,961,786	101.50 1,191,871,710	4.000000 2030/02/28	0.30
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	101.96 1,197,214,320	101.28 1,189,241,502	4.250000 2035/08/15	0.30
27	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	52,000,000	100.57 1,168,728,073	100.73 1,170,587,310	1.790000 2032/03/25	0.30
28	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	104.50 1,167,632,196	104.58 1,168,503,714	2.540000 2030/12/25	0.30
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	90.07 1,128,108,736	89.89 1,125,954,470	1.625000 2031/05/15	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	101.69 1,114,517,762	101.50 1,112,391,677	4.000000 2030/03/31	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	97.67%
合計	97.67%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2026年1月	買建	284,000	59,800,299	59,995,988	0.02%
		シンガポール・ドル買/円売 2026年1月	買建	328,000	39,403,820	39,923,832	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2026年1月	買建	1,872,000	209,116,424	213,844,596	0.05%
		豪ドル買/円売 2026年1月	買建	620,000	63,513,641	64,928,899	0.02%
		イスラエル・シュケル買/円売 2026年1月	買建	1,330,000	63,376,096	65,294,754	0.02%
		オフショア人民元買/円売 2026年1月	買建	39,451,000	869,710,039	881,163,491	0.22%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2026年1月	買建	1,828,000	162,869,498	165,967,593	0.04%
		米ドル買/円売 2026年1月	買建	2,415,000	377,450,378	377,777,876	0.10%
		ユーロ買/円売 2026年1月	買建	3,369,000	613,134,626	620,665,274	0.16%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2026年1月	買建	2,278,000	34,934,724	35,503,769	0.01%

		マレーシア・リンギット 売/円買 2026年1月	売建	2,000,000	77,086,000	77,106,400	△0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワつみたてインデックスバランス30

2025年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,432円
純資産総額	1.4億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.2%
3カ月間	2.5%
6カ月間	5.5%
1年間	4.5%
3年間	23.5%
5年間	25.4%
設定来	34.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第１期 20年6月	第２期 21年6月	第３期 22年6月	第４期 23年6月	第５期 24年6月	第６期 25年6月						
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円						

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	394	54.1%
国内株式・先物	1,659	20.2%
外国債券	1,057	14.6%
外国株式・先物	1,097	10.1%
外国リート	45	0.1%
外国投資証券	3	0.0%
コール・ローン、その他		1.8%
合計	4,255	-

通貨別構成	比率
日本円	74.8%
米ドル	14.7%
ユーロ	5.4%
オフショア人民元	1.8%
英ポンド	1.3%
カナダ・ドル	0.7%
豪ドル	0.4%
スイス・フラン	0.3%
メキシコ・ペソ	0.1%
その他	0.7%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.4
最終利回り(%)	2.2
修正デュレーション	7.6
残存年数	9.1

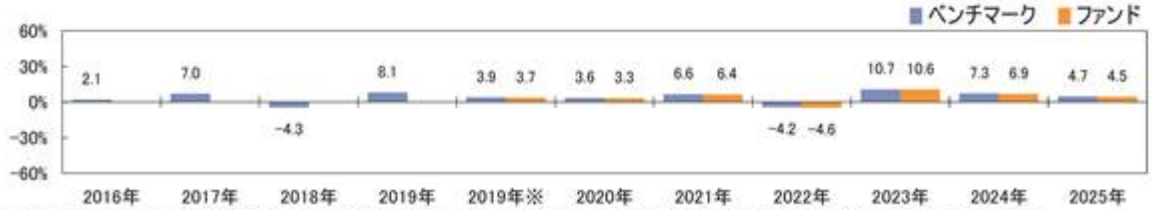
債券格付別構成	比率
AAA	86.7%
AA	7.6%
A	3.9%
BBB	0.1%
BB以下・無格付	1.6%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	0.7%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%
NVIDIA CORP	アメリカ	0.6%
ソニーグループ	日本	0.6%
日 立	日本	0.5%
APPLE INC	アメリカ	0.5%
三井住友フィナンシャルG	日本	0.4%
TOPIX　先物 0803月	日本	0.4%
MICROSOFT CORP	アメリカ	0.4%
ソフトバンクグループ	日本	0.3%
合計		5.2%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.6%保有しております。
※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

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2019年※は設定日（6月12日）から年末、2025年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①+②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワつみたてインデックスバランス30	0.17%	0.15%	0.01%

※対象期間は2024年6月6日～2025年6月5日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約請求の受付けを中止することができるほか、すでに受付けた一部解約請求を取消すことができるものとします。一部解約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請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。ただし、第1計算期間は2019年6月12日から2020年6月5日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

5．前2．から前4．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2．から前4．までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

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

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

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

② 信託約款の変更等

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

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

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

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

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

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

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

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書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。

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2024年6月6日から2025年6月5日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワつみたてインデックスバランス３０

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2024年6月5日現在	第6期 2025年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	449,827	481,817
親投資信託受益証券	119,859,581	127,013,607
流動資産合計	120,309,408	127,495,424
資産合計	120,309,408	127,495,424
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	9,361	10,259
未払委託者報酬	78,305	85,791
その他未払費用	4,608	5,072
流動負債合計	92,274	101,122
負債合計	92,274	101,122
純資産の部		
元本等		
元本	※1 95,346,267	※1 101,821,723
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,870,867	25,572,579
（分配準備積立金）	15,049,591	13,964,742
元本等合計	120,217,134	127,394,302
純資産合計	120,217,134	127,394,302
負債純資産合計	120,309,408	127,495,424

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2023年6月6日 至　2024年6月5日	第6期 自　2024年6月6日 至　2025年6月5日
営業収益		
受取利息	6	1,053
有価証券売買等損益	8,169,051	△ 857,574
営業収益合計	8,169,057	△ 856,521
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	17,812	20,275
委託者報酬	149,049	169,647
その他費用	8,768	10,001
営業費用合計	175,630	199,923
営業利益又は営業損失（△）	7,993,427	△ 1,056,444
経常利益又は経常損失（△）	7,993,427	△ 1,056,444
当期純利益又は当期純損失（△）	7,993,427	△ 1,056,444
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（△）	202,719	13,558
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,132,450	24,870,867
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,779,740	3,667,205
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,779,740	3,667,205
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,832,031	1,895,491
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,832,031	1,895,491
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,870,867	25,572,579

(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6期 自2024年6月6日 至2025年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第5期 2024年6月5日現在	第6期 2025年6月5日現在
1. ※1 期首元本額	82,561,437円	95,346,267円
期中追加設定元本額	23,373,848円	13,723,262円
期中一部解約元本額	10,589,018円	7,247,806円
2. 計算期間末日における受益権の総数	95,346,267口	101,821,723口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第5期 自2023年6月6日 至2024年6月5日	第6期 自2024年6月6日 至2025年6月5日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5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（7,790,697円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,821,276円）及び分配準備積立金（7,258,889円）より分配対象額は24,870,867円（1万口当たり2,608.48円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（11,607,837円）及び分配準備積立金（13,964,742円）より分配対象額は25,572,579円（1万口当たり2,511.51円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第6期 自2024年6月6日 至2025年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第6期 2025年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第5期 2024年6月5日現在	第6期 2025年6月5日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,502,977	△1,043,978
合計	7,502,977	△1,043,978

（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5期 2024年6月5日現在	第6期 2025年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自2024年6月6日 至2025年6月5日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第5期 2024年6月5日現在	第6期 2025年6月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2608円 (12,608円)	1.2512円 (12,512円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	12,624,821	25,903,607	

	外国株式インデックスマザーファンド	1,950,434	13,315,612	
	外国債券インデックスマザーファンド	5,257,912	18,904,822	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	59,449,056	68,889,566	
親投資信託受益証券 合計			127,013,607	
合計			127,013,607	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2024年6月5日現在 金　額（円）	2025年6月5日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		19,339,500,913	18,437,929,811
株式	※2※3	349,141,127,490	423,077,170,510
派生商品評価勘定		26,412,650	498,244,000
未収入金		67,818,800	9,144,013
未収配当金		2,709,747,014	3,758,207,273
その他未収収益	※4	24,814,523	75,853,538

差入委託証拠金	268,993,515	200,079,841
流動資産合計	371,578,414,905	446,056,628,986
資産合計	371,578,414,905	446,056,628,986
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	50,316,250	23,808,850
前受金	185,884,500	601,428,000
未払金	7,320,801,514	-
未払解約金	232,156,570	236,734,570
未払利息	-	4,315,294
受入担保金	8,177,269,619	11,522,557,335
流動負債合計	15,966,428,453	12,388,844,049
負債合計	15,966,428,453	12,388,844,049
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	178,188,938,492	211,363,531,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	177,423,047,960	222,304,253,247
元本等合計	355,611,986,452	433,667,784,937
純資産合計	355,611,986,452	433,667,784,937
負債純資産合計	371,578,414,905	446,056,628,986

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6月6日 至2025年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
1.　※1 期首	2023年6月6日	2024年6月6日
期首元本額	154,707,449,700円	178,188,938,492円
期中追加設定元本額	39,690,949,399円	59,126,839,601円
期中一部解約元本額	16,209,460,607円	25,952,246,403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	2,780,326,066円	2,816,300,411円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,091,254,535円	3,543,330,298円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	908,055円	901,720円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,102,808円	8,694,234円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	139,851,291円	104,314,204円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	11,667,234円	9,684,377円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	344,658,301円	256,901,047円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,193,640,356円	1,492,584,529円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	723,449,655円	936,348,340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	838,959,109円

Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	12,955,296円	10,778,646円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	240,438,554円	237,616,094円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	7,979,704,045円	10,948,436,967円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,634,420,825円	5,456,442,523円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,083,856,357円	1,268,242,644円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,190,937円	5,689,918円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	71,179,124,311円	72,635,380,181円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,004,647,121円	2,926,238,420円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,900,613,734円	5,230,272,804円
ダイワ・ライフ・バランス７０	5,876,164,957円	6,298,017,720円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,734,033,540円	10,741,699,456円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	46,611,262円	38,232,960円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	72,330,830円	72,836,235円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,635,921,835円	7,308,934,595円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,110,455円	12,624,821円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	12,116,962円	14,914,910円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	32,181,984円	283,004,255円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	17,295,931,594円	28,886,429,255円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	46,931,794円	41,004,364円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	19,120,292円	18,674,040円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,235,867,266円	2,594,109,197円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	320,340,775円	258,958,330円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	39,868,561円	37,548,776円

	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	59,424,894円	49,301,187円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	241,876,350円	231,516,746円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	12,600,334,549円	17,839,210,306円
	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	9,320,884,219円	15,218,415,998円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,356,045,033円	3,343,584,830円
	スタイル9（4資産分散・保守型）	302,513円	1,367,073円
	スタイル9（4資産分散・バランス型）	2,454,260円	9,215,795円
	スタイル9（4資産分散・積極型）	3,431,870円	13,289,777円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	189,174円	560,853円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	4,377,136円	16,955,874円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	5,424,192円	18,818,708円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	254,361円	898,522円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	3,690,361円	14,912,958円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	10,446,027円	38,956,049円
	ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	-円	5,484,631円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,062,471,284円	923,660,239円
	ダイワライフスタイル２５	93,947,166円	86,195,385円
	ダイワライフスタイル５０	442,746,622円	415,552,337円
	ダイワライフスタイル７５	382,356,001円	370,651,385円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	7,884,940,892円	7,430,877,657円
計		178,188,938,492円	211,363,531,690円
2.	期末日における受益権の総数	178,188,938,492口	211,363,531,690口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　7,649,604,490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　10,968,544,250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　764,480,000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　936,860,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月6日 至2025年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月5日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	38,528,920,851	19,603,943,417
合計	38,528,920,851	19,603,943,417

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年6月5日現在				2025年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								

株価指数 先物取引								
買建	6,456,434,900	-	6,432,660,000	△23,774,900	10,181,397,000	-	10,656,045,000	474,648,000
合計	6,456,434,900	-	6,432,660,000	△23,774,900	10,181,397,000	-	10,656,045,000	474,648,000

（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）

	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
１口当たり純資産額	1.9957円	2.0518円
（1万口当たり純資産額）	(19,957円)	(20,518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	6,400	4,560.00	29,184,000	
ニッスイ	151,600	837.60	126,980,160	
マルハニチロ	22,500	3,057.00	68,782,500	
ユキグニファクトリー	12,900	1,084.00	13,983,600	
カネコ種苗	4,300	1,380.00	5,934,000	
サカタのタネ	18,800	3,405.00	64,014,000	貸付株式数　400株
ホクト	13,500	1,786.00	24,111,000	
ショーボンドＨＤ	19,900	4,857.00	96,654,300	
ミライト・ワン	48,000	2,518.50	120,888,000	
タマホーム	9,500	3,440.00	32,680,000	貸付株式数　3,800株
住石ホールディングス	19,000	655.00	12,445,000	貸付株式数　6,700株
日鉄鉱業	6,100	7,560.00	46,116,000	貸付株式数　2,400株
三井松島HLDGS	7,400	4,620.00	34,188,000	貸付株式数　500株

ＩＮＰＥＸ	458,400	1,962.00	899,380,800	
石油資源開発	83,200	993.00	82,617,600	貸付株式数　15,000株
K&Oエナジーグループ	6,900	2,935.00	20,251,500	貸付株式数　1,800株
リョーサン菱洋HD	17,500	2,554.00	44,695,000	貸付株式数　7,000株
第一カッター興業	3,900	1,370.00	5,343,000	
安藤・間	87,900	1,445.00	127,015,500	
東急建設	47,500	935.00	44,412,500	
コムシスホールディングス	53,800	3,246.00	174,634,800	
ビーアールホールディングス	22,200	325.00	7,215,000	貸付株式数　8,900株
高松コンストラクションGP	11,300	2,793.00	31,560,900	
東建コーポレーション	3,300	13,680.00	45,144,000	貸付株式数　1,000株 (1,000株)
ヤマウラ	7,700	1,217.00	9,370,900	貸付株式数　3,000株
オリエンタル白石	56,100	361.00	20,252,100	
大成建設	96,300	7,974.00	767,896,200	
大 林 組	350,200	2,143.50	750,653,700	
清水建設	289,900	1,578.50	457,607,150	
長谷工コーポレーシヨン	97,300	2,155.00	209,681,500	
松井建設	9,900	1,064.00	10,533,600	貸付株式数　2,600株
鹿島建設	235,200	3,567.00	838,958,400	
不動テトラ	6,700	2,160.00	14,472,000	貸付株式数　2,600株
鉄建建設	6,700	2,724.00	18,250,800	
西松建設	16,900	4,757.00	80,393,300	
三井住友建設	85,500	594.00	50,787,000	
大豊建設	14,600	803.00	11,723,800	
奥 村 組	18,800	4,225.00	79,430,000	貸付株式数　7,300株
東鉄工業	11,700	3,585.00	41,944,500	
淺沼組	42,500	737.00	31,322,500	
戸田建設	130,500	894.70	116,758,350	
熊 谷 組	17,500	4,255.00	74,462,500	
矢作建設	14,400	1,715.00	24,696,000	貸付株式数　100株
ピーエス・コンストラクション	7,700	1,755.00	13,513,500	貸付株式数　2,700株
日本ハウスHLDGS	22,700	324.00	7,354,800	貸付株式数　9,200株
大東建託	36,300	15,525.00	563,557,500	
新日本建設	14,900	1,603.00	23,884,700	
東亜道路	18,300	1,501.00	27,468,300	
日本道路	10,700	2,514.00	26,899,800	
東亜建設	32,000	1,495.00	47,840,000	

日本国土開発	32,500	469.00	15,242,500		
若築建設	3,100	4,080.00	12,648,000	貸付株式数	700株
東洋建設	30,500	1,434.00	43,737,000		
五洋建設	138,800	866.90	120,325,720		
世紀東急	15,100	1,426.00	21,532,600	貸付株式数	6,100株
福 田 組	4,000	4,970.00	19,880,000		
住友林業	91,700	4,164.00	381,838,800	貸付株式数	34,900株
大和ハウス	320,100	4,829.00	1,545,762,900		
ライト工業	20,200	2,832.00	57,206,400		
積水ハウス	321,800	3,035.00	976,663,000		
日特建設	10,100	1,035.00	10,453,500		
北陸電気工事	7,300	1,173.00	8,562,900		
ユアテック	19,600	1,950.00	38,220,000	貸付株式数	5,800株
日本リーテック	8,300	1,630.00	13,529,000	貸付株式数	2,900株
四電工	13,300	1,281.00	17,037,300	貸付株式数	200株
中電工	16,500	3,365.00	55,522,500		
関 電 工	58,100	2,980.00	173,138,000		
きんでん	72,800	3,867.00	281,517,600		
東京エネシス	11,300	1,182.00	13,356,600		
トーエネック	17,600	1,182.00	20,803,200		
住友電設	8,600	6,420.00	55,212,000		
日本電設工業	19,900	2,402.00	47,799,800		
エクシオグループ	109,700	1,823.00	199,983,100		
新日本空調	13,800	2,208.00	30,470,400	貸付株式数	5,300株
九電工	22,900	5,288.00	121,095,200		
三機工業	22,100	3,895.00	86,079,500		
日揮ホールディングス	105,000	1,231.00	129,255,000		
中外炉工業	3,500	3,435.00	12,022,500	貸付株式数	1,400株
太平電業	7,000	5,020.00	35,140,000	貸付株式数	1,200株
高砂熱学	25,600	6,713.00	171,852,800	貸付株式数	9,700株
朝日工業社	9,900	2,322.00	22,987,800		
明星工業	17,800	1,464.00	26,059,200		
大 氣 社	27,200	2,470.00	67,184,000		
ダイダン	18,600	4,300.00	79,980,000		
日比谷総合設備	8,600	3,445.00	29,627,000	貸付株式数	3,400株
ニップン	35,100	2,155.00	75,640,500	貸付株式数	13,100株
日清製粉Ｇ本社	105,800	1,713.00	181,235,400		
日東富士製粉	1,900	7,300.00	13,870,000		
昭和産業	9,000	2,866.00	25,794,000		
中部飼料	14,700	1,543.00	22,682,100		

フィード・ワン	15,600	1,004.00	15,662,400	
日本甜菜糖	5,600	2,295.00	12,852,000	貸付株式数 2,200株
DM三井製糖	10,600	3,115.00	33,019,000	
ウェルネオシュガー	6,000	2,269.00	13,614,000	
ＬＩＦＵＬＬ	32,600	178.00	5,802,800	
ＭＩＸＩ	20,900	3,310.00	69,179,000	
ジェイエイシーリクルートメント	40,200	975.00	39,195,000	
日本M&Aセンターホールデ	163,500	701.70	114,727,950	
メンバーズ	4,300	1,209.00	5,198,700	
ＵＴグループ	14,500	2,475.00	35,887,500	
アイティメディア	6,000	1,623.00	9,738,000	貸付株式数 1,300株
ケアネット	22,800	721.00	16,438,800	貸付株式数 9,100株
E・Jホールディングス	6,500	1,509.00	9,808,500	貸付株式数 2,600株
オープンアップグループ	37,100	1,748.00	64,850,800	
コシダカホールディングス	30,500	1,147.00	34,983,500	貸付株式数 13,200株
パソナグループ	13,000	2,361.00	30,693,000	
リンクアンドモチベーション	26,400	523.00	13,807,200	貸付株式数 10,700株
エス・エム・エス	42,500	1,459.00	62,007,500	
パーソルホールディングス	1,013,700	272.80	276,537,360	
クックパッド	30,400	188.00	5,715,200	貸付株式数 12,100株
森永製菓	42,700	2,349.00	100,302,300	
中 村 屋	2,700	3,100.00	8,370,000	
江崎グリコ	30,500	4,714.00	143,777,000	貸付株式数 12,300株
名糖産業	4,700	2,006.00	9,428,200	
井村屋グループ	5,800	2,423.00	14,053,400	
不 二 家	7,300	2,322.00	16,950,600	貸付株式数 2,900株
山崎製パン	71,300	3,208.00	228,730,400	
モロゾフ	10,300	1,630.00	16,789,000	貸付株式数 4,100株
亀田製菓	6,800	3,685.00	25,058,000	貸付株式数 2,400株
寿スピリッツ	63,000	2,246.00	141,498,000	貸付株式数 25,400株
カルビー	48,800	2,769.00	135,127,200	
森永乳業	39,600	3,294.00	130,442,400	
六甲バター	7,800	1,220.00	9,516,000	貸付株式数 3,000株
ヤクルト	152,200	2,890.00	439,858,000	貸付株式数 59,500株
明治ホールディングス	137,000	3,210.00	439,770,000	
雪印メグミルク	28,600	2,709.00	77,477,400	
プリマハム	14,300	2,254.00	32,232,200	貸付株式数 5,600株
日本ハム	44,100	5,065.00	223,366,500	

丸大食品	10,700	1,787.00	19,120,900	貸付株式数	3,900株
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	11,700	2,619.00	30,642,300	貸付株式数	4,700株
柿安本店	4,500	2,688.00	12,096,000	貸付株式数	1,600株
伊藤ハム米久HLDGS	16,300	4,990.00	81,337,000		
学情	5,700	1,735.00	9,889,500	貸付株式数	2,200株
スタジオアリス	5,600	2,083.00	11,664,800	貸付株式数	2,200株 (300株)
クロスキャット	6,200	1,050.00	6,510,000	貸付株式数	100株
システナ	155,000	396.00	61,380,000		
ＮＪＳ	2,700	5,700.00	15,390,000	貸付株式数	1,100株
デジタルアーツ	6,900	7,300.00	50,370,000	貸付株式数	2,700株
日鉄ソリューションズ	37,000	3,957.00	146,409,000	貸付株式数	14,900株
綜合警備保障	185,700	1,004.50	186,535,650		
キューブシステム	5,700	1,067.00	6,081,900	貸付株式数	2,200株
いちご	90,100	379.00	34,147,900	貸付株式数	36,400株
日本駐車場開発	126,800	246.00	31,192,800		
コア	4,800	1,863.00	8,942,400		
カカクコム	80,200	2,484.50	199,256,900		
セントケア・ホールディング	7,100	767.00	5,445,700	貸付株式数	2,800株
ルネサンス	8,600	1,022.00	8,789,200	貸付株式数	3,400株
ディップ	19,500	2,160.00	42,120,000	貸付株式数	7,800株
SBSホールディングス	9,600	2,792.00	26,803,200	貸付株式数	3,000株
デジタルホールディングス	5,700	1,345.00	7,666,500	貸付株式数	2,200株
新日本科学	11,800	1,349.00	15,918,200		
エムスリー	219,700	2,177.50	478,396,750		
ワールドホールディングス	4,400	2,198.00	9,671,200	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	44,500	2,647.00	117,791,500	貸付株式数	17,900株
博報堂ＤＹHLDGS	126,100	1,115.50	140,664,550		
ぐるなび	20,700	255.00	5,278,500		
タカミヤ	15,100	353.00	5,330,300	貸付株式数	6,000株
ファンコミュニケーションズ	13,400	427.00	5,721,800	貸付株式数	5,400株
ライク	5,800	1,386.00	8,038,800	貸付株式数	2,300株 (2,000株)
エスプール	35,200	353.00	12,425,600	貸付株式数	900株
WDBホールディングス	5,700	1,864.00	10,624,800	貸付株式数	2,200株
手間いらず	1,600	3,230.00	5,168,000	貸付株式数	500株
アドウェイズ	13,600	318.00	4,324,800	貸付株式数	5,500株

バリューコマース	9,800	808.00	7,918,400		
インフォマート	104,900	412.00	43,218,800	貸付株式数	42,300株
サッポロホールディングス	35,100	7,274.00	255,317,400		
アサヒグループホールディン	799,800	1,900.00	1,519,620,000		
キリンＨＤ	443,600	2,072.00	919,139,200		
シマダヤ	3,100	1,773.00	5,496,300		
宝ホールディングス	71,800	1,256.00	90,180,800		
オエノンホールディングス	34,500	542.00	18,699,000	貸付株式数	13,900株
養 命 酒	3,500	3,055.00	10,692,500	貸付株式数	1,400株
飛島ホールディングス	10,900	1,850.00	20,165,000		
コカ・コーラボトラーズJHD	66,700	2,381.00	158,812,700		
ライフドリンク カンパニー	23,300	2,050.00	47,765,000	貸付株式数	9,400株
サントリー食品インター	75,000	4,640.00	348,000,000		
ダイドーグループHD	12,100	2,684.00	32,476,400	貸付株式数	4,800株
伊 藤 園	34,500	3,393.00	117,058,500	貸付株式数	13,900株
キーコーヒー	11,900	1,967.00	23,407,300	貸付株式数	4,800株
日清オイリオグループ	15,000	4,720.00	70,800,000		
不二製油	21,300	2,929.00	62,387,700		
Ｊ－オイルミルズ	12,200	1,948.00	23,765,600		
インターメスティック	8,700	2,060.00	17,922,000	貸付株式数	1,400株
サンエー	19,400	2,898.00	56,221,200	貸付株式数	7,800株
カワチ薬品	8,900	2,818.00	25,080,200		
エービーシー・マート	50,100	2,859.50	143,260,950		
ハードオフコーポレーション	4,500	1,724.00	7,758,000		
高千穂交易	9,100	2,083.00	18,955,300	貸付株式数	3,400株
アスクル	26,800	1,546.00	41,432,800		
ゲオホールディングス	12,900	1,602.00	20,665,800		
アダストリア	15,800	2,950.00	46,610,000	貸付株式数	200株
リガク・ホールディングス	73,600	712.00	52,403,200		
伊藤忠食品	2,600	10,370.00	26,962,000	貸付株式数	1,000株
くら寿司	13,400	3,180.00	42,612,000	貸付株式数	5,100株
キャンドゥ	4,100	3,495.00	14,329,500	貸付株式数	1,600株
パルグループHLDGS	26,200	3,580.00	93,796,000		
エディオン	49,800	1,953.00	97,259,400	貸付株式数	20,100株
あらた	17,500	2,984.00	52,220,000		
サーラコーポレーション	24,000	946.00	22,704,000	貸付株式数	1,600株
トーメンデバイス	1,700	5,660.00	9,622,000	貸付株式数	500株
ハローズ	4,600	4,800.00	22,080,000	貸付株式数	1,700株

JPホールディングス	28,400	553.00	15,705,200	貸付株式数	11,400株
フジオフードG本社	14,300	1,199.00	17,145,700	貸付株式数	5,800株 (100株)
あみやき亭	8,300	1,430.00	11,869,000	貸付株式数	3,200株
東京エレクトロンデバイス	11,400	2,745.00	31,293,000	貸付株式数	4,600株
円谷フィールズホールディ	18,500	2,050.00	37,925,000	貸付株式数	7,400株
双日	127,400	3,496.00	445,390,400		
アルフレッサホールディングス	100,600	1,931.50	194,308,900		
大黒天物産	4,100	7,330.00	30,053,000	貸付株式数	1,300株
ハニーズホールディングス	10,200	1,527.00	15,575,400	貸付株式数	3,100株
キッコーマン	352,900	1,280.50	451,888,450		
味 の 素	488,100	3,604.00	1,759,112,400		
ブルドックソース	5,600	1,770.00	9,912,000	貸付株式数	2,200株
キユーピー	57,200	3,340.00	191,048,000		
ハウス食品G本社	35,900	2,798.50	100,466,150		
カ ゴ メ	45,600	2,923.50	133,311,600	貸付株式数	16,000株
アリアケジャパン	10,600	6,500.00	68,900,000	貸付株式数	1,200株
エバラ食品工業	2,700	2,562.00	6,917,400		
キオクシアホールディングス	65,500	2,116.00	138,598,000	貸付株式数	26,400株
ニチレイ	83,100	1,885.50	156,685,050		
横浜冷凍	28,800	886.00	25,516,800	貸付株式数	11,200株
東洋水産	49,300	9,128.00	450,010,400		
イートアンドHLDGS	5,500	2,020.00	11,110,000	貸付株式数	2,200株
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,800	1,000.00	5,800,000	貸付株式数	2,200株
日清食品ＨＤ	134,600	2,976.00	400,569,600		
フジッコ	10,900	1,598.00	17,418,200	貸付株式数	4,400株
ロックフィールド	11,900	1,490.00	17,731,000	貸付株式数	4,700株
日本たばこ産業	647,200	4,287.00	2,774,546,400		
ケンコーマヨネーズ	6,700	1,831.00	12,267,700	貸付株式数	2,600株
わらべや日洋HD	7,100	2,270.00	16,117,000		
なとり	6,700	2,015.00	13,500,500		
ファーマフーズ	14,100	968.00	13,648,800	貸付株式数	5,500株
北の達人コーポ	45,600	139.00	6,338,400	貸付株式数	18,200株 (1,300株)
ユーグレナ	66,200	455.00	30,121,000	貸付株式数	26,700株
紀文食品	9,200	1,061.00	9,761,200	貸付株式数	3,400株
ピックルスホールディングス	6,200	905.00	5,611,000		

スター・マイカ・HLDGS	11,000	1,032.00	11,352,000	貸付株式数	4,300株
SREホールディングス	3,900	3,690.00	14,391,000	貸付株式数	1,600株
片倉工業	10,000	2,214.00	22,140,000		
グ ン ゼ	15,400	3,560.00	54,824,000		
ヒューリック	248,500	1,426.00	354,361,000		
ラサ商事	6,000	1,476.00	8,856,000	貸付株式数	900株
アルペン	11,000	2,356.00	25,916,000	貸付株式数	4,400株
ラクーンホールディングス	8,100	821.00	6,650,100	貸付株式数	3,200株
クオールホールディングス	14,200	1,878.00	26,667,600		
アルコニックス	16,300	1,785.00	29,095,500		
神戸物産	88,500	4,587.00	405,949,500	貸付株式数	34,600株
ソリトンシステムズ	5,600	1,323.00	7,408,800		
ジンズホールディングス	7,800	8,440.00	65,832,000	貸付株式数	3,400株
ビックカメラ	60,900	1,530.00	93,177,000	貸付株式数	24,600株
DCMホールディングス	59,300	1,325.00	78,572,500	貸付株式数	9,200株
ペッパーフードサービス	34,100	211.00	7,195,100	貸付株式数	13,600株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	162,200	2,840.00	460,648,000	貸付株式数	65,500株
あい ホールディングス	20,600	2,302.00	47,421,200		
Ｊ．フロント リテイリング	131,300	1,991.50	261,483,950	貸付株式数	51,300株
ドトール・日レスＨＤ	20,300	2,625.00	53,287,500		
マツキヨココカラ&カンパニー	201,800	2,860.00	577,148,000		
ブロンコビリー	6,700	3,675.00	24,622,500	貸付株式数	2,700株
ＺＯＺＯ	255,200	1,544.00	394,028,800	貸付株式数	33,200株
トレジャー・ファクトリー	7,900	1,816.00	14,346,400		
物語コーポレーション	22,200	3,490.00	77,478,000	貸付株式数	8,900株
三越伊勢丹ＨＤ	169,200	2,169.00	366,994,800		
東洋紡	46,800	906.00	42,400,800		
ユニチカ	35,000	162.00	5,670,000	貸付株式数	13,200株
富士紡ホールディングス	4,100	5,200.00	21,320,000		
日清紡ホールディングス	82,100	914.00	75,039,400		
倉敷紡績	7,300	7,420.00	54,166,000		
ダイワボウＨＤ	50,700	2,482.00	125,837,400		
シキボウ	7,800	957.00	7,464,600	貸付株式数	3,100株
日東紡績	12,200	5,050.00	61,610,000		
トヨタ紡織	45,500	1,928.00	87,724,000		
マクニカホールディングス	86,900	1,841.50	160,026,350	貸付株式数	5,200株
Ｈａｍｅｅ	5,300	1,383.00	7,329,900		
ラクト・ジャパン	4,900	3,615.00	17,713,500	貸付株式数	1,900株

ウエルシアＨＤ	59,400	2,578.50	153,162,900		
クリエイトＳＤＨ	16,200	3,145.00	50,949,000	貸付株式数	6,400株
グリムス	4,800	2,391.00	11,476,800	貸付株式数	1,900株
バイタルＫＳＫHD	15,700	1,227.00	19,263,900		
八洲電機	9,300	1,703.00	15,837,900	貸付株式数	3,700株
メディアスホールディングス	7,400	966.00	7,148,400	貸付株式数	2,900株
レスター	9,700	2,472.00	23,978,400		
TOKAIホールディングス	62,100	986.00	61,230,600		
三洋貿易	14,100	1,445.00	20,374,500		
シュッピン	11,300	1,120.00	12,656,000	貸付株式数	4,500株
ビューティガレージ	3,100	1,590.00	4,929,000	貸付株式数	100株
オイシックス・ラ・大地	18,500	1,668.00	30,858,000	貸付株式数	7,200株
ウイン・パートナーズ	8,300	1,304.00	10,823,200	貸付株式数	3,300株
ネクステージ	26,200	1,670.00	43,754,000	貸付株式数	9,900株
ジョイフル本田	31,800	2,024.00	64,363,200	貸付株式数	12,000株
エターナルホスピタリティグル	4,700	2,902.00	13,639,400	貸付株式数	1,800株
ホットランドホールディング	8,800	2,119.00	18,647,200	貸付株式数	3,500株 (200株)
すかいらーくHD	156,400	3,180.00	497,352,000	貸付株式数	63,100株
SFPホールディングス	6,500	2,125.00	13,812,500	貸付株式数	2,600株
綿半ホールディングス	8,900	1,560.00	13,884,000	貸付株式数	3,600株
日本毛織	27,800	1,448.00	40,254,400		
ヨシックスホールディングス	3,800	2,506.00	9,522,800	貸付株式数	1,300株
ユナイテッド・スーパーマーケ	48,900	909.00	44,450,100	貸付株式数	19,600株
野村不動産HLDGS	334,000	833.50	278,389,000		
三重交通グループHD	22,800	483.00	11,012,400	貸付株式数	9,100株
地主	9,400	2,126.00	19,984,400	貸付株式数	3,400株
フィル・カンパニー	2,100	824.00	1,730,400	貸付株式数	800株
ＪＰＭＣ	6,200	1,176.00	7,291,200		
フージャースHD	16,400	1,218.00	19,975,200		
オープンハウスグループ	34,200	6,217.00	212,621,400		
東急不動産ＨＤ	320,300	1,040.50	333,272,150		
飯田ＧＨＤ	102,100	2,003.00	204,506,300		
帝国繊維	12,300	2,750.00	33,825,000	貸付株式数	4,900株
日本コークス工業	110,100	84.00	9,248,400	貸付株式数	44,700株
ゴルフダイジェスト・オン	6,700	428.00	2,867,600		

ＢＥＥＮＯＳ	1,700	3,980.00	6,766,000		
あさひ	9,600	1,327.00	12,739,200	貸付株式数	3,800株
日本調剤	7,500	3,195.00	23,962,500	貸付株式数	2,300株
コスモス薬品	22,700	8,790.00	199,533,000	貸付株式数	7,200株
シップヘルスケアHD	45,200	1,872.00	84,614,400		
ソフトクリエイトHD	7,800	2,159.00	16,840,200		
セブン&アイ・HLDGS	1,264,200	2,212.00	2,796,410,400		
クリエイト・レストランツ・ホール	86,100	1,368.00	117,784,800	貸付株式数	34,700株
明治電機工業	5,700	1,871.00	10,664,700	貸付株式数	2,200株
ツルハホールディングス	20,000	11,410.00	228,200,000		
サンマルクホールディングス	11,300	2,346.00	26,509,800		
トリドールホールディングス	32,200	4,128.00	132,921,600	貸付株式数	12,800株 (400株)
帝 人	104,100	1,124.00	117,008,400		
東 レ	791,900	979.00	775,270,100		
ク ラ レ	144,500	1,808.00	261,256,000		
旭 化 成	718,100	988.00	709,482,800		
TOKYO BASE	12,400	390.00	4,836,000	貸付株式数	3,900株
稲葉製作所	6,200	1,760.00	10,912,000	貸付株式数	2,400株
宮地エンジニアリングＧ	13,400	1,823.00	24,428,200	貸付株式数	5,400株
トーカロ	32,200	1,842.00	59,312,400		
ＳＵＭＣＯ	212,500	949.10	201,683,750	貸付株式数	85,800株
川田テクノロジーズ	7,100	3,545.00	25,169,500		
RS TECHNOLOGIES	8,600	2,980.00	25,628,000		
AND DOホールディングス	6,400	1,222.00	7,820,800	貸付株式数	2,500株
ケイアイスター不動産	5,800	4,775.00	27,695,000	貸付株式数	2,300株
ジェイ・エス・ビー	4,400	3,750.00	16,500,000	貸付株式数	1,800株
ロードスターキャピタル	6,100	2,673.00	16,305,300		
霞ヶ関キャピタル	4,400	12,900.00	56,760,000	貸付株式数	1,700株
JMホールディングス	8,200	2,424.00	19,876,800	貸付株式数	3,200株
コメダホールディングス	29,900	2,825.00	84,467,500		
アレンザホールディングス	8,500	1,012.00	8,602,000	貸付株式数	3,400株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,400	1,454.00	4,943,600	貸付株式数	1,300株 (300株)
バロックジャパン	13,400	786.00	10,532,400	貸付株式数	5,400株
クスリのアオキHLDGS	29,800	3,513.00	104,687,400	貸付株式数	4,700株
力の源HD	8,600	1,329.00	11,429,400	貸付株式数	3,400株

FOOD&LIFE COMPAN	65,700	6,430.00	422,451,000	貸付株式数	23,800株
アセンテック	4,500	1,433.00	6,448,500		
セーレン	20,900	2,440.00	50,996,000		
小松マテーレ	15,700	729.00	11,445,300		
ワコールホールディングス	22,400	4,725.00	105,840,000		
ホギメディカル	14,600	3,740.00	54,604,000	貸付株式数	5,800株
ＴＳＩホールディングス	33,000	1,031.00	34,023,000	貸付株式数	13,300株
ワールド	16,700	2,521.00	42,100,700	貸付株式数	6,700株
ＴＩＳ	114,700	4,559.00	522,917,300		
グリーホールディングス	36,400	510.00	18,564,000		
GMOペパボ	1,300	1,566.00	2,035,800	貸付株式数	500株
コーエーテクモＨＤ	81,600	2,312.00	188,659,200		
三菱総合研究所	5,200	4,585.00	23,842,000		
ファインデックス	8,600	737.00	6,338,200	貸付株式数	3,200株
ブレインパッド	8,100	1,246.00	10,092,600	貸付株式数	3,400株
ＫＬａｂ	30,800	118.00	3,634,400	貸付株式数	500株
ポールトゥウィンホールディン	15,400	363.00	5,590,200		
ネクソン	233,000	2,585.00	602,305,000		
アイスタイル	33,200	495.00	16,434,000	貸付株式数	13,300株
エムアップホールディングス	13,300	2,116.00	28,142,800		
エイチームホールディングス	7,200	1,098.00	7,905,600	貸付株式数	2,800株
セルシス	20,500	1,506.00	30,873,000	貸付株式数	8,200株
エニグモ	12,100	308.00	3,726,800	貸付株式数	4,800株 (4,700株)
コロプラ	36,900	517.00	19,077,300		
ブロードリーフ	43,600	724.00	31,566,400	貸付株式数	10,400株
デジタルハーツHLDGS	7,700	960.00	7,392,000		
メディアドゥ	4,900	1,654.00	8,104,600	貸付株式数	1,900株
じげん	27,100	455.00	12,330,500	貸付株式数	10,900株
ブイキューブ	15,100	165.00	2,491,500	貸付株式数	5,900株
フィックスターズ	15,000	2,088.00	31,320,000	貸付株式数	6,000株
CARTA HOLDINGS	6,100	1,563.00	9,534,300	貸付株式数	2,400株
オプティム	11,200	554.00	6,204,800	貸付株式数	4,400株
セレス	4,900	2,184.00	10,701,600	貸付株式数	1,900株
ＳＨＩＦＴ	97,400	1,747.50	170,206,500	貸付株式数	42,300株
特種東海製紙	5,300	3,700.00	19,610,000	貸付株式数	2,100株
セック	1,900	5,350.00	10,165,000		

テクマトリックス	23,400	2,156.00	50,450,400		
プロシップ	4,800	2,543.00	12,206,400	貸付株式数	1,800株
ガンホー・オンライン・エンター	22,400	2,740.50	61,387,200		
GMOペイメントゲートウェイ	21,700	9,329.00	202,439,300	貸付株式数	1,000株
システムリサーチ	7,400	1,800.00	13,320,000	貸付株式数	3,000株
インターネットイニシアティブ	59,300	2,839.00	168,352,700		
さくらインターネット	16,900	3,820.00	64,558,000	貸付株式数	6,500株
GMOグローバルサインHD	3,300	2,028.00	6,692,400	貸付株式数	1,300株
SRAホールディングス	6,200	4,670.00	28,954,000		
朝日ネット	11,600	671.00	7,783,600		
ｅＢＡＳＥ	15,300	516.00	7,894,800		
アバントグループ	15,200	1,511.00	22,967,200	貸付株式数	6,100株
アドソル日進	8,700	1,065.00	9,265,500		
フリービット	5,700	1,537.00	8,760,900		
コムチュア	14,300	1,758.00	25,139,400		
アステリア	8,500	525.00	4,462,500	貸付株式数	1,900株
アイル	6,100	2,661.00	16,232,100	貸付株式数	2,400株
王子ホールディングス	410,300	688.00	282,286,400		
日本製紙	56,400	1,069.00	60,291,600	貸付株式数	500株
北越コーポレーション	60,900	997.00	60,717,300	貸付株式数	24,500株
大王製紙	54,700	825.00	45,127,500		
マークラインズ	6,400	2,117.00	13,548,800		
メディカル・データ・ビジ	13,000	414.00	5,382,000	貸付株式数	5,000株
ｇｕｍｉ	20,000	518.00	10,360,000	貸付株式数	8,000株
テラスカイ	4,200	2,699.00	11,335,800	貸付株式数	1,600株
デジタル・インフォメーション	6,300	2,503.00	15,768,900		
ネオジャパン	2,800	1,566.00	4,384,800		
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	2,200	2,286.00	5,029,200	貸付株式数	800株
ラクス	51,300	2,281.00	117,015,300		
ダブルスタンダード	3,800	1,624.00	6,171,200		
オープンドア	7,600	486.00	3,693,600	貸付株式数	3,000株
アカツキ	5,300	2,978.00	15,783,400		
UBICOMホールディングス	3,500	996.00	3,486,000		
カナミックネットワーク	13,600	421.00	5,725,600		
レンゴー	98,700	733.60	72,406,320		
トーモク	6,300	2,814.00	17,728,200	貸付株式数	2,500株
ザ・パック	8,000	3,325.00	26,600,000	貸付株式数	3,200株

チェンジホールディングス	26,900	1,192.00	32,064,800		
オークネット	10,000	1,528.00	15,280,000		
オロ	4,500	2,634.00	11,853,000	貸付株式数	1,600株
ユーザーローカル	5,200	1,846.00	9,599,200	貸付株式数	2,000株
PKSHA TECHNOLOGY	12,900	3,335.00	43,021,500	貸付株式数	5,200株
マネーフォワード	26,700	4,794.00	127,999,800	貸付株式数	10,400株
レゾナック・ホールディング	97,200	3,171.00	308,221,200	貸付株式数	1,000株
住友化学	871,400	336.30	293,051,820		
住友精化	5,100	4,430.00	22,593,000	貸付株式数	2,000株
日産化学	55,300	4,152.00	229,605,600		
ラサ工業	3,900	3,365.00	13,123,500		
クレハ	22,400	3,100.00	69,440,000		
多木化学	4,200	2,887.00	12,125,400	貸付株式数	800株
テイカ	7,700	1,343.00	10,341,100	貸付株式数	3,100株
石原産業	18,000	1,872.00	33,696,000		
日本曹達	23,000	2,960.00	68,080,000		
東ソー	144,600	2,082.50	301,129,500		
トクヤマ	35,000	2,922.00	102,270,000		
セントラル硝子	13,700	2,850.00	39,045,000		
東亞合成	50,300	1,400.00	70,420,000	貸付株式数	20,200株
大阪ソーダ	37,800	1,580.00	59,724,000	貸付株式数	15,200株
関東電化	23,300	843.00	19,641,900		
SUN ASTERISK	7,800	508.00	3,962,400	貸付株式数	3,100株
デンカ	39,400	2,017.50	79,489,500		
イビデン	62,700	5,781.00	362,468,700		
信越化学	963,500	4,522.00	4,356,947,000		
日本カーバイド	5,700	1,733.00	9,878,100		
プラスアルファ・コンサルティン	13,800	2,104.00	29,035,200	貸付株式数	5,500株
電算システムＨＤ	4,800	2,568.00	12,326,400		
堺 化 学	7,600	2,643.00	20,086,800		
第一稀元素化学工	11,900	640.00	7,616,000	貸付株式数	4,700株
エア・ウォーター	102,200	2,007.50	205,166,500		
日本酸素HLDGS	105,100	5,240.00	550,724,000	貸付株式数	6,500株
日本化学工業	4,000	1,975.00	7,900,000		
日本パーカライジング	48,300	1,210.00	58,443,000		
高圧ガス	15,700	1,016.00	15,951,200	貸付株式数	5,900株
四国化成ホールディンク	12,300	1,938.00	23,837,400	貸付株式数	2,600株
戸田工業	2,500	977.00	2,442,500	貸付株式数	600株

ステラ ケミファ	5,800	3,700.00	21,460,000	
保土谷化学	6,800	1,452.00	9,873,600	
日本触媒	69,400	1,629.50	113,087,300	
大日精化	7,300	3,125.00	22,812,500	
カネカ	26,700	3,912.00	104,450,400	
協和キリン	127,600	2,465.00	314,534,000	
APPIER GROUP	33,100	1,497.00	49,550,700	貸付株式数 13,300株
三菱瓦斯化学	85,600	2,173.50	186,051,600	
三井化学	97,500	3,235.00	315,412,500	
東京応化工業	51,700	3,771.00	194,960,700	
大阪有機化学	9,100	2,532.00	23,041,200	貸付株式数 3,600株
三菱ケミカルグループ	792,000	755.70	598,514,400	
ＫＨネオケム	19,500	2,532.00	49,374,000	貸付株式数 7,800株
ビジョナル	12,900	9,115.00	117,583,500	貸付株式数 4,600株
ダイセル	123,200	1,198.50	147,655,200	
住友ベークライト	34,100	3,934.00	134,149,400	
積水化学	215,800	2,475.00	534,105,000	
日本ゼオン	78,400	1,437.00	112,660,800	
アイカ工業	27,300	3,619.00	98,798,700	
ＵＢＥ	55,800	2,220.00	123,876,000	
積水樹脂	14,200	1,892.00	26,866,400	
旭有機材	7,200	3,815.00	27,468,000	貸付株式数 2,900株
ニチバン	6,700	1,971.00	13,205,700	貸付株式数 2,600株
リケンテクノス	19,400	1,103.00	21,398,200	
大倉工業	5,000	4,250.00	21,250,000	貸付株式数 2,000株
積水化成品	15,200	325.00	4,940,000	
群栄化学	2,500	2,872.00	7,180,000	
ダイキョーニシカワ	23,900	637.00	15,224,300	
森六	6,000	2,491.00	14,946,000	貸付株式数 2,400株
恵和	7,000	1,015.00	7,105,000	貸付株式数 2,500株
日本化薬	73,400	1,300.00	95,420,000	
カーリット	10,700	1,151.00	12,315,700	貸付株式数 4,200株
CLホールディングス	2,700	862.00	2,327,400	貸付株式数 900株
プレステージ・インター	52,000	614.00	31,928,000	
ハイマックス	3,400	1,163.00	3,954,200	
アミューズ	6,800	1,612.00	10,961,600	貸付株式数 2,500株
野村総合研究所	235,100	5,637.00	1,325,258,700	
ドリームインキュベータ	2,700	2,489.00	6,720,300	貸付株式数 1,000株
クイック	7,600	2,241.00	17,031,600	
日本システム技術	10,000	1,897.00	18,970,000	貸付株式数 4,000株

電通グループ	118,300	3,058.00	361,761,400		
インテージホールディングス	8,200	1,783.00	14,620,600		
テイクアンドギヴニーズ	5,300	833.00	4,414,900	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	5,000	1,216.00	6,080,000	貸付株式数	1,100株
ぴあ	3,800	2,979.00	11,320,200	貸付株式数	1,500株
イオンファンタジー	4,800	2,645.00	12,696,000	貸付株式数	1,900株
ソースネクスト	56,300	177.00	9,965,100	貸付株式数	22,700株
シーティーエス	15,300	822.00	12,576,600		
メディカルシステムネットワーク	11,200	456.00	5,107,200		
日本精化	7,200	2,267.00	16,322,400		
扶桑化学工業	10,100	3,755.00	37,925,500		
トリケミカル	11,800	2,728.00	32,190,400		
シンプレクスＨＤ	21,400	3,865.00	82,711,000	貸付株式数	7,100株
ＨＥＲＯＺ	4,300	1,075.00	4,622,500	貸付株式数	1,600株
ラクスル	21,600	1,215.00	26,244,000		
メルカリ	59,800	2,491.00	148,961,800	貸付株式数	23,300株
ＩＰＳ	3,100	2,295.00	7,114,500	貸付株式数	1,200株
システムサポートホールディン	3,800	2,477.00	9,412,600		
ＡＤＥＫＡ	37,800	2,679.00	101,266,200		
日油	124,400	2,587.00	321,822,800		
ハリマ化成グループ	8,400	781.00	6,560,400	貸付株式数	3,300株
ボードルア	3,000	3,290.00	9,870,000	貸付株式数	1,200株
イーソル	7,300	523.00	3,817,900	貸付株式数	600株
ウイングアーク1ST	11,300	3,880.00	43,844,000	貸付株式数	4,500株
ヒト・コミュニケーションズHD	4,300	925.00	3,977,500	貸付株式数	1,700株
サーバーワークス	1,900	2,375.00	4,512,500	貸付株式数	700株
Ｓａｎｓａｎ	30,700	2,091.00	64,193,700		
ギフティ	9,600	1,815.00	17,424,000	貸付株式数	3,800株
花 王	263,800	6,654.00	1,755,325,200		
第一工業製薬	3,900	3,660.00	14,274,000		
石原ケミカル	4,600	1,934.00	8,896,400		
三洋化成	6,700	3,675.00	24,622,500		
メドレー	11,900	2,964.00	35,271,600	貸付株式数	4,800株
ベース	5,300	3,500.00	18,550,000	貸付株式数	1,000株
ＪＭＤＣ	13,200	3,645.00	48,114,000		
武田薬品	965,300	4,274.00	4,125,692,200		

アステラス製薬	951,600	1,395.50	1,327,957,800	
住友ファーマ	96,600	817.00	78,922,200	
塩野義製薬	359,800	2,424.50	872,335,100	
日本新薬	28,400	3,504.00	99,513,600	
中外製薬	339,600	7,332.00	2,489,947,200	
科研製薬	18,600	3,777.00	70,252,200	
エーザイ	141,600	4,001.00	566,541,600	
理研ビタミン	8,400	2,593.00	21,781,200	
ロート製薬	114,600	1,987.00	227,710,200	
小野薬品	221,900	1,516.00	336,400,400	
久光製薬	24,100	4,048.00	97,556,800	
持田製薬	13,200	2,955.00	39,006,000	貸付株式数　5,300株
参天製薬	193,700	1,611.00	312,050,700	
扶桑薬品	4,200	2,147.00	9,017,400	
ツムラ	37,300	3,338.00	124,507,400	
テ ル モ	718,600	2,598.00	1,866,922,800	
ＨＵグループＨＤ	32,500	2,996.00	97,370,000	
キッセイ薬品工業	17,400	4,200.00	73,080,000	
生化学工業	20,700	642.00	13,289,400	
栄研化学	17,100	2,012.00	34,405,200	貸付株式数　4,500株
鳥居薬品	5,800	6,330.00	36,714,000	
ＪＣＲファーマ	36,700	590.00	21,653,000	貸付株式数　14,800株
東和薬品	14,600	3,190.00	46,574,000	
富士製薬工業	8,000	1,294.00	10,352,000	貸付株式数　3,200株
ゼリア新薬工業	17,200	2,056.00	35,363,200	貸付株式数　6,900株
ネクセラファーマ	50,900	950.00	48,355,000	貸付株式数　20,500株
第一三共	1,003,400	3,548.00	3,560,063,200	
杏林製薬	23,500	1,491.00	35,038,500	貸付株式数　9,400株
大幸薬品	24,600	248.00	6,100,800	貸付株式数　6,900株
ダイト	15,000	1,021.00	15,315,000	
大塚ホールディングス	267,900	6,880.00	1,843,152,000	
ペプチドリーム	52,600	1,695.00	89,157,000	
大日本塗料	12,000	1,164.00	13,968,000	
日本ペイントHOLD	479,400	1,097.50	526,141,500	
関西ペイント	86,400	2,009.50	173,620,800	貸付株式数　34,800株
中国塗料	24,500	2,272.00	55,664,000	貸付株式数　9,800株
藤倉化成	13,700	465.00	6,370,500	
太陽ホールディングス	18,900	5,970.00	112,833,000	貸付株式数　7,000株
ＤＩＣ	38,500	2,982.00	114,807,000	
サカタインクス	24,100	1,960.00	47,236,000	

ARTIENCE	19,400	2,902.00	56,298,800	
アルプス技研	9,200	2,706.00	24,895,200	
サニックスホールディングス	15,800	241.00	3,807,800	貸付株式数 6,000株
日本空調サービス	11,900	1,071.00	12,744,900	
オリエンタルランド	655,400	3,150.00	2,064,510,000	
フォーカスシステムズ	7,200	1,375.00	9,900,000	貸付株式数 2,700株
ダスキン	23,300	3,644.00	84,905,200	
パーク２４	83,000	1,862.00	154,546,000	
明光ネットワークジャパン	14,600	738.00	10,774,800	貸付株式数 5,800株
ファルコホールディングス	4,400	2,334.00	10,269,600	
クレスコ	17,000	1,673.00	28,441,000	
フジ・メディア・HD	104,200	2,907.00	302,909,400	貸付株式数 39,700株
ラウンドワン	105,000	1,263.00	132,615,000	
リゾートトラスト	87,800	1,641.00	144,079,800	
オービック	201,400	5,162.00	1,039,626,800	
ジャストシステム	15,600	3,520.00	54,912,000	
ＴＤＣソフト	18,300	1,319.00	24,137,700	貸付株式数 7,300株
ＬＩＮＥヤフー	1,736,400	516.50	896,850,600	貸付株式数 701,000株
ビー・エム・エル	13,700	3,040.00	41,648,000	
トレンドマイクロ	57,000	11,015.00	627,855,000	
IDホールディングス	7,000	2,160.00	15,120,000	
リソー教育	69,500	222.00	15,429,000	
日本オラクル	20,800	17,000.00	353,600,000	
早稲田アカデミー	6,200	2,300.00	14,260,000	貸付株式数 2,400株 (900株)
アルファシステムズ	3,400	3,430.00	11,662,000	
フューチャー	27,000	2,197.00	59,319,000	貸付株式数 1,600株
CAC HOLDINGS	6,600	2,065.00	13,629,000	
ユー・エス・エス	228,700	1,568.00	358,601,600	
オービックビジネスＣ	18,300	8,278.00	151,487,400	
アイティフォー	12,400	1,508.00	18,699,200	
東京個別指導学院	13,200	323.00	4,263,600	貸付株式数 400株
東計電算	3,000	3,790.00	11,370,000	貸付株式数 1,200株
サイバーエージェント	225,400	1,505.50	339,339,700	
楽天グループ	785,800	800.90	629,347,220	貸付株式数 297,500株
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,501.00	8,405,600	貸付株式数 2,200株
SBIグローバルアセット	21,800	647.00	14,104,600	
テー・オー・ダブリュー	19,800	315.00	6,237,000	貸付株式数 8,000株

大塚商会	123,000	2,935.50	361,066,500		
サイボウズ	14,900	3,235.00	48,201,500	貸付株式数	6,000株
GMOインターネット	2,700	2,702.00	7,295,400	貸付株式数	1,000株
山田コンサルティングGP	5,600	1,563.00	8,752,800	貸付株式数	2,200株
セントラルスポーツ	4,200	2,391.00	10,042,200	貸付株式数	1,400株
パラカ	3,000	1,820.00	5,460,000		
電通総研	10,500	6,640.00	69,720,000		
ＡＣＣＥＳＳ	11,300	857.00	9,684,100	貸付株式数	4,500株
デジタルガレージ	17,300	5,120.00	88,576,000		
イーエムシステムズ	17,100	761.00	13,013,100	貸付株式数	6,800株
ウェザーニューズ	8,600	3,915.00	33,669,000	貸付株式数	3,400株
ＣＩＪ	29,700	491.00	14,582,700	貸付株式数	11,900株
ビジネスエンジニアリング	2,500	4,795.00	11,987,500	貸付株式数	1,000株
WOWOW	8,200	998.00	8,183,600	貸付株式数	2,300株
スカラ	10,100	407.00	4,110,700	貸付株式数	3,400株
フルキャストホールディングス	8,500	1,759.00	14,951,500	貸付株式数	3,400株
エン・ジャパン	18,100	1,645.00	29,774,500	貸付株式数	7,300株
セルソース	7,200	679.00	4,888,800	貸付株式数	2,800株
あすか製薬ＨＤ	9,300	2,300.00	21,390,000	貸付株式数	3,600株
サワイグループHD	56,000	1,762.00	98,672,000		
富士フイルムHLDGS	654,100	3,131.00	2,047,987,100		
コニカミノルタ	244,000	434.80	106,091,200		
資 生 堂	226,500	2,423.50	548,922,750		
ライオン	138,100	1,542.00	212,950,200		
高砂香料	7,300	6,900.00	50,370,000		
マンダム	21,500	1,333.00	28,659,500		
ミルボン	17,400	2,512.00	43,708,800		
コーセー	22,100	5,978.00	132,113,800	貸付株式数	8,900株
コタ	11,000	1,459.00	16,049,000	貸付株式数	4,400株
ポーラ・オルビスHD	55,600	1,348.00	74,948,800	貸付株式数	18,200株
ノエビアホールディングス	9,700	4,320.00	41,904,000		
新日本製薬	6,200	2,267.00	14,055,400	貸付株式数	2,500株
Ｉ－ｎｅ	3,600	1,731.00	6,231,600	貸付株式数	1,400株
アクシージア	6,800	427.00	2,903,600	貸付株式数	600株
エステー	7,400	1,501.00	11,107,400	貸付株式数	700株
コ ニ シ	34,200	1,091.00	37,312,200	貸付株式数	13,300株
長谷川香料	20,700	2,938.00	60,816,600	貸付株式数	6,500株
小林製薬	28,400	5,433.00	154,297,200	貸付株式数	11,400株

荒川化学工業	10,000	1,070.00	10,700,000	
メック	8,900	2,550.00	22,695,000	
日本高純度化学	2,700	3,185.00	8,599,500	
タカラバイオ	34,100	787.00	26,836,700	貸付株式数　13,000株
ＪＣＵ	11,800	3,170.00	37,406,000	
ＯＡＴアグリオ	4,500	2,059.00	9,265,500	
デクセリアルズ	92,800	2,083.50	193,348,800	
アース製薬	9,900	4,920.00	48,708,000	貸付株式数　4,000株
北興化学	9,200	1,327.00	12,208,400	
大成ラミックグループ	3,100	2,448.00	7,588,800	
クミアイ化学	43,100	839.00	36,160,900	
日本農薬	16,600	855.00	14,193,000	
ニチレキグループ	11,500	2,424.00	27,876,000	貸付株式数　4,600株
ユシロ	5,600	2,037.00	11,407,200	
ＪＸ金属	281,700	764.50	215,359,650	貸付株式数　113,700株
富士石油	28,500	292.00	8,322,000	貸付株式数　11,100株
出光興産	469,100	862.20	404,458,020	
ENEOSホールディングス	1,642,200	688.60	1,130,818,920	
コスモエネルギーHLDGS	35,700	6,115.00	218,305,500	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	14,800	3,905.00	57,794,000	
テスホールディングス	25,700	350.00	8,995,000	貸付株式数　10,300株
インフロニアＨＤ	111,200	1,180.50	131,271,600	
横浜ゴム	54,900	3,490.00	191,601,000	
TOYO TIRE	62,300	3,000.00	186,900,000	
ブリヂストン	317,500	5,858.00	1,859,915,000	
住友ゴム	106,400	1,655.00	176,092,000	
藤倉コンポジット	10,400	1,436.00	14,934,400	貸付株式数　4,200株
オカモト	5,800	4,985.00	28,913,000	
アキレス	5,900	1,174.00	6,926,600	貸付株式数　2,300株
フ コ ク	6,400	1,624.00	10,393,600	貸付株式数　2,500株
ニッタ	10,700	3,785.00	40,499,500	
住友理工	21,000	1,698.00	35,658,000	
三ツ星ベルト	15,100	3,485.00	52,623,500	貸付株式数　6,100株
バンドー化学	16,100	1,657.00	26,677,700	貸付株式数　6,200株
ＡＧＣ	105,500	4,281.00	451,645,500	
日本板硝子	55,500	418.00	23,199,000	
有沢製作所	16,300	1,420.00	23,146,000	
日本電気硝子	36,200	3,432.00	124,238,400	
オハラ	5,100	1,060.00	5,406,000	貸付株式数　2,000株
住友大阪セメント	18,800	3,816.00	71,740,800	

太平洋セメント	66,900	3,664.00	245,121,600		
日本ヒユーム	9,500	2,024.00	19,228,000	貸付株式数	3,800株
日本コンクリート	21,100	300.00	6,330,000	貸付株式数	8,400株
三谷セキサン	3,800	7,430.00	28,234,000	貸付株式数	1,500株
アジアパイルＨＤ	15,400	949.00	14,614,600		
東海カーボン	100,100	1,018.50	101,951,850		
日本カーボン	6,200	4,240.00	26,288,000	貸付株式数	2,500株
東洋炭素	7,600	4,235.00	32,186,000	貸付株式数	2,100株
ノリタケ	11,700	3,620.00	42,354,000	貸付株式数	4,700株
ＴＯＴＯ	78,700	3,613.00	284,343,100		
日本碍子	120,500	1,758.50	211,899,250		
日本特殊陶業	88,700	4,471.00	396,577,700		
ＭＡＲＵＷＡ	4,500	34,790.00	156,555,000	貸付株式数	1,800株
品川リフラクトリーズ	13,300	1,665.00	22,144,500	貸付株式数	5,300株
黒崎播磨	7,400	2,940.00	21,756,000		
ヨータイ	5,500	1,749.00	9,619,500		
フジミインコーポレーテッド	29,200	1,847.00	53,932,400		
ニチアス	27,400	5,064.00	138,753,600		
日本製鉄	565,100	2,852.00	1,611,665,200		
神戸製鋼所	224,400	1,615.00	362,406,000		
中山製鋼所	23,000	640.00	14,720,000	貸付株式数	9,200株
合同製鐵	6,200	3,745.00	23,219,000	貸付株式数	2,300株
ＪＦＥホールディングス	336,200	1,680.00	564,816,000		
東京製鐵	31,200	1,488.00	46,425,600	貸付株式数	12,200株
共英製鋼	10,900	1,989.00	21,680,100		
大和工業	21,000	8,909.00	187,089,000	貸付株式数	6,300株
東京鐵鋼	4,900	5,430.00	26,607,000	貸付株式数	2,000株
大阪製鐵	5,100	2,605.00	13,285,500	貸付株式数	2,000株
淀川製鋼所	10,300	5,530.00	56,959,000		
中部鋼鈑	9,100	2,047.00	18,627,700		
丸一鋼管	34,000	3,522.00	119,748,000		
モリ工業	14,100	870.00	12,267,000		
大同特殊鋼	70,300	979.70	68,872,910		
日本冶金工	7,500	3,875.00	29,062,500		
愛知製鋼	6,200	7,790.00	48,298,000		
大平洋金属	10,300	1,791.00	18,447,300	貸付株式数	4,000株
新日本電工	66,600	254.00	16,916,400		
栗本鉄工所	5,200	5,570.00	28,964,000		
日本製鋼所	33,100	7,364.00	243,748,400		

三菱製鋼	8,300	1,496.00	12,416,800		
日本精線	8,900	1,079.00	9,603,100	貸付株式数	3,500株
エンビプロＨＤ	11,000	499.00	5,489,000	貸付株式数	4,400株
大紀アルミニウム	15,900	964.00	15,327,600		
日本軽金属ＨＤ	32,600	1,617.00	52,714,200		
三井金属	27,900	5,041.00	140,643,900		
東邦亜鉛	8,800	694.00	6,107,200	貸付株式数	3,100株
三菱マテリアル	79,800	2,235.00	178,353,000		
住友鉱山	141,200	3,357.00	474,008,400		
DOWAホールディングス	30,100	4,615.00	138,911,500		
古河機金	13,300	2,299.00	30,576,700	貸付株式数	5,300株
大阪チタニウム	19,400	1,410.00	27,354,000	貸付株式数	7,800株
東邦チタニウム	23,100	1,100.00	25,410,000	貸付株式数	9,300株
ＵＡＣＪ	15,000	4,920.00	73,800,000		
ＣＫサンエツ	2,700	3,570.00	9,639,000	貸付株式数	1,000株
古河電工	37,200	7,152.00	266,054,400		
住友電工	385,400	2,954.00	1,138,471,600		
フジクラ	119,700	6,871.00	822,458,700		
ＳＷＣＣ	15,000	6,780.00	101,700,000		
平河ヒューテック	7,500	1,540.00	11,550,000		
いよぎんホールディンク	139,400	1,537.50	214,327,500		
しずおかフィナンシャルク	234,700	1,684.00	395,234,800		
ちゅうぎんフィナンシャ	89,700	1,778.00	159,486,600		
楽天銀行	49,400	7,784.00	384,529,600	貸付株式数	19,300株
京都フィナンシャルＧ	134,100	2,422.00	324,790,200		
リョービ	11,900	2,150.00	25,585,000		
AREホールディングス	45,100	1,824.00	82,262,400		
東洋製罐グループHD	66,000	2,804.50	185,097,000		
ホッカンホールディングス	6,000	1,879.00	11,274,000	貸付株式数	600株
コロナ	6,200	890.00	5,518,000		
横河ブリッジHLDGS	19,200	2,563.00	49,209,600		
三和ホールディングス	110,200	5,034.00	554,746,800		
文化シヤッター	29,200	2,125.00	62,050,000		
三協立山	14,000	614.00	8,596,000		
アルインコ	8,500	1,007.00	8,559,500	貸付株式数	1,100株
ＬＩＸＩＬ	162,700	1,622.50	263,980,750		
ノーリツ	15,700	1,907.00	29,939,900		
長府製作所	12,500	1,830.00	22,875,000		
リンナイ	58,200	3,601.00	209,578,200		
ユニプレス	18,200	938.00	17,071,600		

日東精工	16,200	572.00	9,266,400		
岡 部	19,900	850.00	16,915,000	貸付株式数	8,000株
ジーテクト	12,400	1,725.00	21,390,000		
東 プ レ	19,700	1,758.00	34,632,600	貸付株式数	7,900株
高周波熱錬	15,300	1,097.00	16,784,100	貸付株式数	2,600株
東京製綱	6,600	1,238.00	8,170,800	貸付株式数	2,600株
サンコール	12,400	296.00	3,670,400		
パイオラックス	15,000	1,835.00	27,525,000	貸付株式数	5,700株
エイチワン	11,500	1,240.00	14,260,000	貸付株式数	4,600株
日本発条	93,500	1,594.50	149,085,750		
中央発條	7,200	1,650.00	11,880,000	貸付株式数	2,900株
三浦工業	50,700	2,861.00	145,052,700		
タ ク マ	35,800	1,990.00	71,242,000		
テクノプロ・ホールディング	67,600	3,965.00	268,034,000		
アイ・アールジャパンHD	5,800	627.00	3,636,600	貸付株式数	500株
ＫｅｅＰｅｒ技研	6,900	3,830.00	26,427,000	貸付株式数	2,700株
Ｇｕｎｏｓｙ	8,800	620.00	5,456,000		
イー・ガーディアン	3,400	1,994.00	6,779,600		
ジャパンマテリアル	34,000	1,438.00	48,892,000		
ベクトル	15,200	904.00	13,740,800		
チャームケアコーポレーション	9,300	1,241.00	11,541,300		
キャリアリンク	4,100	2,100.00	8,610,000	貸付株式数	1,500株
ＩＢＪ	8,500	820.00	6,970,000	貸付株式数	3,400株
アサンテ	5,500	1,618.00	8,899,000	貸付株式数	2,200株
バリューＨＲ	10,000	1,621.00	16,210,000	貸付株式数	4,000株 (700株)
M&Aキャピタルパートナー	9,000	2,784.00	25,056,000	貸付株式数	3,200株
ライドオンエクスプレスHD	4,400	1,001.00	4,404,400		
シグマクシス・ホールディンク	32,400	1,267.00	41,050,800		
ウィルグループ	9,400	913.00	8,582,200	貸付株式数	3,700株
メドピア	8,900	764.00	6,799,600	貸付株式数	1,200株
リクルートホールディングス	822,400	8,142.00	6,695,980,800	※	
エラン	14,700	827.00	12,156,900	貸付株式数	5,900株
ツ ガ ミ	23,300	1,882.00	43,850,600		
オークマ	19,100	3,750.00	71,625,000		
芝浦機械	14,100	3,185.00	44,908,500	貸付株式数	5,600株

アマダ	146,000	1,475.50	215,423,000		
アイダエンジニア	24,500	928.00	22,736,000		
ＦＵＪＩ	47,500	2,272.50	107,943,750		
牧野フライス	12,100	11,610.00	140,481,000		
オーエスジー	48,100	1,662.50	79,966,250	貸付株式数	19,400株
旭ダイヤモンド	27,300	712.00	19,437,600		
DMG森精機	68,900	3,057.00	210,627,300		
ソディツク	28,800	930.00	26,784,000		
ディスコ	52,600	32,160.00	1,691,616,000		
日東工器	3,900	1,795.00	7,000,500	貸付株式数	1,500株
日進工具	9,100	687.00	6,251,700		
冨士ダイス	8,100	699.00	5,661,900	貸付株式数	3,100株
日本郵政	1,103,800	1,340.50	1,479,643,900		
ベルシステム24HLDGS	12,100	1,245.00	15,064,500		
鎌倉新書	9,500	497.00	4,721,500	貸付株式数	3,800株
エアトリ	9,100	905.00	8,235,500	貸付株式数	3,500株
アトラエ	8,600	640.00	5,504,000		
ストライク	5,500	3,525.00	19,387,500	貸付株式数	2,200株
ソラスト	30,700	419.00	12,863,300		
セラク	3,400	1,601.00	5,443,400	貸付株式数	200株
インソース	24,100	1,000.00	24,100,000		
豊田自動織機	92,300	16,260.00	1,500,798,000		
リケンＮＰＲ	13,700	2,403.00	32,921,100		
島精機製作所	17,400	841.00	14,633,400	貸付株式数	7,000株
オプトラン	17,900	1,457.00	26,080,300	貸付株式数	3,700株
イワキポンプ	7,300	2,459.00	17,950,700	貸付株式数	2,900株
フリュー	10,300	973.00	10,021,900		
ヤマシンフィルタ	23,100	551.00	12,728,100	貸付株式数	9,300株
日阪製作所	11,600	1,396.00	16,193,600	貸付株式数	3,900株
やまびこ	17,800	2,097.00	37,326,600	貸付株式数	7,200株
野村マイクロ・サイエンス	18,100	2,253.00	40,779,300	貸付株式数	7,200株 (100株)
平田機工	15,700	1,863.00	29,249,100	貸付株式数	6,100株
ＰＥＧＡＳＵＳ	12,000	532.00	6,384,000		
マルマエ	4,200	1,338.00	5,619,600	貸付株式数	1,800株
タツモ	7,800	1,913.00	14,921,400	貸付株式数	3,000株
ナブテスコ	68,600	2,350.00	161,210,000		
三井海洋開発	13,800	5,300.00	73,140,000		
レオン自動機	11,500	1,196.00	13,754,000		

ＳＭＣ	32,700	53,800.00	1,759,260,000		
ホソカワミクロン	8,300	4,005.00	33,241,500		
ユニオンツール	4,800	4,640.00	22,272,000	貸付株式数	1,900株
瑞 光	9,300	962.00	8,946,600	貸付株式数	3,700株
オイレス工業	14,800	2,062.00	30,517,600		
日精エーエスビー	4,300	6,280.00	27,004,000		
サトー	13,600	2,036.00	27,689,600		
技研製作所	10,300	1,437.00	14,801,100	貸付株式数	4,100株
日本エアーテック	5,100	1,037.00	5,288,700	貸付株式数	1,800株
日精樹脂工業	7,200	838.00	6,033,600	貸付株式数	2,800株
ワイエイシイホールディングス	11,100	774.00	8,591,400	貸付株式数	4,400株
小松製作所	538,500	4,341.00	2,337,628,500		
住友重機械	64,600	2,985.50	192,863,300		
日立建機	43,500	4,406.00	191,661,000		
日 工	16,200	694.00	11,242,800		
巴工業	12,800	1,499.00	19,187,200	貸付株式数	5,100株
井関農機	10,200	1,363.00	13,902,600	貸付株式数	4,100株
ＴＯＷＡ	33,400	1,532.00	51,168,800	貸付株式数	13,500株
北川鉄工所	4,300	1,420.00	6,106,000		
ローツェ	57,100	1,656.00	94,557,600	貸付株式数	18,200株
クボタ	558,600	1,610.00	899,346,000		
荏原実業	5,200	3,600.00	18,720,000		
東洋エンジニア	15,600	687.00	10,717,200		
三菱化工機	11,500	1,981.00	22,781,500		
月島ホールディングス	14,300	1,993.00	28,499,900		
帝国電機製作所	6,800	3,220.00	21,896,000	貸付株式数	2,700株
新東工業	24,300	840.00	20,412,000		
渋谷工業	10,200	3,290.00	33,558,000		
アイチ コーポレーション	18,100	1,382.00	25,014,200		
小森コーポレーション	26,000	1,444.00	37,544,000		
鶴見製作所	8,300	3,495.00	29,008,500	貸付株式数	3,300株
酒井重工業	4,300	1,954.00	8,402,200		
荏原製作所	224,300	2,234.00	501,086,200		
酉島製作所	9,400	1,926.00	18,104,400	貸付株式数	3,800株
ＡＩＲＭＡＮ	11,000	1,864.00	20,504,000	貸付株式数	4,400株
ダイキン工業	142,300	16,375.00	2,330,162,500		
オルガノ	16,900	7,580.00	128,102,000	貸付株式数	600株
トーヨーカネツ	3,900	3,865.00	15,073,500		
栗田工業	61,100	5,317.00	324,868,700		

椿本チエイン	47,300	1,807.00	85,471,100	
日 機 装	28,000	1,171.00	32,788,000	
木村化工機	8,300	858.00	7,121,400	
レイズネクスト	15,300	1,722.00	26,346,600	
アネスト岩田	18,600	1,404.00	26,114,400	
ダイフク	184,400	3,770.00	695,188,000	貸付株式数 62,000株
サムコ	2,900	2,670.00	7,743,000	貸付株式数 1,200株
タダノ	62,900	970.90	61,069,610	
フジテック	35,100	5,649.00	198,279,900	
ＣＫＤ	30,200	2,307.00	69,671,400	
平和	36,300	2,070.00	75,141,000	
理想科学工業	17,500	1,081.00	18,917,500	貸付株式数 7,000株
ＳＡＮＫＹＯ	126,200	2,426.00	306,161,200	
日本金銭機械	13,200	980.00	12,936,000	貸付株式数 5,000株
マースグループHLDGS	7,400	2,936.00	21,726,400	貸付株式数 2,800株
ガリレイ	16,100	3,030.00	48,783,000	
ダイコク電機	4,800	2,167.00	10,401,600	貸付株式数 1,800株
竹内製作所	19,800	4,550.00	90,090,000	貸付株式数 8,000株
ア マ ノ	31,000	4,310.00	133,610,000	
ＪＵＫＩ	17,000	354.00	6,018,000	
ジャノメ	8,800	1,160.00	10,208,000	
ブラザー工業	146,000	2,385.00	348,210,000	
マックス	13,200	4,545.00	59,994,000	貸付株式数 5,300株
モリタホールディングス	17,100	2,097.00	35,858,700	
グローリー	28,600	3,139.00	89,775,400	
新晃工業	31,300	1,226.00	38,373,800	貸付株式数 12,600株
大和冷機工業	16,700	1,581.00	26,402,700	貸付株式数 6,200株
セガサミーホールディングス	97,600	2,854.50	278,599,200	
ＴＰＲ	13,900	1,902.00	26,437,800	貸付株式数 1,000株
ツバキ・ナカシマ	26,900	357.00	9,603,300	貸付株式数 10,800株
ホシザキ	70,300	5,240.00	368,372,000	
大豊工業	9,400	644.00	6,053,600	貸付株式数 3,600株
日本精工	202,200	636.40	128,680,080	
Ｎ Ｔ Ｎ	258,400	211.30	54,599,920	貸付株式数 35,800株
ジェイテクト	90,200	1,102.50	99,445,500	
不 二 越	8,100	3,040.00	24,624,000	貸付株式数 3,100株
ミネベアミツミ	190,000	1,942.50	369,075,000	
日本トムソン	29,700	531.00	15,770,700	

ＴＨＫ	63,000	4,021.00	253,323,000		
ＹＵＳＨＩＮ	10,100	601.00	6,070,100		
前澤給装工業	7,800	1,294.00	10,093,200		
イーグル工業	12,100	1,888.00	22,844,800		
ＰＩＬＬＡＲ	10,100	3,700.00	37,370,000		
キッツ	35,400	1,166.00	41,276,400		
日 立	2,779,000	4,015.00	11,157,685,000	※	
三菱電機	1,111,200	2,913.00	3,236,925,600		
富士電機	66,400	6,596.00	437,974,400		
安川電機	118,700	3,242.00	384,825,400		
シンフォニア テクノロジー	10,800	8,190.00	88,452,000	貸付株式数	4,300株
明 電 舎	18,400	4,675.00	86,020,000		
山洋電気	4,700	10,150.00	47,705,000		
デンヨー	8,300	2,754.00	22,858,200	貸付株式数	3,300株
PHCホールディングス	20,500	934.00	19,147,000	貸付株式数	8,200株
KOKUSAI ELECTRIC	77,100	2,994.00	230,837,400	貸付株式数	31,100株
ソシオネクスト	109,100	2,234.00	243,729,400		
ベイカレント	81,700	7,273.00	594,204,100		
ORCHESTRA HLDGS	2,400	786.00	1,886,400		
アイモバイル	16,500	570.00	9,405,000		
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,100	916.00	5,587,600		
ジャパンエレベーターSHD	43,200	3,875.00	167,400,000		
エル・ティー・エス	1,500	2,032.00	3,048,000	貸付株式数	600株
ミダックホールディングス	6,700	2,100.00	14,070,000	貸付株式数	2,700株
キュービーネットHLDGS	6,400	1,188.00	7,603,200	貸付株式数	2,500株
オープングループ	17,700	301.00	5,327,700	貸付株式数	4,900株
三桜工業	15,000	599.00	8,985,000	貸付株式数	5,800株
マキタ	135,900	4,290.00	583,011,000		
東芝テック	16,300	2,886.00	47,041,800		
芝浦メカトロニクス	7,900	8,030.00	63,437,000	貸付株式数	3,200株
マブチモーター	47,400	2,145.00	101,673,000		
ニデック	482,400	2,712.00	1,308,268,800		
ユーエムシーエレクトロニクス	6,900	319.00	2,201,100	貸付株式数	2,200株
トレックス・セミコンダクター	5,100	1,149.00	5,859,900		
東光高岳	5,900	2,199.00	12,974,100		
ダブル・スコープ	33,500	290.00	9,715,000	貸付株式数	13,400株
宮越ホールディングス	4,900	1,121.00	5,492,900	貸付株式数	1,900株
ダイヘン	10,200	6,070.00	61,914,000		

ヤーマン	21,200	850.00	18,020,000	貸付株式数	8,500株 (200株)
ＪＶＣケンウッド	86,200	1,148.50	99,000,700		
ミマキエンジニアリング	9,100	1,864.00	16,962,400	貸付株式数	3,600株
大崎電気	23,400	917.00	21,457,800		
オムロン	100,100	3,639.00	364,263,900		
日東工業	14,700	3,070.00	45,129,000	貸付株式数	3,000株
ＩＤＥＣ	16,100	2,289.00	36,852,900		
ジーエス・ユアサ コーポ	48,800	2,530.00	123,464,000		
ＢＵＦＦＡＬＯ	2,500	2,279.00	5,697,500		
テクノメディカ	2,100	1,812.00	3,805,200	貸付株式数	800株
ダイヤモンドエレクトリクHD	4,500	577.00	2,596,500	貸付株式数	1,100株
日本電気	772,500	3,782.00	2,921,595,000		
富 士 通	1,005,300	3,353.00	3,370,770,900		
沖 電 気	52,900	1,476.00	78,080,400		
電気興業	4,400	2,037.00	8,962,800		
サンケン電気	11,200	8,010.00	89,712,000	貸付株式数	4,500株
アイホン	6,600	2,618.00	17,278,800		
ルネサスエレクトロニクス	832,300	1,866.50	1,553,487,950		
セイコーエプソン	136,000	1,835.00	249,560,000		
ワコム	76,800	614.00	47,155,200		
アルバック	24,000	4,984.00	119,616,000		
アクセル	5,400	922.00	4,978,800		
ＥＩＺＯ	14,200	2,075.00	29,465,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	17.00	1,048,900		
日本信号	24,900	1,074.00	26,742,600		
京三製作所	25,400	496.00	12,598,400	貸付株式数	10,200株
能美防災	14,800	3,790.00	56,092,000		
ホーチキ	6,400	2,944.00	18,841,600		
エレコム	26,100	1,814.00	47,345,400		
パナソニック ホールディンク	1,290,600	1,605.50	2,072,058,300		
シャープ	157,800	694.20	109,544,760	貸付株式数	63,700株
アンリツ	76,900	1,642.50	126,308,250	貸付株式数	3,000株
富士通ゼネラル	30,700	2,795.00	85,806,500		
ソニーグループ	3,731,200	3,790.00	14,141,248,000		
Ｔ Ｄ Ｋ	943,500	1,507.00	1,421,854,500		
帝国通信工業	4,800	2,225.00	10,680,000	貸付株式数	1,900株
タムラ製作所	43,500	445.00	19,357,500	貸付株式数	17,500株

アルプスアルパイン	88,700	1,431.50	126,974,050	
日本電波工業	10,300	712.00	7,333,600	貸付株式数 4,000株
鈴木	5,800	1,729.00	10,028,200	貸付株式数 2,200株
メイコー	10,800	5,830.00	62,964,000	
日本トリム	2,500	4,040.00	10,100,000	
フオスター電機	11,100	1,437.00	15,950,700	
ＳＭＫ	2,600	2,180.00	5,668,000	貸付株式数 1,000株
ヨコオ	9,600	1,228.00	11,788,800	
ホシデン	26,800	2,174.00	58,263,200	
ヒロセ電機	15,900	16,675.00	265,132,500	
日本航空電子	28,400	2,475.00	70,290,000	
ＴＯＡ	11,000	1,004.00	11,044,000	
マクセル	20,900	1,805.00	37,724,500	
古野電気	12,900	3,075.00	39,667,500	貸付株式数 5,200株
スミダコーポレーション	14,700	991.00	14,567,700	
アイコム	4,200	2,994.00	12,574,800	
リオン	4,500	2,328.00	10,476,000	
横河電機	119,500	3,513.00	419,803,500	
新電元工業	4,200	2,060.00	8,652,000	貸付株式数 1,600株
アズビル	294,800	1,266.00	373,216,800	
日本光電工業	96,800	1,722.00	166,689,600	
チノー	4,500	2,293.00	10,318,500	貸付株式数 1,800株
日本電子材料	6,700	2,089.00	13,996,300	
堀場製作所	20,500	10,840.00	222,220,000	
アドバンテスト	340,900	7,756.00	2,644,020,400	
エスペック	9,600	2,900.00	27,840,000	
キーエンス	108,200	58,250.00	6,302,650,000	
日置電機	5,700	5,640.00	32,148,000	貸付株式数 1,300株
シスメックス	280,100	2,346.50	657,254,650	
日本マイクロニクス	17,800	3,815.00	67,907,000	貸付株式数 3,600株
メガチップス	8,400	4,860.00	40,824,000	
OBARA GROUP	5,900	3,460.00	20,414,000	貸付株式数 1,800株
IMAGICA GROUP	10,900	792.00	8,632,800	
デンソー	1,059,700	1,901.50	2,015,019,550	
コーセル	13,300	1,087.00	14,457,100	
イリソ電子工業	10,900	2,616.00	28,514,400	
オプテックスグループ	19,800	1,542.00	30,531,600	
千代田インテグレ	3,800	2,781.00	10,567,800	貸付株式数 1,500株
レーザーテック	42,000	14,730.00	618,660,000	
スタンレー電気	61,500	2,801.50	172,292,250	

ウシオ電機	41,200	1,747.50	71,997,000		
日本セラミック	9,900	2,919.00	28,898,100		
古河電池	8,000	1,382.00	11,056,000	貸付株式数	2,400株
山一電機	8,800	2,508.00	22,070,400	貸付株式数	3,400株
図 研	9,900	5,320.00	52,668,000		
日本電子	25,000	4,185.00	104,625,000		
カ シ オ	86,500	1,039.00	89,873,500		
ファナック	523,400	3,728.00	1,951,235,200		
日本シイエムケイ	31,600	330.00	10,428,000	貸付株式数	12,700株
エンプラス	3,100	3,690.00	11,439,000	貸付株式数	1,200株
大真空	11,700	518.00	6,060,600	貸付株式数	5,100株
ロ ー ム	196,000	1,637.50	320,950,000		
浜松ホトニクス	180,700	1,552.50	280,536,750		
三井ハイテック	47,900	733.00	35,110,700	貸付株式数	19,300株
京 セ ラ	672,000	1,712.50	1,150,800,000		
太陽誘電	47,400	2,422.00	114,802,800	貸付株式数	2,800株
村田製作所	952,800	2,055.50	1,958,480,400		
双葉電子工業	20,600	720.00	14,832,000	貸付株式数	8,000株
日東電工	343,000	2,611.00	895,573,000		
東海理化電機	30,500	2,130.00	64,965,000		
ニチコン	25,500	1,180.00	30,090,000	貸付株式数	10,200株
日本ケミコン	13,300	1,107.00	14,723,100	貸付株式数	500株
ＫＯＡ	16,700	817.00	13,643,900	貸付株式数	6,700株
三井Ｅ＆Ｓ	58,400	2,350.00	137,240,000		
カナデビア	89,500	945.00	84,577,500		
三菱重工業	1,910,400	3,335.00	6,371,184,000		
川崎重工業	81,500	10,405.00	848,007,500		
ＩＨＩ	87,600	15,195.00	1,331,082,000		
名村造船所	30,900	2,355.00	72,769,500	貸付株式数	12,400株
マネジメントソリューションズ	5,400	2,029.00	10,956,600	貸付株式数	2,200株
プロレド・パートナーズ	2,700	460.00	1,242,000	貸付株式数	1,000株
フロンティア・マネジメント	3,300	704.00	2,323,200	貸付株式数	1,300株
アンビスホールディングス	23,800	458.00	10,900,400	貸付株式数	9,300株
カーブスホールディングス	30,400	687.00	20,884,800	貸付株式数	12,200株
フォーラムエンジニアリング	13,000	1,112.00	14,456,000		
FAST FITNESS JAP	3,800	1,500.00	5,700,000		
MACBEE PLANET	4,100	3,370.00	13,817,000	貸付株式数	1,600株

日本車輌	4,200	2,095.00	8,799,000	
三菱ロジスネクスト	17,300	2,104.00	36,399,200	貸付株式数　6,900株
フルサト・マルカHD	9,200	2,229.00	20,506,800	
ヤマエグループHD	12,300	2,319.00	28,523,700	貸付株式数　5,000株
ＦＰＧ	34,200	2,353.00	80,472,600	
全国保証	55,700	3,197.00	178,072,900	
めぶきフィナンシャルG	519,000	721.50	374,458,500	
ジャパンインベストメントA	17,300	1,746.00	30,205,800	貸付株式数　6,900株
東京きらぼしFG	13,600	5,730.00	77,928,000	
九州フィナンシャルG	187,400	729.50	136,708,300	
かんぽ生命保険	124,000	3,288.00	407,712,000	
ゆうちょ銀行	874,700	1,508.00	1,319,047,600	
富山第一銀行	33,800	995.00	33,631,000	貸付株式数　13,600株
コンコルディア・フィナンシャル	555,600	923.30	512,985,480	
ジェイリース	8,000	1,300.00	10,400,000	
西日本フィナンシャルHD	65,100	2,172.00	141,397,200	
ＳＢＩアルヒ	10,900	819.00	8,927,100	貸付株式数　4,300株
プレミアグループ	18,000	2,066.00	37,188,000	
日産自動車	1,352,000	355.00	479,960,000	貸付株式数　546,000株
いすゞ自動車	317,500	1,837.00	583,247,500	
トヨタ自動車	5,749,900	2,650.50	15,240,109,950	※
日野自動車	162,700	460.40	74,907,080	
三菱自動車工業	413,500	412.40	170,527,400	貸付株式数　167,000株
武蔵精密工業	26,500	2,785.00	73,802,500	
日産車体	16,400	1,105.00	18,122,000	
新明和工業	31,100	1,483.00	46,121,300	
極東開発工業	14,600	2,619.00	38,237,400	
トピー工業	8,800	2,276.00	20,028,800	
ティラド	2,400	4,590.00	11,016,000	
タチエス	20,000	1,699.00	33,980,000	貸付株式数　7,600株
ＮＯＫ	42,000	2,074.00	87,108,000	
フタバ産業	32,600	724.00	23,602,400	
カヤバ	18,400	3,090.00	56,856,000	
市光工業	19,500	360.00	7,020,000	
大同メタル工業	21,100	598.00	12,617,800	貸付株式数　8,400株
プレス工業	40,500	538.00	21,789,000	
太平洋工業	24,800	1,308.00	32,438,400	
アイシン	229,100	1,724.00	394,968,400	
マ ツ ダ	332,200	828.20	275,128,040	

本田技研	2,562,800	1,384.00	3,546,915,200		
スズキ	874,100	1,663.00	1,453,628,300		
SUBARU	326,200	2,486.50	811,096,300		
ヤマハ発動機	456,700	1,067.00	487,298,900		
小糸製作所	112,100	1,756.50	196,903,650		
エクセディ	17,700	4,100.00	72,570,000	貸付株式数	200株
ミツバ	20,300	818.00	16,605,400		
豊田合成	31,000	2,616.50	81,111,500		
愛三工業	20,500	1,737.00	35,608,500		
ヨ ロ ズ	11,100	905.00	10,045,500	貸付株式数	4,400株
エフ・シー・シー	19,000	2,771.00	52,649,000		
シマノ	46,900	21,355.00	1,001,549,500		
テイ・エス テック	44,000	1,624.50	71,478,000		
３３ＦＧ	9,500	2,742.00	26,049,000		
第四北越フィナンシャルG	33,400	3,335.00	111,389,000	貸付株式数	2,300株
ひろぎんHLDGS	149,900	1,248.50	187,150,150		
おきなわＦＧ	8,400	2,834.00	23,805,600		
ダイレクトマケティングミクス	13,500	243.00	3,280,500		
ポピンズ	2,100	1,300.00	2,730,000		
LITALICO	10,100	1,330.00	13,433,000	貸付株式数	500株
十六ＦＧ	15,000	4,870.00	73,050,000		
北國ＦＨＤ	10,400	4,880.00	50,752,000	貸付株式数	4,000株
ネットプロＨＤ	36,200	569.00	20,597,800	貸付株式数	14,600株
プロクレアホールディングス	12,200	1,484.00	18,104,800	貸付株式数	4,900株
ＦＰパートナー	4,700	2,260.00	10,622,000	貸付株式数	1,800株
あいちフィナンシャルグル	19,900	2,548.00	50,705,200	貸付株式数	8,000株
ジャムコ	6,200	1,792.00	11,110,400		
小 野 建	12,200	1,421.00	17,336,200	貸付株式数	2,700株
ノ ジ マ	37,300	2,853.00	106,416,900		
佐鳥電機	7,300	1,589.00	11,599,700	貸付株式数	2,900株
カッパ・クリエイト	18,000	1,455.00	26,190,000	貸付株式数	7,200株
伯東	6,000	3,765.00	22,590,000	貸付株式数	2,400株
コンドーテック	8,800	1,444.00	12,707,200	貸付株式数	3,500株
ナガイレーベン	14,500	1,933.00	28,028,500	貸付株式数	5,800株
三菱食品	10,600	6,320.00	66,992,000		
良品計画	124,900	6,034.00	753,646,600		
松田産業	8,700	3,485.00	30,319,500		
第一興商	44,300	1,557.00	68,975,100	貸付株式数	5,000株

メディパルHD	124,100	2,309.00	286,546,900		
アドヴァングループ	9,200	819.00	7,534,800	貸付株式数	3,600株
ＳＰＫ	4,700	2,169.00	10,194,300		
萩原電気HLDGS	4,900	3,330.00	16,317,000		
アルビス	3,700	3,020.00	11,174,000		
アズワン	35,500	2,385.00	84,667,500	貸付株式数	13,800株
スズデン	6,500	1,726.00	11,219,000	貸付株式数	2,600株
シモジマ	7,700	1,207.00	9,293,900		
ドウシシャ	10,600	2,406.00	25,503,600		
高速	6,800	2,686.00	18,264,800	貸付株式数	2,700株
G-7ホールディングス	12,500	1,367.00	17,087,500		
たけびし	4,900	1,818.00	8,908,200		
イオン北海道	28,200	886.00	24,985,200	貸付株式数	1,100株
コ ジ マ	18,900	1,049.00	19,826,100	貸付株式数	7,600株
コーナン商事	12,600	3,670.00	46,242,000	貸付株式数	4,900株
エコス	4,200	2,364.00	9,928,800	貸付株式数	1,400株
ワタミ	13,800	1,015.00	14,007,000	貸付株式数	5,400株
リックス	2,600	3,000.00	7,800,000		
システムソフト	37,700	69.00	2,601,300	貸付株式数	14,700株
パンパシフィックHD	231,200	4,670.00	1,079,704,000		
丸文	10,200	1,022.00	10,424,400		
西松屋チェーン	25,300	2,095.00	53,003,500	貸付株式数	10,200株
ゼンショーホールディングス	65,000	7,746.00	503,490,000		
ハピネット	8,800	5,220.00	45,936,000	貸付株式数	100株
幸楽苑	9,900	1,020.00	10,098,000	貸付株式数	3,500株
橋本総業HLDGS	4,500	1,252.00	5,634,000	貸付株式数	100株
日本ライフライン	30,600	1,464.00	44,798,400		
サイゼリヤ	14,800	4,895.00	72,446,000	貸付株式数	4,300株
タカショー	9,300	410.00	3,813,000	貸付株式数	3,700株
ＶＴホールディングス	44,600	480.00	21,408,000		
アルゴグラフィックス	9,900	5,040.00	49,896,000		
魚力	4,000	2,400.00	9,600,000	貸付株式数	1,300株
ＩＤＯＭ	38,900	1,028.00	39,989,200	貸付株式数	15,700株
日本エム・ディ・エム	8,600	557.00	4,790,200		
フジ・コーポレーション	5,200	2,213.00	11,507,600	貸付株式数	2,000株
ユナイテッドアローズ	12,200	2,122.00	25,888,400		
進和	7,000	3,015.00	21,105,000	貸付株式数	2,300株
ダイトロン	4,700	3,710.00	17,437,000		

ハイデイ日高	18,500	3,140.00	58,090,000	貸付株式数	7,400株
シークス	16,300	1,153.00	18,793,900		
コロワイド	64,600	1,811.00	116,990,600	貸付株式数	26,000株
オーハシテクニカ	5,300	1,965.00	10,414,500		
壱番屋	45,200	903.00	40,815,600	貸付株式数	18,200株
白銅	3,200	2,262.00	7,238,400	貸付株式数	1,000株
スギホールディングス	61,500	3,153.00	193,909,500		
薬王堂ホールディングス	5,600	2,182.00	12,219,200		
ダブルエー	3,100	1,368.00	4,240,800	貸付株式数	1,200株
島津製作所	155,700	3,425.00	533,272,500		
ＪＭＳ	10,100	424.00	4,282,400		
長野計器	7,100	1,937.00	13,752,700	貸付株式数	2,800株
ブイ・テクノロジー	5,300	3,215.00	17,039,500		
スター精密	18,400	1,693.00	31,151,200		
東京計器	7,600	4,115.00	31,274,000	貸付株式数	3,000株
愛知時計	5,100	2,221.00	11,327,100		
インターアクション	6,500	1,191.00	7,741,500	貸付株式数	2,600株
東京精密	22,200	8,060.00	178,932,000		
マニー	43,300	1,190.00	51,527,000	貸付株式数	17,400株
ニコン	161,900	1,443.50	233,702,650		
トプコン	61,400	3,253.00	199,734,200		
オリンパス	599,000	1,920.00	1,150,080,000		
理研計器	15,300	2,936.00	44,920,800	貸付株式数	6,100株
SCREENホールディングス	45,200	10,500.00	474,600,000		
キヤノン電子	10,200	2,633.00	26,856,600	貸付株式数	2,100株
タムロン	14,900	3,385.00	50,436,500		
ＨＯＹＡ	209,800	16,455.00	3,452,259,000		
ノーリツ鋼機	10,200	4,480.00	45,696,000		
A&Dホロンホールディングス	13,500	1,942.00	26,217,000		
朝日インテック	131,800	2,307.50	304,128,500		
キヤノン	539,500	4,282.00	2,310,139,000		
リ コ ー	276,500	1,289.50	356,546,750		
シチズン時計	99,500	842.00	83,779,000		
メニコン	40,400	1,027.00	41,490,800	貸付株式数	16,200株
パラマウントベッドHD	23,300	2,588.00	60,300,400		
トランザクション	5,900	2,435.00	14,366,500	貸付株式数	2,700株
ニホンフラッシュ	9,100	835.00	7,598,500	貸付株式数	1,400株
前田工繊	22,000	2,004.00	44,088,000		
アートネイチャー	11,100	729.00	8,091,900	貸付株式数	4,400株
フルヤ金属	9,200	2,625.00	24,150,000	貸付株式数	500株

バンダイナムコHLDGS	289,200	4,555.00	1,317,306,000	
ＳＨＯＥＩ	28,200	1,604.00	45,232,800	
フランスベッドHLDGS	14,100	1,270.00	17,907,000	貸付株式数　5,600株
マーベラス	20,100	519.00	10,431,900	貸付株式数　4,900株
パイロットコーポレーション	16,500	4,011.00	66,181,500	
萩原工業	7,200	1,471.00	10,591,200	貸付株式数　2,900株
エイベックス	20,400	1,259.00	25,683,600	
フジシールインターナショナル	24,300	2,504.00	60,847,200	
タカラトミー	45,400	3,015.00	136,881,000	
広済堂ホールディングス	40,900	450.00	18,405,000	貸付株式数　16,500株
レック	13,900	1,230.00	17,097,000	貸付株式数　5,600株
三光合成	13,700	608.00	8,329,600	
プロネクサス	11,200	1,087.00	12,174,400	貸付株式数　4,200株
TOPPANホールディングス	141,800	3,623.00	513,741,400	
大日本印刷	212,100	2,131.00	451,985,100	
共同印刷	12,200	1,310.00	15,982,000	
ＮＩＳＳＨＡ	18,500	1,255.00	23,217,500	
ＺＡＣＲＯＳ	8,600	3,680.00	31,648,000	貸付株式数　2,800株
TAKARA & COMPANY	5,900	3,185.00	18,791,500	貸付株式数　2,000株
前澤化成工業	7,600	1,868.00	14,196,800	貸付株式数　3,000株
未来工業	5,200	3,430.00	17,836,000	貸付株式数　2,000株
アシックス	386,200	3,476.00	1,342,431,200	
ツ ツ ミ	2,500	2,234.00	5,585,000	
ジェイ エス ピー	8,900	1,808.00	16,091,200	貸付株式数　3,500株
ニ チ ハ	13,600	3,020.00	41,072,000	貸付株式数　5,300株
ローランド	7,500	3,340.00	25,050,000	
エフピコ	23,900	2,825.00	67,517,500	
小松ウオール工業	7,200	2,212.00	15,926,400	
ヤマハ	183,100	1,013.50	185,571,850	
河合楽器	3,300	2,660.00	8,778,000	貸付株式数　1,300株
クリナップ	10,600	668.00	7,080,800	貸付株式数　4,200株
ピジョン	68,900	1,812.50	124,881,250	
天馬	2,700	3,565.00	9,625,500	
キングジム	9,500	864.00	8,208,000	貸付株式数　3,800株 (200株)
象印マホービン	32,300	1,334.00	43,088,200	貸付株式数　13,000株
リンテック	20,500	2,820.00	57,810,000	
信越ポリマー	23,400	1,630.00	38,142,000	

イトーキ	21,600	2,076.00	44,841,600	
任 天 堂	682,900	11,850.00	8,092,365,000	
三菱鉛筆	14,800	2,062.00	30,517,600	貸付株式数　6,000株
松 風	10,900	2,028.00	22,105,200	
タカラスタンダード	24,500	2,304.00	56,448,000	
コ ク ヨ	51,500	3,229.00	166,293,500	
ナカバヤシ	11,600	508.00	5,892,800	
ニ フ コ	40,600	3,342.00	135,685,200	
立川ブラインド	5,000	1,578.00	7,890,000	貸付株式数　1,800株
グローブライド	10,700	2,029.00	21,710,300	貸付株式数　4,300株
オカムラ	32,600	2,229.00	72,665,400	
バルカー	8,300	3,040.00	25,232,000	貸付株式数　3,300株
伊 藤 忠	769,300	7,485.00	5,758,210,500	
丸 紅	940,400	2,836.50	2,667,444,600	
スクロール	16,700	1,062.00	17,735,400	
ヨンドシーホールディングス	10,800	1,761.00	19,018,800	貸付株式数　4,400株
三陽商会	5,600	2,896.00	16,217,600	
長瀬産業	51,100	2,716.00	138,787,600	
蝶 理	6,100	3,985.00	24,308,500	貸付株式数　2,400株
豊田通商	343,700	3,021.00	1,038,317,700	
オンワードホールディングス	70,300	573.00	40,281,900	
三共生興	14,900	639.00	9,521,100	
兼 松	47,800	2,673.50	127,793,300	
美 津 濃	32,300	2,674.00	86,370,200	
ルックホールディングス	3,500	2,293.00	8,025,500	貸付株式数　1,400株
三井物産	1,645,200	2,945.00	4,845,114,000	
日本紙パルプ	54,700	601.00	32,874,700	
東京エレクトロン	228,900	23,350.00	5,344,815,000	
カメイ	10,700	2,288.00	24,481,600	
スターゼン	23,700	1,100.00	26,070,000	
セイコーグループ	16,700	3,910.00	65,297,000	
山 善	38,500	1,321.00	50,858,500	貸付株式数　13,800株
椿本興業	6,300	2,264.00	14,263,200	貸付株式数　1,300株
住友商事	685,800	3,611.00	2,476,423,800	
ＢＩＰＲＯＧＹ	36,600	5,838.00	213,670,800	
内田洋行	4,200	9,720.00	40,824,000	
三菱商事	2,115,100	2,861.00	6,051,301,100	※
第一実業	10,600	2,313.00	24,517,800	

キヤノンマーケティングJPN	22,500	5,191.00	116,797,500	
西華産業	5,500	4,610.00	25,355,000	
佐藤商事	7,900	1,508.00	11,913,200	
東京産業	11,600	769.00	8,920,400	貸付株式数 4,500株
ユアサ商事	9,800	4,475.00	43,855,000	
神鋼商事	7,500	1,981.00	14,857,500	
阪和興業	18,800	5,290.00	99,452,000	
正栄食品	7,600	3,985.00	30,286,000	貸付株式数 3,000株 (1,100株)
カナデン	8,200	1,835.00	15,047,000	
ＲＹＯＤＥＮ	8,700	2,736.00	23,803,200	貸付株式数 3,400株
ニプロ	90,200	1,274.00	114,914,800	
岩谷産業	113,700	1,460.00	166,002,000	
極東貿易	6,600	1,495.00	9,867,000	貸付株式数 2,600株
アステナホールディングス	21,600	471.00	10,173,600	貸付株式数 8,600株
三愛オブリ	26,700	1,743.00	46,538,100	
稲畑産業	31,000	3,150.00	97,650,000	
ＧＳＩクレオス	6,100	2,061.00	12,572,100	
明和産業	16,300	680.00	11,084,000	
ゴールドウイン	19,200	8,335.00	160,032,000	
ユニ・チャーム	678,000	1,144.00	775,632,000	
ワ キ タ	16,800	1,673.00	28,106,400	貸付株式数 6,800株
東邦ホールディングス	29,500	4,635.00	136,732,500	貸付株式数 11,900株
サンゲツ	28,700	2,872.00	82,426,400	
ミツウロコグループ	13,800	1,895.00	26,151,000	貸付株式数 5,700株
シナネンホールディングス	2,900	5,960.00	17,284,000	貸付株式数 1,100株
伊藤忠エネクス	28,400	1,683.00	47,797,200	
サンリオ	93,000	6,601.00	613,893,000	貸付株式数 37,500株
サンワ テクノス	5,200	2,285.00	11,882,000	
新光商事	15,400	955.00	14,707,000	貸付株式数 4,900株
トーホー	4,900	3,315.00	16,243,500	
三信電気	4,600	2,265.00	10,419,000	
東陽テクニカ	10,600	1,482.00	15,709,200	
モスフード サービス	16,800	3,645.00	61,236,000	貸付株式数 6,800株
加賀電子	23,200	2,657.00	61,642,400	
都築電気	6,100	2,842.00	17,336,200	貸付株式数 2,400株
ソーダニツカ	11,100	1,063.00	11,799,300	
立花エレテック	6,800	2,601.00	17,686,800	
木曽路	17,300	2,333.00	40,360,900	貸付株式数 6,700株
SRSホールディングス	18,900	1,191.00	22,509,900	貸付株式数 7,600株

千 趣 会	23,200	264.00	6,124,800	貸付株式数	9,300株 (400株)
リテールパートナーズ	17,000	1,342.00	22,814,000	貸付株式数	800株
上新電機	11,300	2,313.00	26,136,900		
日本瓦斯	54,800	2,600.00	142,480,000	貸付株式数	1,800株
ロイヤルホールディングス	20,200	2,528.00	51,065,600	貸付株式数	8,100株
チヨダ	10,100	1,212.00	12,241,200	貸付株式数	4,000株
ライフコーポレーション	24,000	2,095.00	50,280,000		
リンガーハット	14,800	2,210.00	32,708,000	貸付株式数	5,900株
ＭｒＭａｘＨＤ	14,400	666.00	9,590,400		
AOKIホールディングス	24,500	1,547.00	37,901,500		
オークワ	17,000	896.00	15,232,000	貸付株式数	6,700株
コメリ	15,400	2,870.00	44,198,000		
青山商事	24,500	2,185.00	53,532,500		
しまむら	26,900	10,030.00	269,807,000	貸付株式数	10,500株
高 島 屋	153,200	1,103.00	168,979,600	貸付株式数	61,800株
松 屋	19,400	1,062.00	20,602,800		
エイチ・ツー・オーリテイリング	55,700	1,899.50	105,802,150		
近鉄百貨店	6,500	1,791.00	11,641,500	貸付株式数	2,600株
丸井グループ	76,000	3,028.00	230,128,000		
クレディセゾン	67,500	4,136.00	279,180,000		
アクシアル リテイリング	31,200	1,110.00	34,632,000		
イオン	423,200	4,335.00	1,834,572,000		
イ ズ ミ	17,400	3,271.00	56,915,400	貸付株式数	6,800株
フオーバル	4,500	1,272.00	5,724,000	貸付株式数	1,000株
平 和 堂	18,800	2,734.00	51,399,200	貸付株式数	7,500株
フ ジ	21,100	2,013.00	42,474,300	貸付株式数	8,400株
ヤオコー	13,600	9,178.00	124,820,800	貸付株式数	3,800株
ゼビオホールディングス	15,500	1,128.00	17,484,000		
ケーズホールディングス	70,800	1,425.00	100,890,000		
ＰＡＬＴＡＣ	17,800	4,105.00	73,069,000		
三谷産業	20,000	337.00	6,740,000		
あおぞら銀行	73,500	2,157.00	158,539,500	貸付株式数	28,000株
三菱UFJフィナンシャルG	6,833,600	1,953.00	13,346,020,800		
りそなホールディングス	1,306,500	1,272.00	1,661,868,000		
三井住友トラストグルー	375,100	3,838.00	1,439,633,800		
三井住友フィナンシャルG	2,199,600	3,596.00	7,909,761,600		
千葉銀行	325,800	1,296.50	422,399,700		
群馬銀行	180,600	1,198.50	216,449,100		

武蔵野銀行	16,200	3,265.00	52,893,000		
千葉興業銀行	25,200	1,141.00	28,753,200	貸付株式数	10,100株
筑波銀行	46,800	236.00	11,044,800	貸付株式数	18,900株
七十七銀行	34,100	4,913.00	167,533,300		
秋田銀行	7,100	2,997.00	21,278,700		
山形銀行	11,700	1,523.00	17,819,100	貸付株式数	4,700株
岩手銀行	6,700	2,979.00	19,959,300		
東邦銀行	122,600	337.00	41,316,200	貸付株式数	48,000株
ふくおかフィナンシャルG	92,800	3,959.00	367,395,200		
スルガ銀行	63,000	1,327.00	83,601,000		
八十二銀行	239,700	1,191.50	285,602,550		
山梨中央銀行	11,900	2,536.00	30,178,400		
大垣共立銀行	20,300	2,485.00	50,445,500		
福井銀行	9,500	1,826.00	17,347,000	貸付株式数	3,800株
清水銀行	4,200	1,370.00	5,754,000	貸付株式数	1,000株
滋賀銀行	16,100	6,070.00	97,727,000		
南都銀行	16,000	4,100.00	65,600,000		
百五銀行	100,200	718.00	71,943,600		
紀陽銀行	38,100	2,542.00	96,850,200		
ほくほくフィナンシャルG	59,900	2,785.00	166,821,500		
山陰合同銀行	66,700	1,253.00	83,575,100		
百十四銀行	10,400	3,960.00	41,184,000		
四国銀行	15,400	1,137.00	17,509,800	貸付株式数	6,200株
阿波銀行	14,600	2,875.00	41,975,000	貸付株式数	2,600株
大分銀行	6,200	3,740.00	23,188,000	貸付株式数	2,000株
宮崎銀行	6,800	3,540.00	24,072,000	貸付株式数	800株
佐賀銀行	6,200	2,225.00	13,795,000	貸付株式数	2,400株
琉球銀行	24,400	1,147.00	27,986,800	貸付株式数	9,800株
セブン銀行	381,600	266.70	101,772,720	貸付株式数	154,300株
みずほフィナンシャルG	1,423,500	3,917.00	5,575,849,500		
山口フィナンシャルG	104,500	1,550.00	161,975,000		
芙蓉総合リース	29,400	3,995.00	117,453,000		
みずほリース	80,000	1,068.00	85,440,000		
東京センチュリー	79,600	1,576.50	125,489,400		
SBIホールディングス	171,600	4,465.00	766,194,000		
日本証券金融	39,200	1,728.00	67,737,600	貸付株式数	3,800株
アイフル	176,400	410.00	72,324,000		
名古屋銀行	6,700	8,060.00	54,002,000		
北洋銀行	145,300	572.00	83,111,600	貸付株式数	55,600株
愛媛銀行	15,500	1,012.00	15,686,000	貸付株式数	4,400株

京葉銀行	47,800	965.00	46,127,000		
栃木銀行	48,800	385.00	18,788,000		
北日本銀行	3,700	2,822.00	10,441,400	貸付株式数	1,400株
東和銀行	19,600	713.00	13,974,800		
リコーリース	10,100	5,180.00	52,318,000		
イオンフィナンシャルサービス	61,200	1,297.50	79,407,000	貸付株式数	23,900株
ア コ ム	253,500	416.40	105,557,400		
ジャックス	12,800	4,025.00	51,520,000		
オ リ コ	34,800	849.00	29,545,200		
オリックス	611,500	3,026.00	1,850,399,000		
三菱HCキャピタル	534,000	1,055.00	563,370,000		
ジャフコ グループ	31,700	2,463.00	78,077,100	貸付株式数	1,900株
トモニホールディングス	101,800	544.00	55,379,200		
大和証券G本社	761,700	965.00	735,040,500		
野村ホールディングス	1,791,400	883.00	1,581,806,200		
岡三証券グループ	84,200	683.00	57,508,600	貸付株式数	34,000株
丸三証券	35,400	878.00	31,081,200	貸付株式数	10,300株
東洋証券	26,900	472.00	12,696,800	貸付株式数	11,800株
東海東京ＨＤ	126,500	479.00	60,593,500	貸付株式数	49,400株
水戸証券	29,200	545.00	15,914,000		
いちよし証券	21,500	796.00	17,114,000	貸付株式数	8,600株
松井証券	73,400	692.00	50,792,800	貸付株式数	21,300株
SOMPOホールディングス	520,800	4,316.00	2,247,772,800		
日本取引所グループ	633,800	1,560.00	988,728,000		
マネックスG	102,600	698.00	71,614,800	貸付株式数	41,400株
極東証券	13,300	1,449.00	19,271,700	貸付株式数	5,300株
岩井コスモホールディング	12,100	2,106.00	25,482,600		
アイザワ証券グループ	12,800	1,277.00	16,345,600	貸付株式数	5,100株
フィデアホール	11,000	1,462.00	16,082,000	貸付株式数	4,300株
池田泉州ＨＤ	147,800	533.00	78,777,400	貸付株式数	9,800株
アニコム ホールディングス	33,400	694.00	23,179,600	貸付株式数	13,400株
ＭＳ＆ＡＤ	780,700	3,456.00	2,698,099,200		
スパークス・グループ	11,800	1,506.00	17,770,800		
第一生命HLDGS	1,945,700	1,119.50	2,178,211,150		
東京海上ＨＤ	1,016,900	6,172.00	6,276,306,800		
イー・ギャランティ	17,400	1,512.00	26,308,800	貸付株式数	5,500株
NECキャピタルソリューション	5,200	3,750.00	19,500,000		

T&Dホールディングス	286,000	3,350.00	958,100,000	
アドバンスクリエイト	8,400	294.00	2,469,600	貸付株式数 3,400株
三井不動産	1,462,900	1,350.50	1,975,646,450	
三菱地所	607,100	2,647.00	1,606,993,700	
平和不動産	17,300	4,505.00	77,936,500	貸付株式数 6,700株
東京建物	93,100	2,532.00	235,729,200	
京阪神ビルディング	17,800	1,494.00	26,593,200	貸付株式数 7,100株
住友不動産	173,300	5,521.00	956,789,300	
テーオーシー	19,000	684.00	12,996,000	
スターツコーポレーション	17,500	4,230.00	74,025,000	
フジ住宅	13,400	680.00	9,112,000	
空港施設	15,000	826.00	12,390,000	
明和地所	8,500	936.00	7,956,000	貸付株式数 2,200株
ゴールドクレスト	7,200	3,605.00	25,956,000	貸付株式数 2,900株
リログループ	61,900	1,669.00	103,311,100	
エスリード	5,000	4,530.00	22,650,000	貸付株式数 2,000株
日神グループHLDGS	17,100	497.00	8,498,700	貸付株式数 6,800株
日本エスコン	27,900	966.00	26,951,400	貸付株式数 3,700株
MIRARTHホールディング	62,400	384.00	23,961,600	貸付株式数 25,200株
イオンモール	64,400	2,800.00	180,320,000	
ランド	687,600	7.00	4,813,200	貸付株式数 275,000株
カチタス	28,600	2,374.00	67,896,400	
東祥	9,300	625.00	5,812,500	
トーセイ	17,700	2,467.00	43,665,900	
サンフロンティア不動産	17,700	2,029.00	35,913,300	
グランディハウス	9,900	527.00	5,217,300	貸付株式数 3,900株
東武鉄道	113,900	2,489.00	283,497,100	
相鉄ホールディングス	35,700	2,172.00	77,540,400	
東急	303,300	1,721.00	521,979,300	
京浜急行	133,800	1,512.00	202,305,600	貸付株式数 20,200株
小田急電鉄	178,900	1,621.00	289,996,900	
京王電鉄	53,300	3,430.00	182,819,000	
京成電鉄	188,300	1,416.00	266,632,800	
富士急行	13,300	2,038.00	27,105,400	貸付株式数 5,300株
東日本旅客鉄道	596,500	2,974.50	1,774,289,250	
西日本旅客鉄道	266,700	3,116.00	831,037,200	
東海旅客鉄道	416,600	3,113.00	1,296,875,800	
東京地下鉄	241,100	1,712.50	412,883,750	貸付株式数 97,400株
西武ホールディングス	117,800	3,998.00	470,964,400	
鴻池運輸	18,400	2,868.00	52,771,200	

西日本鉄道	31,300	2,119.00	66,324,700		
ハマキョウレックス	36,900	1,332.00	49,150,800		
サカイ引越センター	13,700	2,566.00	35,154,200	貸付株式数	5,200株
近鉄グループHLDGS	115,700	2,714.50	314,067,650		
阪急阪神HLDGS	143,300	3,840.00	550,272,000	貸付株式数	1,000株
南海電鉄	48,200	2,131.00	102,714,200		
京阪ホールディングス	59,500	3,093.00	184,033,500		
神戸電鉄	2,900	2,306.00	6,687,400	貸付株式数	1,200株
名古屋鉄道	119,300	1,619.00	193,146,700	貸付株式数	48,200株
山陽電鉄	8,100	1,989.00	16,110,900	貸付株式数	3,200株
ヤマトホールディングス	131,200	1,991.50	261,284,800		
山 九	24,700	7,084.00	174,974,800		
日 新	7,400	8,110.00	60,014,000		
丸全昭和運輸	6,700	6,600.00	44,220,000	貸付株式数	2,600株
センコーグループHLDGS	71,100	1,940.00	137,934,000		
ニッコンホールディングス	61,400	3,250.00	199,550,000	貸付株式数	24,800株
福山通運	11,500	3,445.00	39,617,500		
セイノーホールディングス	53,100	2,218.50	117,802,350		
神奈川中央交通	3,100	3,635.00	11,268,500		
AZ-COM丸和ホールディ	33,500	1,104.00	36,984,000	貸付株式数	6,400株
日本郵船	223,800	4,941.00	1,105,795,800		
商船三井	205,500	4,862.00	999,141,000		
川崎汽船	232,700	2,062.50	479,943,750	貸付株式数	91,200株
NSユナイテッド海運	6,800	3,805.00	25,874,000		
飯野海運	39,600	981.00	38,847,600		
九州旅客鉄道	82,700	3,794.00	313,763,800		
SGホールディングス	181,300	1,485.50	269,321,150		
NIPPON EXPRESS	116,100	2,731.50	317,127,150	貸付株式数	45,400株
日本航空	247,500	2,945.00	728,887,500		
ANAホールディングス	293,800	2,863.00	841,149,400		
ビーウィズ	2,900	1,479.00	4,289,100	貸付株式数	1,100株
サンウェルズ	5,700	614.00	3,499,800	貸付株式数	2,200株
TREホールディングス	25,500	1,350.00	34,425,000		
人・夢・技術グループ	4,600	1,649.00	7,585,400	貸付株式数	1,800株
シルバーライフ	3,100	789.00	2,445,900	貸付株式数	500株
GENKY DRUGSTORES	10,000	3,390.00	33,900,000	貸付株式数	4,000株
コーア商事HLDGS	10,200	713.00	7,272,600	貸付株式数	4,100株
KPPグループホールディン	21,800	727.00	15,848,600		
ブックオフＧＨＤ	8,300	1,375.00	11,412,500	貸付株式数	3,300株

ギフトホールディングス	5,700	3,560.00	20,292,000	貸付株式数	2,200株
三菱倉庫	107,300	1,166.00	125,111,800		
三井倉庫HOLD	33,300	4,025.00	134,032,500		
住友倉庫	31,400	3,000.00	94,200,000		
渋沢倉庫	4,900	3,900.00	19,110,000	貸付株式数	1,900株
ヤマタネ	9,200	2,300.00	21,160,000		
乾汽船	13,700	1,202.00	16,467,400	貸付株式数	5,500株
日本トランスシティ	21,700	968.00	21,005,600		
中央倉庫	6,400	1,386.00	8,870,400		
安田倉庫	7,400	1,897.00	14,037,800	貸付株式数	2,900株
ＮＩＳＳＯＨＤ	9,600	617.00	5,923,200	貸付株式数	3,700株
大栄環境	24,200	3,100.00	75,020,000	貸付株式数	9,800株
GENOVA	5,000	742.00	3,710,000	貸付株式数	2,000株
日本管財ホールディンク	11,700	2,724.00	31,870,800	貸付株式数	4,400株
上 組	47,400	4,043.00	191,638,200		
キユーソー流通システム	7,200	2,342.00	16,862,400	貸付株式数	2,800株
エーアイテイー	6,800	1,754.00	11,927,200		
日本コンセプト	3,900	1,716.00	6,692,400		
TBSホールディングス	53,600	4,467.00	239,431,200		
日本テレビHLDS	96,000	3,216.00	308,736,000	貸付株式数	11,000株
朝日放送グループHD	13,600	660.00	8,976,000	貸付株式数	5,400株
テレビ朝日ＨＤ	26,300	2,575.00	67,722,500		
スカパーJSATHD	84,300	1,307.00	110,180,100		
テレビ東京ＨＤ	6,700	3,475.00	23,282,500	貸付株式数	2,700株
ビジョン	16,500	1,233.00	20,344,500	貸付株式数	6,600株
U-NEXT HOLDINGS	36,500	2,251.00	82,161,500	貸付株式数	14,200株
日本通信	87,200	168.00	14,649,600	貸付株式数	35,200株
日本電信電話	32,268,000	157.00	5,066,076,000		
ＫＤＤＩ	1,595,800	2,411.50	3,848,271,700		
ソフトバンク	17,390,800	219.10	3,810,324,280		
光通信	12,500	40,920.00	511,500,000	貸付株式数	5,000株
エムティーアイ	7,300	880.00	6,424,000	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	35,000	3,598.00	125,930,000		
ファイバーゲート	4,200	780.00	3,276,000	貸付株式数	1,600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	55,500	3,716.00	206,238,000		
学研ホールディングス	19,900	947.00	18,845,300		
ゼンリン	18,500	1,144.00	21,164,000	貸付株式数	7,400株
東京電力ＨＤ	910,000	376.10	342,251,000	貸付株式数	255,600株
中部電力	398,600	1,706.50	680,210,900		

関西電力	527,600	1,575.00	830,970,000		
中国電力	187,900	694.10	130,421,390	貸付株式数	16,300株
北陸電力	110,600	685.30	75,794,180	貸付株式数	5,800株
東北電力	284,800	996.90	283,917,120		
四国電力	100,700	1,163.50	117,164,450		
九州電力	249,300	1,215.00	302,899,500		
北海道電力	113,200	697.00	78,900,400	貸付株式数	45,700株
沖縄電力	27,600	886.00	24,453,600	貸付株式数	11,100株
電源開発	81,400	2,370.00	192,918,000		
エフオン	7,900	342.00	2,701,800		
イーレックス	21,100	775.00	16,352,500	貸付株式数	8,500株
レノバ	29,500	657.00	19,381,500	貸付株式数	11,800株
東京瓦斯	204,500	4,742.00	969,739,000		
大阪瓦斯	212,500	3,625.00	770,312,500		
東邦瓦斯	39,700	3,992.00	158,482,400		
北海道瓦斯	32,300	556.00	17,958,800	貸付株式数	5,000株
広島ガス	22,900	351.00	8,037,900	貸付株式数	6,000株
西部ガスHLDGS	11,300	1,794.00	20,272,200	貸付株式数	4,500株
静岡ガス	24,700	1,077.00	26,601,900		
メタウォーター	14,300	2,117.00	30,273,100		
M&A総研ホールディング	14,400	1,343.00	19,339,200	貸付株式数	1,200株
アイネット	6,300	1,846.00	11,629,800	貸付株式数	2,500株
松 竹	6,200	13,200.00	81,840,000	貸付株式数	2,500株
東 宝	64,100	7,555.00	484,275,500		
エイチ・アイ・エス	35,500	1,562.00	55,451,000	貸付株式数	14,300株
東 映	17,900	4,795.00	85,830,500		
ラックランド	4,600	1,102.00	5,069,200	貸付株式数	1,300株
NTTデータグループ	283,200	3,991.00	1,130,251,200		
共立メンテナンス	34,900	3,515.00	122,673,500	貸付株式数	14,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	10,800	1,602.00	17,301,600		
建設技術研究所	11,500	2,658.00	30,567,000	貸付株式数	1,400株
スペース	8,100	1,168.00	9,460,800		
アインホールディングス	11,500	5,699.00	65,538,500	貸付株式数	3,500株
燦ホールディングス	9,300	1,521.00	14,145,300		
ピー・シー・エー	7,100	1,807.00	12,829,700		
スバル興業	4,300	3,045.00	13,093,500	貸付株式数	500株
タナベコンサルティンググル	9,300	726.00	6,751,800	貸付株式数	2,100株
ビジネスＢ太田昭和	4,600	2,660.00	12,236,000		

ナ ガ ワ	3,000	6,050.00	18,150,000	貸付株式数	1,200株
東京都競馬	8,100	4,470.00	36,207,000	貸付株式数	2,700株
カナモト	17,200	3,390.00	58,308,000		
ＤＴＳ	18,500	4,995.00	92,407,500		
スクウェア・エニックス・HD	54,500	8,993.00	490,118,500		
シーイーシー	13,100	2,280.00	29,868,000		
カプコン	215,600	4,313.00	929,882,800		
ニシオホールディングス	9,200	4,015.00	36,938,000		
アイ・エス・ビー	5,100	1,360.00	6,936,000	貸付株式数	1,200株
日本空港ビルデング	37,700	4,418.00	166,558,600		
トランス・コスモス	14,200	3,340.00	47,428,000		
乃村工藝社	48,500	882.00	42,777,000		
ＳＣＳＫ	88,600	4,335.00	384,081,000		
藤田観光	4,900	10,270.00	50,323,000	貸付株式数	2,000株
KNT-CTホールディングス	6,600	1,002.00	6,613,200	貸付株式数	900株
トーカイ	9,800	2,188.00	21,442,400	貸付株式数	2,200株
セコム	226,500	5,288.00	1,197,732,000		
ＮＳＷ	4,800	2,720.00	13,056,000		
セントラル警備保障	6,000	2,357.00	14,142,000	貸付株式数	2,200株
アイネス	8,500	1,706.00	14,501,000		
丹青社	23,500	1,094.00	25,709,000		
メイテックグループホールデ	41,000	3,199.00	131,159,000		
ＴＫＣ	16,900	4,300.00	72,670,000		
応用地質	10,100	2,762.00	27,896,200		
船井総研ホールディン	22,200	2,353.00	52,236,600		
ＮＳＤ	41,700	3,468.00	144,615,600		
コナミグループ	40,600	19,730.00	801,038,000		
学 究 社	4,400	2,230.00	9,812,000		
イオンディライト	5,900	5,390.00	31,801,000		
ナック	11,300	558.00	6,305,400	貸付株式数	4,500株
福井コンピュータHLDS	7,500	3,045.00	22,837,500	貸付株式数	3,000株
ダイセキ	26,800	3,485.00	93,398,000		
ステップ	4,000	2,237.00	8,948,000		
泉州電業	7,500	4,245.00	31,837,500		
GENKI GLOBAL DIN	6,500	4,120.00	26,780,000		
トラスコ中山	24,000	2,023.00	48,552,000		
ヤマダホールディングス	352,000	435.00	153,120,000		
オートバックスセブン	39,800	1,438.00	57,232,400		

モリト	9,100	1,413.00	12,858,300	貸付株式数 3,600株
アークランズ	34,000	1,707.00	58,038,000	貸付株式数 13,700株
ニトリホールディングス	41,700	14,585.00	608,194,500	
グルメ杵屋	9,300	980.00	9,114,000	貸付株式数 3,700株
ケーユーホールディングス	6,700	1,137.00	7,617,900	
吉野家ホールディングス	44,800	3,199.00	143,315,200	貸付株式数 18,000株 (4,400株)
加藤産業	14,200	5,350.00	75,970,000	
イノテック	7,800	1,342.00	10,467,600	
イエローハット	38,800	1,520.00	58,976,000	
松屋フーズHLDGS	5,400	5,640.00	30,456,000	貸付株式数 2,100株
JBCCホールディングス	28,800	1,348.00	38,822,400	
JKホールディングス	8,800	1,201.00	10,568,800	
サガミホールディングス	18,400	1,720.00	31,648,000	貸付株式数 7,400株 (5,400株)
日 伝	6,400	2,681.00	17,158,400	貸付株式数 2,500株
ミロク情報サービス	9,100	1,798.00	16,361,800	貸付株式数 3,700株
杉本商事	10,100	1,713.00	17,301,300	貸付株式数 4,000株
因幡電機産業	32,200	3,802.00	122,424,400	
王将フードサービス	22,600	3,505.00	79,213,000	
ミニストップ	9,500	1,814.00	17,233,000	貸付株式数 3,700株 (1,200株)
アークス	19,200	2,864.00	54,988,800	
バローホールディングス	21,800	2,426.00	52,886,800	
東 テ ク	11,500	2,805.00	32,257,500	
ミスミグループ本社	173,000	1,893.00	327,489,000	
ベ ル ク	5,700	7,040.00	40,128,000	
大 庄	7,700	1,148.00	8,839,600	貸付株式数 2,700株 (300株)
ファーストリテイリング	77,200	48,690.00	3,758,868,000	
ソフトバンクグループ	535,100	7,381.00	3,949,573,100	
スズケン	35,000	5,266.00	184,310,000	
サンドラッグ	38,600	4,444.00	171,538,400	
サックスバーホールディング	10,900	817.00	8,905,300	貸付株式数 3,300株
ジェコス	6,800	1,234.00	8,391,200	貸付株式数 2,700株
ベルーナ	27,500	886.00	24,365,000	貸付株式数 11,100株
合計			423,077,170,510	

（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

	2024年6月5日現在 金　額（円）	2025年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,017,192,359	1,450,672,313
コール・ローン	10,083,776,658	6,300,807,126
株式	530,134,605,136	651,256,862,312
投資証券	10,450,150,346	12,235,492,885
派生商品評価勘定	192,509,225	847,094,792
未収入金	170,512,961	213,456,187
未収配当金	721,053,905	789,049,720
差入委託証拠金	11,702,933,022	11,752,476,709
流動資産合計	565,472,733,612	684,845,912,044
資産合計	565,472,733,612	684,845,912,044
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	239,530,120	66,830,321
未払金	255,565,063	22,209,330
未払解約金	512,987,500	537,004,100
流動負債合計	1,008,082,683	626,043,751
負債合計	1,008,082,683	626,043,751
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	87,479,090,223	100,222,632,522
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	476,985,560,706	583,997,235,771
元本等合計	564,464,650,929	684,219,868,293
純資産合計	564,464,650,929	684,219,868,293
負債純資産合計	565,472,733,612	684,845,912,044

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6月6日 至2025年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
1.　※1 期首	2023年6月6日	2024年6月6日
期首元本額	73,305,284,321円	87,479,090,223円
期中追加設定元本額	19,614,413,968円	22,672,801,070円
期中一部解約元本額	5,440,608,066円	9,929,258,771円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	231,936,141円	202,556,103円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	1,404,824円	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)	18,155,186円	13,595,385円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,622,837円	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)	105,788,926円	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）	104,499,374円	134,715,450円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	81,610,632円	66,954,737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）	3,603,803,431円	9,834,026,081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）	763,469,634円	801,802,589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）	5,126,154,738円	6,828,622,447円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	564,172,689円	632,968,113円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	16,373,983円	16,323,453円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	48,058,214円	46,407,165円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	8,558,889,201円	10,909,810,162円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,462,261,186円	1,662,950,033円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	334,607,922円	387,131,209円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	14,772,586円	29,580,158円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	49,943,452,503円	51,518,833,316円
ダイワ・ライフ・バランス３０	478,833,626円	448,631,876円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,041,222,730円	1,059,591,878円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,023,844,885円	1,066,178,597円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,366,688,095円	1,036,121,179円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	9,967,772円	8,246,363円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	11,386,436円	12,414,104円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,471,584,963円	3,173,816,609円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,895,870円	1,950,434円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,491,246円	3,052,964円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,489,995円	47,909,962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）	14,807,459円	18,807,285円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	43,911,825円	37,716,041円

ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	29,814,954円	28,624,114円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	757,743,173円	589,049,162円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	43,613,830円	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）	127,189,928円	106,256,826円
スタイル9（4資産分散・保守型）	124,453円	554,877円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	1,014,951円	3,798,748円
スタイル9（4資産分散・積極型）	1,440,142円	5,556,281円
スタイル9（6資産分散・保守型）	76,460円	208,338円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,801,643円	6,948,523円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,269,705円	7,707,964円
スタイル9（8資産分散・保守型）	92,986円	294,819円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,345,037円	5,369,709円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,991,541円	14,734,328円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カントリー）	-円	40,173,225円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,293,913,568円	1,111,740,890円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	421,965,105円	408,894,579円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	3,870,699,940円	4,234,563,479円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,166,373,432円	3,346,789,898円
ダイワライフスタイル２５	7,301,752円	6,507,060円
ダイワライフスタイル５０	34,877,865円	31,403,888円
ダイワライフスタイル７５	29,822,878円	27,761,848円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	81,305,208円	-円

ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	78,711,436円	64,999,458円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	68,441,327円	64,149,853円
計	87,479,090,223円	100,222,632,522円
2. 期末日における受益権の総数	87,479,090,223口	100,222,632,522口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月6日 至2025年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月5日現在

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	63,301,081,448	6,413,738,806
投資証券	397,731,996	△666,626,353
合計	63,698,813,444	5,747,112,453

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2024年6月5日現在				2025年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	23,734,820,629	-	23,787,857,974	53,037,345	19,774,756,626	-	20,565,051,357	790,294,731
合計	23,734,820,629	-	23,787,857,974	53,037,345	19,774,756,626	-	20,565,051,357	790,294,731

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年6月5日現在				2025年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	9,709,805,240	-	9,609,747,000	△100,058,240	6,109,954,260	-	6,099,924,000	△10,030,260
アメリカ・ドル	4,873,583,360	-	4,823,208,000	△50,375,360	2,449,786,520	-	2,446,012,000	△3,774,520
イギリス・ポンド	518,736,540	-	513,500,000	△5,236,540	366,614,770	-	366,339,000	△275,770
オーストラリア・ドル	646,630,210	-	638,104,000	△8,526,210	508,265,450	-	508,750,000	484,550
カナダ・ドル	1,437,128,840	-	1,413,625,000	△23,503,840	1,211,739,650	-	1,208,488,000	△3,251,650
スイス・フラン	958,226,880	-	957,935,000	△291,880	839,659,670	-	837,600,000	△2,059,670
ユーロ	1,275,499,410	-	1,263,375,000	△12,124,410	733,888,200	-	732,735,000	△1,153,200
合計	9,709,805,240	-	9,609,747,000	△100,058,240	6,109,954,260	-	6,099,924,000	△10,030,260

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
１口当たり純資産額	6.4526円	6.8270円
（1万口当たり純資産額）	(64,526円)	(68,270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	8,000	244.120	1,952,960.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	44,900	194.070	8,713,743.000	
	FIRST SOLAR INC	7,000	159.810	1,118,670.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,800	161.060	1,900,508.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,600	102.510	881,586.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	26,400	57.870	1,527,768.000	
	ABBOTT LABORATORIES	117,566	132.960	15,631,575.360	
	HOWMET AEROSPACE INC	26,083	173.940	4,536,877.020	
	VERISK ANALYTICS INC	9,500	321.330	3,052,635.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	24,100	41.350	996,535.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	82,200	91.910	7,555,002.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,300	694.750	2,292,675.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,800	80.340	2,876,172.000	
	AFLAC INC	35,100	102.830	3,609,333.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	8,000	216.250	1,730,000.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,000	140.170	1,541,870.000	
	ADOBE INC	28,920	413.910	11,970,277.200	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,300	91.630	1,035,419.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,500	335.190	2,513,925.000	
GARMIN LTD	10,500	204.950	2,151,975.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,100	280.210	4,231,171.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44,000	227.450	10,007,800.000	
WR BERKLEY CORP	20,613	74.040	1,526,186.520	
AUTOZONE INC	1,220	3,717.040	4,534,788.800	
DOLLAR TREE INC	13,871	88.620	1,229,248.020	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,300	17.520	1,406,856.000	
DR HORTON INC	19,216	123.530	2,373,752.480	
AUTODESK INC	14,500	298.360	4,326,220.000	
MOODY'S CORP	11,000	485.520	5,340,720.000	
DEVON ENERGY CORP	41,500	31.560	1,309,740.000	
ATMOS ENERGY CORP	10,800	152.150	1,643,220.000	
ALLIANT ENERGY CORP	17,500	60.680	1,061,900.000	
CITIGROUP INC	127,573	76.400	9,746,577.200	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	27,600	326.210	9,003,396.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	36,200	101.850	3,686,970.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,230	465.910	1,038,979.300	
HESS CORP	20,000	133.450	2,669,000.000	
DAVITA INC	3,050	136.750	417,087.500	
DANAHER CORP	43,650	193.080	8,427,942.000	
FORTIVE CORP	23,100	71.920	1,661,352.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	39,000	179.130	6,986,070.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,600	47.240	1,540,024.000	
APPLE INC	1,018,800	202.820	206,633,016.000	
BOEING CO/THE	51,000	211.980	10,810,980.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,615	149.760	1,589,702.400	
BECTON DICKINSON AND CO	19,499	170.940	3,333,159.060	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	144.420	1,198,686.000	
NISOURCE INC	31,900	39.080	1,246,652.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,100	96.160	778,896.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	48,671	88.330	4,299,109.430	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	286,004	43.240	12,366,812.960	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,850	491.000	44,607,350.000	
ANSYS INC	6,000	336.610	2,019,660.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	88,717	39.510	3,505,208.670	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	49,500	138.760	6,868,620.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	137,900	47.950	6,612,305.000	

JPMORGAN CHASE & CO	189,470	264.220	50,061,763.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	15,100	93.790	1,416,229.000	
LKQ CORP	17,300	39.920	690,616.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,412	33.200	412,078.400	
CADENCE DESIGN SYS INC	18,600	294.400	5,475,840.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,500	507.520	3,298,880.000	
DOLLAR GENERAL CORP	15,000	111.770	1,676,550.000	
SERVICENOW INC	14,100	1,012.740	14,279,634.000	
CATERPILLAR INC	32,400	349.330	11,318,292.000	
BROWN & BROWN INC	16,600	111.180	1,845,588.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,800	37.320	664,296.000	
CMS ENERGY CORP	20,300	69.720	1,415,316.000	
DELTA AIR LINES INC	11,100	48.980	543,678.000	
CORNING INC	55,200	50.760	2,801,952.000	
CISCO SYSTEMS INC	269,650	64.390	17,362,763.500	
MORGAN STANLEY	82,052	128.160	10,515,784.320	
DECKERS OUTDOOR CORP	10,300	105.810	1,089,843.000	
MSCI INC	5,300	566.910	3,004,623.000	
FAIR ISAAC CORP	1,700	1,755.030	2,983,551.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,200	561.510	1,235,322.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,100	79.930	1,206,943.000	
BROADCOM INC	302,720	261.080	79,034,137.600	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,900	323.970	939,513.000	
CNH INDUSTRIAL NV	59,200	12.440	736,448.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,900	176.670	689,013.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,900	305.310	2,717,259.000	
DTE ENERGY COMPANY	14,100	133.310	1,879,671.000	
CENTENE CORP	33,507	54.940	1,840,874.580	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,100	223.740	1,588,554.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,700	40.170	1,193,049.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,400	336.340	5,852,316.000	
GARTNER INC	5,250	425.620	2,234,505.000	
DOMINION ENERGY INC	57,841	56.080	3,243,723.280	
MONSTER BEVERAGE CORP	49,500	63.160	3,126,420.000	
DEERE & CO	17,500	507.780	8,886,150.000	
QUANTA SERVICES INC	10,100	359.110	3,627,011.000	
POOL CORP	2,600	309.420	804,492.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,684	76.690	1,279,495.960	
BURLINGTON STORES INC	4,300	238.380	1,025,034.000	

NASDAQ INC	29,300	83.870	2,457,391.000	
TARGA RESOURCES CORP	14,800	160.680	2,378,064.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	123.780	569,388.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,500	102.210	2,504,145.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,400	140.110	756,594.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,900	211.430	1,036,007.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,500	283.570	2,977,485.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	292.610	1,111,918.000	
CARLISLE COS INC	3,000	381.880	1,145,640.000	
IDEX CORP	5,200	180.890	940,628.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	52,200	90.200	4,708,440.000	
ROLLINS INC	19,807	58.040	1,149,598.280	
AECOM	8,900	110.800	986,120.000	
WATSCO INC	2,400	445.310	1,068,744.000	
GRACO INC	11,300	84.290	952,477.000	
AMETEK INC	15,700	177.210	2,782,197.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	16,700	99.630	1,663,821.000	
HEICO CORP	3,000	300.050	900,150.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,600	433.790	1,127,854.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,300	56.010	968,973.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,000	577.980	1,733,940.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,160	1,051.690	31,718,970.400	
RPM INTERNATIONAL INC	8,600	115.510	993,386.000	
RELIANCE INC	3,600	308.570	1,110,852.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	91,900	52.160	4,793,504.000	
CUMMINS INC	9,400	322.830	3,034,602.000	
CDW CORP/DE	9,000	176.800	1,591,200.000	
COSTAR GROUP INC	28,700	77.060	2,211,622.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13,000	161.490	2,099,370.000	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	7,400	206.030	1,524,622.000	
MERCADOLIBRE INC	3,090	2,573.960	7,953,536.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,000	181.510	907,550.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,316	249.430	4,069,699.880	
DEXCOM INC	26,600	85.610	2,277,226.000	
NORDSON CORP	3,690	213.210	786,744.900	
COPART INC	62,300	50.380	3,138,674.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,000	139.350	1,811,550.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,800	179.990	863,952.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,500	376.230	2,069,265.000	

TRANSDIGM GROUP INC	3,890	1,448.700	5,635,443.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,800	124.520	846,736.000	
KINDER MORGAN INC	135,581	28.030	3,800,335.430	
HCA HEALTHCARE INC	12,500	381.660	4,770,750.000	
COTERRA ENERGY INC	51,900	24.890	1,291,791.000	
T-MOBILE US INC	30,827	241.960	7,458,900.920	
ZILLOW GROUP INC - C	11,150	70.210	782,841.500	
EMCOR GROUP INC	3,100	482.640	1,496,184.000	
COCA-COLA CO/THE	277,050	71.370	19,773,058.500	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,400	90.970	1,400,938.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,350	111.570	1,043,179.500	
CSX CORP	128,100	31.930	4,090,233.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,425	169.820	1,430,733.500	
AMAZON.COM INC	647,400	207.230	134,160,702.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,700	77.850	3,090,645.000	
EXXON MOBIL CORP	293,009	102.300	29,974,820.700	
EVEREST GROUP LTD	3,300	344.780	1,137,774.000	
EOG RESOURCES INC	37,400	110.770	4,142,798.000	
EQT CORP	38,500	55.490	2,136,365.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,000	76.600	766,000.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	1,828.490	1,279,943.000	
CENCORA INC	12,600	289.020	3,641,652.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,400	114.940	2,229,836.000	
FORD MOTOR CO	264,723	10.240	2,710,763.520	
ENTEGRIS INC	10,300	72.620	747,986.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	16,900	378.100	6,389,890.000	
AERCAP HOLDINGS NV	12,200	114.650	1,398,730.000	
FORTINET INC	44,400	101.620	4,511,928.000	
MARKEL CORP	860	1,930.420	1,660,161.200	
NEXTERA ENERGY INC	139,580	69.880	9,753,850.400	
FREEPORT-MCMORAN INC	97,408	40.860	3,980,090.880	
INSULET CORP	4,800	319.210	1,532,208.000	
US BANCORP	105,600	43.900	4,635,840.000	
UNITED RENTALS INC	4,500	696.570	3,134,565.000	
F5 NETWORKS INC	4,000	293.830	1,175,320.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	34,200	44.130	1,509,246.000	
FASTENAL CO	76,200	40.880	3,115,056.000	
FISERV INC	37,833	164.160	6,210,665.280	
GENERAL ELECTRIC CO	72,306	250.880	18,140,129.280	

AXON ENTERPRISE INC	5,000	780.000	3,900,000.000	
GENERAL MOTORS CO	65,200	47.670	3,108,084.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,500	275.030	4,262,965.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,150	599.210	12,673,291.500	
ALPHABET INC-CL A	395,300	168.050	66,430,165.000	
ALPHABET INC-CL C	335,240	169.390	56,786,303.600	
OWENS CORNING	5,700	136.530	778,221.000	
GENERAL MILLS INC	37,100	54.610	2,026,031.000	
FIRSTENERGY CORP	37,218	40.870	1,521,099.660	
GENUINE PARTS CO	9,450	126.280	1,193,346.000	
FIFTH THIRD BANCORP	45,300	38.450	1,741,785.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,750	242.310	3,089,452.500	
HALLIBURTON CO	58,400	20.010	1,168,584.000	
HOME DEPOT INC	67,350	372.400	25,081,140.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,000	15.740	1,558,260.000	
HERSHEY CO/THE	10,100	161.480	1,630,948.000	
HUMANA INC	8,200	230.830	1,892,806.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,200	210.020	3,612,344.000	
HP INC	63,900	25.180	1,609,002.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	89,100	17.840	1,589,544.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,500	94.750	2,416,125.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	60,303	26.700	1,610,090.100	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,900	265.520	16,701,208.000	
HUBBELL INC	3,700	390.720	1,445,664.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,000	47.290	1,607,860.000	
ZOETIS INC	30,300	168.590	5,108,277.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,199	432.620	6,575,391.380	
CHENIERE ENERGY INC	15,100	240.890	3,637,439.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	130.960	379,784.000	
ALLEGION PLC	5,850	138.110	807,943.500	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,700	112.730	868,021.000	
WASTE CONNECTIONS INC	17,537	191.530	3,358,861.610	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.890	606,541.000	
JM SMUCKER CO/THE	7,300	112.030	817,819.000	
JOHNSON & JOHNSON	163,300	153.220	25,020,826.000	
ABBVIE INC	119,872	187.340	22,456,820.480	
HOLOGIC INC	15,300	62.570	957,321.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,500	138.430	3,114,675.000	
KROGER CO	42,500	66.340	2,819,450.000	

KLA CORP	9,100	782.090	7,117,019.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,300	482.210	6,895,603.000	
CORPAY INC	4,600	326.880	1,503,648.000	
LOWE'S COS INC	38,000	228.390	8,678,820.000	
ELI LILLY & CO	54,685	765.840	41,879,960.400	
LAM RESEARCH CORP	87,000	84.770	7,374,990.000	
LOEWS CORP	12,300	88.210	1,084,983.000	
MCDONALD'S CORP	48,450	311.570	15,095,566.500	
3M CO	36,590	146.810	5,371,777.900	
META PLATFORMS INC CLASS A	148,500	687.950	102,160,575.000	
S&P GLOBAL INC	21,339	513.940	10,966,965.660	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,200	549.570	2,308,194.000	
PHILLIPS 66	27,500	112.480	3,093,200.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	11,200	210.920	2,362,304.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17,200	73.240	1,259,728.000	
METLIFE INC	39,300	78.810	3,097,233.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	58,700	66.300	3,891,810.000	
ARISTA NETWORKS INC	72,700	94.940	6,902,138.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,398	417.400	4,757,525.200	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,500	1,169.670	1,754,505.000	
BAKER HUGHES CO	67,123	37.290	2,503,016.670	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,700	318.890	2,455,453.000	
MERCK & CO. INC.	170,521	78.270	13,346,678.670	
DUPONT DE NEMOURS INC	28,451	67.950	1,933,245.450	
MASCO CORP	14,400	63.360	912,384.000	
M & T BANK CORP	11,099	179.870	1,996,377.130	
MARSH & MCLENNAN COS	33,470	232.320	7,775,750.400	
HEICO CORP-CLASS A	5,120	234.850	1,202,432.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,902	261.930	4,165,210.860	
WORKDAY INC-CLASS A	14,600	249.480	3,642,408.000	
BLOCK INC CLASS A	38,012	63.860	2,427,446.320	
TRANSUNION	13,300	87.190	1,159,627.000	
VISTRA CORP	23,100	172.690	3,989,139.000	
NETAPP INC	14,000	103.760	1,452,640.000	
NIKE INC -CL B	79,900	62.770	5,015,323.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,400	247.400	3,809,960.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,500	64.670	2,360,455.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,205	145.400	1,920,007.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,300	491.290	4,568,997.000	

NEWMONT CORP	76,411	55.280	4,224,000.080	
MCKESSON CORP	8,500	709.460	6,030,410.000	
XYLEM INC	16,500	126.730	2,091,045.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	105,500	180.660	19,059,630.000	
NUCOR CORP	15,600	121.860	1,901,016.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,800	701.080	7,571,664.000	
GODADDY INC - CLASS A	9,600	182.290	1,749,984.000	
EVERGY INC	15,650	65.050	1,018,032.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	47,724	41.910	2,000,112.840	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,750	359.770	629,597.500	
OKTA INC	11,300	105.600	1,193,280.000	
WIX.COM LTD	3,710	153.250	568,557.500	
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,900	52.930	1,106,237.000	
KKR & CO INC	42,200	120.510	5,085,522.000	
PAYCHEX INC	22,000	159.330	3,505,260.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,900	1,366.590	5,329,701.000	
ALTRIA GROUP INC	114,300	59.310	6,779,133.000	
P G & E CORP	149,000	16.060	2,392,940.000	
PFIZER INC	384,313	23.390	8,989,081.070	
CIGNA CORP	18,400	310.120	5,706,208.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,901	112.700	2,468,242.700	
XCEL ENERGY INC	39,100	68.500	2,678,350.000	
STERIS PLC	6,700	242.100	1,622,070.000	
SEA LTD-ADR	26,800	168.160	4,506,688.000	
FOX CORP - CLASS B	9,433	49.550	467,405.150	
FOX CORP - CLASS A	14,799	54.020	799,441.980	
STRYKER CORP	23,280	382.550	8,905,764.000	
DOW INC	47,718	28.280	1,349,465.040	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,900	138.260	1,092,254.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	17,100	80.680	1,379,628.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,800	665.140	5,853,232.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	127,600	83.450	10,648,220.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	158,867	165.950	26,363,978.650	
EXELON CORP	68,422	42.750	2,925,040.500	
INGERSOLL-RAND INC	27,408	81.880	2,244,167.040	
NVR INC	210	7,210.870	1,514,282.700	
CONOCOPHILLIPS	85,603	85.950	7,357,577.850	
TWILIO INC - A	9,800	119.870	1,174,726.000	

DOCUSIGN INC	13,800	93.840	1,294,992.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,600	264.800	953,280.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	21,000	54.720	1,149,120.000	
PEPSICO INC	93,000	131.740	12,251,820.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,320	395.850	1,314,222.000	
MONGODB INC	5,600	199.730	1,118,488.000	
SNAP INC - A	73,400	8.450	620,230.000	
CORTEVA INC	46,368	71.380	3,309,747.840	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,100	103.780	2,501,098.000	
AMCOR PLC	156,700	9.070	1,421,269.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,800	460.560	7,737,408.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,300	138.840	1,846,572.000	
ACCENTURE PLC-CL A	42,500	316.400	13,447,000.000	
PENTAIR PLC	11,275	99.830	1,125,583.250	
QUALCOMM INC	75,000	149.050	11,178,750.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,200	76.340	1,160,368.000	
DATADOG INC - CLASS A	19,500	119.700	2,334,150.000	
PINTEREST INC- CLASS A	40,300	33.810	1,362,543.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,300	484.930	3,539,989.000	
REPUBLIC SERVICES INC	14,900	254.120	3,786,388.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,300	5,557.000	12,781,100.000	
ROSS STORES INC	22,300	142.510	3,177,973.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,130	193.340	1,185,174.200	
RESMED INC	10,000	249.940	2,499,400.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,630	173.810	1,326,170.300	
HUBSPOT INC	3,380	599.290	2,025,600.200	
REVVITY INC	8,200	92.400	757,680.000	
CARRIER GLOBAL CORP	52,687	71.390	3,761,324.930	
OTIS WORLDWIDE CORP	26,838	95.270	2,556,856.260	
AVANTOR INC	45,200	13.310	601,612.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,000	45.090	721,440.000	
DYNATRACE INC	20,300	54.100	1,098,230.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	30,700	76.050	2,334,735.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	61,385	21.300	1,307,500.500	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	25,100	33.440	839,344.000	
CHEVRON CORP	112,418	137.370	15,442,860.660	
ZSCALER INC	6,900	296.850	2,048,265.000	
EDISON INTERNATIONAL	26,100	54.360	1,418,796.000	
TESLA INC	196,250	332.050	65,164,812.500	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,600	209.600	4,527,360.000	
GEN DIGITAL INC	35,500	29.090	1,032,695.000	
SYNOPSYS INC	10,500	473.190	4,968,495.000	
CARVANA CO	8,300	345.640	2,868,812.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	21,000	170.920	3,589,320.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,305	388.770	2,451,194.850	
DOORDASH INC - A	24,350	220.230	5,362,600.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	36,400	91.070	3,314,948.000	
AIRBNB INC-CLASS A	29,600	133.510	3,951,896.000	
CBRE GROUP INC - A	20,400	127.410	2,599,164.000	
SOUTHERN CO/THE	74,400	88.290	6,568,776.000	
SYSCO CORP	33,200	72.900	2,420,280.000	
TRAVELERS COS INC/THE	15,403	271.860	4,187,459.580	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,400	112.140	493,416.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,650	134.970	1,302,460.500	
SCHLUMBERGER LTD	92,052	33.240	3,059,808.480	
AT&T INC	486,491	27.360	13,310,393.760	
ON SEMICONDUCTOR CORP	28,300	50.280	1,422,924.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16,200	362.220	5,867,964.000	
SEMPRA ENERGY	44,300	76.430	3,385,849.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,700	48.520	519,164.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	145,300	130.010	18,890,453.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,350	127.640	1,831,634.000	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,600	256.000	3,481,600.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	61,700	190.720	11,767,424.000	
SALESFORCE.COM INC	65,166	263.170	17,149,736.220	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	27,109	130.300	3,532,302.700	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	44,734	102.330	4,577,630.220	
TERADYNE INC	10,900	82.060	894,454.000	
UNION PACIFIC CORP	40,680	220.870	8,984,991.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,088	156.950	3,309,761.600	
RTX CORP	90,479	138.550	12,535,865.450	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49,800	98.550	4,907,790.000	
IQVIA HOLDINGS INC	12,104	147.900	1,790,181.600	
AMEREN CORPORATION	18,400	96.500	1,775,600.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	62,066	300.380	18,643,385.080	
APPLOVIN CORP CLASS A	15,800	416.520	6,581,016.000	
TOAST INC CLASS A	30,300	41.840	1,267,752.000	

VERISIGN INC	5,800	274.490	1,592,042.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	53,400	14.010	748,134.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	49,900	72.270	3,606,273.000	
VALERO ENERGY CORP	21,342	126.540	2,700,616.680	
ULTA BEAUTY INC	3,100	465.640	1,443,484.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17,788	54.110	962,508.680	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,930	188.650	741,394.500	
ELEVANCE HEALTH INC	15,400	380.070	5,853,078.000	
WALT DISNEY CO/THE	122,562	113.490	13,909,561.380	
WELLS FARGO & CO	221,022	75.380	16,660,638.360	
WASTE MANAGEMENT INC	27,300	238.890	6,521,697.000	
WILLIAMS COS INC	82,800	60.120	4,977,936.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	36,100	49.340	1,781,174.000	
WALMART INC	298,800	99.350	29,685,780.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,500	91.460	1,234,710.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	166,100	5.020	833,822.000	
WABTEC CORP	11,611	203.940	2,367,947.340	
TJX COMPANIES INC	75,700	128.070	9,694,899.000	
WATERS CORP	4,100	353.150	1,447,915.000	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	5,700	81.620	465,234.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,500	291.030	1,018,605.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,763	309.430	2,092,675.090	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,400	159.970	1,343,748.000	
WESTERN DIGITAL CORP	23,500	54.430	1,279,105.000	
WEC ENERGY GROUP INC	21,700	105.730	2,294,341.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,800	80.390	2,717,182.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	116,850	368.000	43,000,800.000	
PPL CORP	50,100	34.170	1,711,917.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	21,324	299.540	6,387,390.960	
PULTEGROUP INC	13,650	101.870	1,390,525.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	159,353	9.790	1,560,065.870	
PPG INDUSTRIES INC	15,500	111.930	1,734,915.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,200	106.100	1,400,520.000	
NVIDIA CORP	1,655,100	141.920	234,891,792.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,813	174.860	4,688,521.180	

DRAFTKINGS INC CLASS A	30,600	34.840	1,066,104.000	
TYSON FOODS INC-CL A	19,400	55.620	1,079,028.000	
NETFLIX INC	28,990	1,239.660	35,937,743.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,600	403.660	10,333,696.000	
NRG ENERGY INC	13,850	156.970	2,174,034.500	
TEXTRON INC	12,400	74.490	923,676.000	
NEWS CORP - CLASS A	25,187	27.850	701,457.950	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,102.530	1,488,415.500	
OMNICOM GROUP	13,300	71.210	947,093.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,320	125.600	1,044,992.000	
ORACLE CORP	114,033	168.100	19,168,947.300	
MASTERCARD INC - A	55,200	584.130	32,243,976.000	
ONEOK INC	42,400	80.520	3,414,048.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,300	568.010	4,146,473.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,600	56.120	370,392.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	13,900	169.010	2,349,239.000	
EXPAND ENERGY CORP	14,200	116.200	1,650,040.000	
YUM! BRANDS INC	18,900	144.010	2,721,789.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,000	229.180	2,750,160.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,000	52.770	633,240.000	
BANK OF AMERICA CORP	490,401	44.360	21,754,188.360	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,200	498.110	1,593,952.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,000	56.110	729,430.000	
AMERICAN EXPRESS CO	38,000	295.930	11,245,340.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	31,035	71.130	2,207,519.550	
LINDE PLC	32,046	473.770	15,182,433.420	
ANALOG DEVICES INC	33,691	218.500	7,361,483.500	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	25,100	21.400	537,140.000	
MONDAYCOM LTD	2,900	305.190	885,051.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	110,127	118.580	13,058,859.660	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	32.550	559,860.000	
NATERA INC	8,700	167.220	1,454,814.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	14,400	97.450	1,403,280.000	
KENVUE INC	130,100	21.680	2,820,568.000	
VERALTO CORP	16,816	98.920	1,663,438.720	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	39,472	85.010	3,355,514.720	
BUNGE GLOBAL LTD	9,200	74.590	686,228.000	

VERTIV HOLDINGS CLASS A	24,600	112.850	2,776,110.000	
NUTANIX INC CLASS A	17,200	77.140	1,326,808.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,400	265.640	4,622,136.000	
AVERY DENNISON CORP	5,430	178.730	970,503.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	33,600	79.740	2,679,264.000	
EMERSON ELECTRIC CO	38,200	121.610	4,645,502.000	
AON PLC-CLASS A	13,200	372.620	4,918,584.000	
AMGEN INC	36,500	287.010	10,475,865.000	
SAMSARA INC CLASS A	19,400	46.730	906,562.000	
EATON CORP PLC	26,536	327.080	8,679,394.880	
COOPER INC	13,600	67.420	916,912.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,100	176.970	1,964,367.000	
APPLIED MATERIALS INC	55,100	161.930	8,922,343.000	
CME GROUP INC	24,500	277.880	6,808,060.000	
ECOLAB INC	17,300	267.040	4,619,792.000	
EQUIFAX INC	8,500	267.000	2,269,500.000	
GILEAD SCIENCES INC	84,500	109.020	9,212,190.000	
KEURIG DR PEPPER INC	87,700	32.800	2,876,560.000	
HORMEL FOODS CORP	20,100	30.700	617,070.000	
STATE STREET CORP	19,513	96.000	1,873,248.000	
SOLVENTUM CORP	9,972	75.140	749,296.080	
GE VERNOVA	18,526	488.130	9,043,096.380	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,040	87.480	10,238,659.200	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	46,000	90.880	4,180,480.000	
LABCORP HOLDINGS	5,700	254.370	1,449,909.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,800	29.970	1,042,956.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	35,400	42.590	1,507,686.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,500	216.150	2,918,025.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,000	244.080	2,928,960.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	12,900	34.280	442,212.000	
CROWN HOLDINGS INC	7,980	97.360	776,932.800	
REDDIT INC CLASS A	4,600	118.210	543,766.000	
TE CONNECTIVITY LTD	20,295	162.070	3,289,210.650	
BLACKROCK INC	10,000	988.970	9,889,700.000	
CARDINAL HEALTH INC	16,400	154.070	2,526,748.000	
APTIV HOLDINGS LTD	15,600	65.880	1,027,728.000	
FEDEX CORP	15,500	218.890	3,392,795.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,974	192.860	8,480,825.640	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,413	77.470	1,348,985.110	

INTEL CORP	295,600	20.250	5,985,900.000	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	19,250	127.940	2,462,845.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,900	246.510	4,659,039.000	
ILLUMINA INC	10,800	83.160	898,128.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	24,300	557.950	13,558,185.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,150	230.910	1,420,096.500	
SNAP-ON INC	3,600	320.090	1,152,324.000	
DUKE ENERGY CORP	52,728	115.980	6,115,393.440	
TARGET CORP	30,900	93.940	2,902,746.000	
DOVER CORP	9,300	177.660	1,652,238.000	
WW GRAINGER INC	3,200	1,075.960	3,443,072.000	
JABIL INC	7,300	171.970	1,255,381.000	
CINTAS CORP	24,700	227.370	5,616,039.000	
CONAGRA BRANDS INC	32,400	22.500	729,000.000	
CLOROX COMPANY	8,300	129.650	1,076,095.000	
ENTERGY CORP	29,400	81.890	2,407,566.000	
MICROSOFT CORP	478,600	463.870	222,008,182.000	
INCYTE CORP	11,200	67.420	755,104.000	
CVS HEALTH CORP	85,569	63.570	5,439,621.330	
MEDTRONIC PLC	86,998	85.600	7,447,028.800	
MICRON TECHNOLOGY INC	75,800	103.250	7,826,350.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,200	37.000	1,635,400.000	
KELLOGG CO	18,800	81.910	1,539,908.000	
KEYCORP	63,200	15.900	1,004,880.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	87,711	66.630	5,844,183.930	
CHUBB LTD	25,799	291.780	7,527,632.220	
ALLSTATE CORP	18,000	206.790	3,722,220.000	
EBAY INC	31,600	77.100	2,436,360.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	63,750	72.800	4,641,000.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,900	68.830	1,094,397.000	
TRIMBLE INC	16,700	71.670	1,196,889.000	
LENNAR CORP-A	15,900	110.230	1,752,657.000	
PROGRESSIVE CORP	39,800	282.170	11,230,366.000	
PACCAR INC	35,655	92.590	3,301,296.450	
BIOGEN INC	10,000	131.860	1,318,600.000	
IDEXX LABORATORIES INC	5,500	524.860	2,886,730.000	
STARBUCKS CORP	77,000	88.110	6,784,470.000	
PTC INC	8,200	168.170	1,378,994.000	
EVERSOURCE ENERGY	24,900	64.660	1,610,034.000	

	INTUIT INC	18,980	766.810	14,554,053.800	
	BEST BUY CO INC	13,550	69.670	944,028.500	
	BALL CORP	18,204	53.240	969,180.960	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,297	102.430	10,273,421.710	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,800	148.460	2,494,128.000	
	VULCAN MATERIALS CO	9,000	266.080	2,394,720.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,500	445.850	7,802,375.000	
	CARNIVAL CORP	71,200	23.830	1,696,696.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	255,490	34.440	8,799,075.600	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,300	43.450	490,985.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	77,200	5.230	403,756.000	
アメリカ・ドル 小計				3,484,338,953.800 (497,319,698,877)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	397,606	24.800	9,860,628.800	
	HALEON PLC	600,757	3.990	2,397,020.430	
	WISE PLC CLASS A	43,484	10.830	470,931.720	
	VALTERRA PLATINUM LTD	8,631	27.000	233,037.000	
	BP PLC	1,063,428	3.585	3,812,921.090	
	UNILEVER PLC	166,246	46.420	7,717,139.320	
	BARCLAYS PLC	949,472	3.259	3,094,803.980	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	562,984	8.912	5,017,313.400	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	136,540	3.667	500,692.180	
	PRUDENTIAL PLC	172,851	8.570	1,481,333.070	
	NATWEST GROUP PLC	537,988	5.298	2,850,260.420	
	BAE SYSTEMS PLC	200,044	19.625	3,925,863.500	
	AVIVA PLC	177,900	6.100	1,085,190.000	
	GSK	273,284	14.940	4,082,862.960	
	INFORMA PLC	86,836	8.008	695,382.680	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	83,923	4.764	399,809.170	
	AUTO TRADER GROUP PLC	58,028	7.960	461,902.880	
	DCC PLC	6,470	46.420	300,337.400	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,807	57.600	276,883.200	
	HALMA PLC	25,182	29.420	740,854.440	
	ENTAIN PLC	39,644	7.504	297,488.570	
	JD SPORTS FASHION PLC	172,738	0.807	139,468.660	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	45,835	6.425	294,489.870	
	M&G PLC	149,120	2.401	358,037.120	
	RELX PLC	122,691	40.110	4,921,136.010	

DIAGEO PLC	147,757	20.390	3,012,765.230	
RIO TINTO PLC	74,913	43.410	3,251,973.330	
STANDARD CHARTERED PLC	134,147	11.450	1,535,983.150	
TESCO PLC	446,828	3.886	1,736,373.600	
SMITH & NEPHEW PLC	55,249	10.825	598,070.420	
GLENCORE PLC	676,969	2.885	1,953,055.560	
SMITHS GROUP PLC	22,378	22.260	498,134.280	
PEARSON PLC	39,175	10.950	428,966.250	
SAINSBURY (J) PLC	116,988	2.842	332,479.890	
NEXT PLC	7,770	128.900	1,001,553.000	
WHITBREAD PLC	11,775	28.890	340,179.750	
BUNZL PLC	21,570	22.940	494,815.800	
VODAFONE GROUP PLC	1,322,159	0.758	1,003,254.240	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,668	30.310	262,727.080	
KINGFISHER PLC	118,387	2.809	332,549.080	
WPP PLC	70,427	5.814	409,462.570	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,555	11.525	513,496.370	
SEVERN TRENT PLC	17,641	26.530	468,015.730	
RENTOKIL INITIAL PLC	164,797	3.511	578,602.260	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	45,267	50.340	2,278,740.780	
SCHRODERS PLC	50,139	3.654	183,207.900	
SSE PLC	73,530	17.420	1,280,892.600	
BARRATT REDROW PLC	90,081	4.455	401,310.850	
ASTRAZENECA PLC	103,018	107.660	11,090,917.880	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	389,969	2.546	992,861.070	
3I GROUP PLC	64,643	41.670	2,693,673.810	
ASHTEAD GROUP PLC	28,468	42.820	1,218,999.760	
SAGE GROUP PLC/THE	65,433	12.310	805,480.230	
NATIONAL GRID PLC	325,244	10.405	3,384,163.820	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,993,144	0.765	3,057,949.670	
IMPERIAL BRANDS PLC	51,754	28.430	1,471,366.220	
CENTRICA PLC	331,287	1.617	535,691.070	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	131,526	33.910	4,460,046.660	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,410	20.630	441,688.300	
HSBC HOLDINGS PLC	1,173,146	8.726	10,236,871.990	
ANGLO AMERICAN PLC	74,294	22.335	1,659,356.490	
MONDI PLC	28,810	11.975	344,999.750	
COMPASS GROUP PLC	112,708	25.790	2,906,739.320	
BT GROUP PLC	394,982	1.769	698,920.640	

	COCA-COLA HBC AG-DI	14,486	39.180	567,561.480	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,846	84.840	835,334.640	
	INTERTEK GROUP PLC	10,550	47.720	503,446.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	31,626	113.100	3,576,900.600	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,876	21.000	228,396.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	17,013	33.240	565,512.120	
	ANTOFAGASTA PLC	25,763	18.500	476,615.500	
	EXPERIAN PLC	60,939	37.220	2,268,149.580	
イギリス・ポンド 小計				133,334,040.190 (25,797,470,097)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	86,033	29.170	2,509,582.610	
	AZRIELI GROUP LTD	3,016	264.400	797,430.400	
	ICL GROUP LTD	54,223	24.400	1,323,041.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,868	1,500.000	2,802,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	87,812	57.290	5,030,749.480	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	104,878	55.490	5,819,680.220	
	NICE LTD	4,434	605.200	2,683,456.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,881	195.800	2,130,499.800	
イスラエル・シュケル 小計				23,096,440.510 (945,559,036)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	140,138	5.070	710,499.660	
	TELSTRA GROUP LTD	254,089	4.860	1,234,872.540	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	189,249	29.640	5,609,340.360	
	SGH LTD	12,846	53.110	682,251.060	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	173,395	4.880	846,167.600	
	BHP GROUP LTD	323,392	37.950	12,272,726.400	
	SOUTH32 LTD	283,778	3.020	857,009.560	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	120,996	22.800	2,758,708.800	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	107,902	15.260	1,646,584.520	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	195,047	38.600	7,528,814.200	
	WESTPAC BANKING CORP	217,978	33.100	7,215,071.800	
	SANTOS LTD	204,063	6.590	1,344,775.170	
	RIO TINTO LTD	23,626	109.680	2,591,299.680	
	ORIGIN ENERGY LTD	108,239	10.720	1,160,322.080	
	XERO LTD	9,145	188.870	1,727,216.150	
	PRO MEDICUS LTD	3,616	283.330	1,024,521.280	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	15,021	41.410	622,019.610	
	COLES GROUP LTD	85,414	21.980	1,877,399.720	

	WISETECH GLOBAL LTD	12,856	106.510	1,369,292.560	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	87,872	21.020	1,847,069.440	
	EVOLUTION MINING LTD	140,100	9.220	1,291,722.000	
	REECE LTD	13,293	16.320	216,941.760	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	106,643	181.100	19,313,047.300	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	96,188	23.950	2,303,702.600	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	77,861	32.050	2,495,445.050	
	QANTAS AIRWAYS LTD	46,622	10.700	498,855.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	27,010	38.420	1,037,724.200	
	MACQUARIE GROUP LTD	23,045	217.240	5,006,295.800	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	35,867	63.250	2,268,587.750	
	CSL LTD	30,825	246.220	7,589,731.500	
	WESFARMERS LTD	72,296	84.600	6,116,241.600	
	COCHLEAR LTD	4,209	269.850	1,135,798.650	
	BLUESCOPE STEEL LTD	27,548	23.680	652,336.640	
	SUNCORP GROUP LTD	68,038	21.300	1,449,209.400	
	ASX LTD	12,189	73.420	894,916.380	
	COMPUTERSHARE LTD	33,110	41.250	1,365,787.500	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	148,594	8.880	1,319,514.720	
	SONIC HEALTHCARE LTD	28,670	26.600	762,622.000	
	BRAMBLES LTD	86,834	23.250	2,018,890.500	
	CARSALES.COM LTD	23,716	35.890	851,167.240	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	323,100	3.120	1,008,072.000	
	REA GROUP LTD	3,320	240.760	799,323.200	
オーストラリア・ドル 小計				115,321,895.380 (10,701,871,892)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	47,800	72.980	3,488,444.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	26,181	77.430	2,027,194.830	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	8,500	40.360	343,060.000	
	CELESTICA INC	7,300	163.930	1,196,689.000	
	IMPERIAL OIL LTD	11,300	99.030	1,119,039.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,300	4,964.680	6,454,084.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	19,687	97.890	1,927,160.430	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28,600	126.990	3,631,914.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,250	310.200	3,489,750.000	
	BCE INC	4,130	30.080	124,230.400	

FRANCO-NEVADA CORP	12,200	242.610	2,959,842.000	
SUNCOR ENERGY INC	77,830	49.710	3,868,929.300	
METRO INC/CN	13,200	105.420	1,391,544.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	24,600	134.390	3,305,994.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	78,500	73.130	5,740,705.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59,200	92.920	5,500,864.000	
TORONTO-DOMINION BANK	110,300	95.220	10,502,766.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	17,300	51.320	887,836.000	
ROYAL BANK OF CANADA	89,150	174.250	15,534,387.500	
TOURMALINE OIL CORP	22,400	62.930	1,409,632.000	
TC ENERGY CORP	65,450	70.270	4,599,171.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	36,629	51.700	1,893,719.300	
BARRICK MINING CORP	108,300	27.570	2,985,831.000	
CAE INC	19,100	35.690	681,679.000	
THOMSON REUTERS CORP	9,941	267.730	2,661,503.930	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,100	51.620	418,122.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,400	102.060	347,004.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,150	78.430	717,634.500	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	25,000	32.470	811,750.000	
HYDRO ONE LTD	20,800	49.700	1,033,760.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,460	225.260	2,130,959.600	
STANTEC INC	7,100	144.520	1,026,092.000	
WSP GLOBAL INC	8,300	277.270	2,301,341.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,200	118.960	618,592.000	
QUEBECOR INC -CL B	9,800	39.570	387,786.000	
EMERA INC	18,800	61.840	1,162,592.000	
TFI INTERNATIONAL INC	5,000	119.500	597,500.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,300	38.050	315,815.000	
WHITECAP RESOURCES INC	76,600	8.650	662,590.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,900	36.730	841,117.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	45,700	10.630	485,791.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	31,717	169.260	5,368,419.420	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	29,500	37.090	1,094,155.000	
KINROSS GOLD CORP	77,500	21.200	1,643,000.000	
BANK OF MONTREAL	45,600	148.120	6,754,272.000	
POWER CORP OF CANADA	35,200	52.150	1,835,680.000	
LUNDIN GOLD INC	7,600	68.500	520,600.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	76,700	141.710	10,869,157.000	
NUTRIEN LTD	30,819	82.520	2,543,183.880	

	CAMECO CORP	27,500	82.010	2,255,275.000	
	FIRSTSERVICE CORP	2,600	241.220	627,172.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,200	67.540	891,528.000	
	TELUS CORP	10,800	22.430	242,244.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,300	50.990	1,494,007.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,300	174.680	576,444.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	132,100	42.310	5,589,151.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	2,303.820	2,994,966.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	16,600	49.590	823,194.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,737	269.310	1,006,411.470	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,400	36.410	815,584.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,300	158.090	837,877.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	36,100	88.680	3,201,348.000	
	ENBRIDGE INC	137,200	63.890	8,765,708.000	
	BROOKFIELD CORP	85,825	79.210	6,798,198.250	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	108,500	43.730	4,744,705.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	58,620	112.220	6,578,336.400	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,800	139.670	810,086.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,200	65.450	602,140.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,650	145.150	4,884,297.500	
	CGI INC - CLASS A	12,600	147.540	1,859,004.000	
	IGM FINANCIAL INC	5,200	44.420	230,984.000	
	TMX GROUP LTD	17,600	55.830	982,608.000	
	OPEN TEXT CORP	16,300	38.930	634,559.000	
	SAPUTO INC	15,900	26.420	420,078.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,800	21.030	921,114.000	
	FORTIS INC	31,600	65.910	2,082,756.000	
	RB GLOBAL INC	11,700	142.690	1,669,473.000	
	LUNDIN MINING CORP	43,300	14.040	607,932.000	
	CENOVUS ENERGY INC	86,100	17.790	1,531,719.000	
	DOLLARAMA INC	17,500	176.890	3,095,575.000	
	ALTAGAS LTD	18,400	38.430	707,112.000	
	KEYERA CORP	14,200	41.920	595,264.000	
	ARC RESOURCES LTD	36,500	29.160	1,064,340.000	
カナダ・ドル 小計				203,154,074.210 (21,209,285,347)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	164,800	2.530	416,944.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	88,400	35.300	3,120,520.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	149,040	45.010	6,708,290.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	104,175	7.160	745,893.000	
	KEPPEL CORP LTD	101,900	6.830	695,977.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	180,800	2.210	399,568.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	237,000	16.230	3,846,510.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	423,100	0.680	287,708.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	519,950	3.890	2,022,605.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	109,300	7.990	873,307.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,600	6.520	408,152.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	60,000	13.960	837,600.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	134,500	3.050	410,225.000	
シンガポール・ドル 小計				20,773,299.900 (2,306,459,488)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	26,616	42.450	1,129,849.200	
	GALDERMA GROUP N AG	6,955	112.500	782,437.500	
	AVOLTA AG	5,644	44.760	252,625.440	
	UBS GROUP AG-REG	209,664	26.960	5,652,541.440	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,003	286.000	572,858.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	438	614.500	269,151.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	44,776	267.200	11,964,147.200	
	SIKA AG-REG	9,748	218.700	2,131,887.600	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	129,400.000	905,800.000	
	ABB LTD-REG	100,886	47.220	4,763,836.920	
	SWISS RE AG	19,275	143.650	2,768,853.750	
	NESTLE SA-REG	167,093	87.130	14,558,813.090	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,423	1,086.000	1,545,378.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,549	295.200	752,464.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,899	52.500	677,197.500	
	SGS SA-REG	10,295	85.320	878,369.400	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,471	286.500	421,441.500	
	TEMENOS AG - REG	3,532	62.000	218,984.000	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,328	191.800	446,510.400	
	VAT GROUP AG	1,698	321.900	546,586.200	
	BKW AG	1,374	172.600	237,152.400	
	ALCON INC	31,875	70.320	2,241,450.000	
	SIG GROUP N AG	19,184	16.660	319,605.440	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,820	140.950	256,529.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,363	581.600	5,445,520.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	191.800	503,283.200	

	NOVARTIS AG-REG	121,137	96.040	11,633,997.480	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	852.500	180,730.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	34,254	154.200	5,281,966.800	
	SWISSCOM AG-REG	1,621	567.000	919,107.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,896	93.450	177,181.200	
	GEBERIT AG-REG	2,087	628.200	1,311,053.400	
	GIVAUDAN-REG	582	4,224.000	2,458,368.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,982	106.500	743,583.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,272	254.300	832,069.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,727	68.900	670,190.300	
	LONZA GROUP AG-REG	4,626	562.000	2,599,812.000	
	HOLCIM LTD	33,222	91.640	3,044,464.080	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,805	824.200	1,487,681.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,118	185.900	579,636.200	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,148	115.500	594,594.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	13,200.000	778,800.000	
スイス・フラン 小計				93,536,507.840 (16,319,314,523)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	15,363	209.600	3,220,084.800	
	ERICSSON LM-B SHS	194,367	82.920	16,116,911.640	
	VOLVO AB-B SHS	111,147	260.800	28,987,137.600	
	SKF AB-B SHARES	23,823	212.100	5,052,858.300	
	TELE2 AB-B SHS	38,341	143.500	5,501,933.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,995	163.200	18,114,384.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	102,045	128.450	13,107,680.250	
	SWEDBANK AB - A SHARES	59,384	256.000	15,202,304.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	39,631	137.000	5,429,447.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	42,503	124.800	5,304,374.400	
	SKANSKA AB-B SHS	23,765	231.000	5,489,715.000	
	SANDVIK AB	74,595	213.000	15,888,735.000	
	INVESTOR AB-B SHS	121,108	283.000	34,273,564.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	187,909	157.400	29,576,876.600	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,377	390.000	2,097,030.000	
	SECURITAS AB-B SHS	34,394	142.800	4,911,463.200	
	TELIA CO AB	165,046	37.010	6,108,352.460	
	ALFA LAVAL AB	20,196	413.500	8,351,046.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	109,221	137.750	15,045,192.750	
	ASSA ABLOY AB-B	70,124	305.200	21,401,844.800	

	TRELLEBORG AB-B SHS	14,114	351.300	4,958,248.200	
	SAAB AB-B	22,379	487.250	10,904,167.750	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,345	349.000	2,912,405.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	50,255	66.980	3,366,079.900	
	INDUTRADE AB	19,117	264.400	5,054,534.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,673	304.400	4,162,061.200	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,314	491.600	2,612,362.400	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,335	254.800	2,633,358.000	
	LIFCO AB-B SHS	16,328	399.600	6,524,668.800	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	106,077	39.570	4,197,466.890	
	BEIJER REF AB	26,893	147.250	3,959,994.250	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	42,104	275.900	11,616,493.600	
	BOLIDEN AB	19,894	306.700	6,101,489.800	
	EPIROC AB-A	46,115	216.300	9,974,674.500	
	EPIROC AB-B	27,287	189.300	5,165,429.100	
	EQT AB	26,064	277.700	7,237,972.800	
	EVOLUTION AB	10,373	652.800	6,771,494.400	
	HEXAGON AB-B SHS	145,259	97.560	14,171,468.040	
	ADDTECH AB-B SHARES	18,173	335.800	6,102,493.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	348.500	3,784,361.500	
スウェーデン・クローナ 小計				381,392,159.630 (5,682,743,179)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	225,287	476.700	107,394,312.900	
	DANSKE BANK A/S	48,242	257.000	12,398,194.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	207	11,840.000	2,450,880.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	70,628	106.200	7,500,693.600	
	CARLSBERG AS-B	6,814	954.800	6,506,007.200	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	24,648	472.100	11,636,320.800	
	COLOPLAST-B	8,851	628.600	5,563,738.600	
	DSV PANALPINA A/S	14,276	1,562.000	22,299,112.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	7,990	302.900	2,420,171.000	
	DEMANT A/S	6,239	254.800	1,589,697.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	401	11,970.000	4,799,970.000	
	TRYG A/S	23,759	168.300	3,998,639.700	
	PANDORA A/S	5,758	1,219.500	7,021,881.000	
	GENMAB A/S	4,467	1,438.500	6,425,779.500	
	ORSTED A/S	11,806	266.800	3,149,840.800	

デンマーク・クローネ 小計				205,155,238.300 (4,484,693,509)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	91,451	5.750	525,843.250	
	INFRATIL LTD	64,300	10.500	675,150.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,067	7.720	911,477.240	
	CONTACT ENERGY LTD	56,210	9.210	517,694.100	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	40,994	37.060	1,519,237.640	
ニュージーランド・ドル 小計				4,149,402.230 (357,595,484)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	62,650	274.900	17,222,485.000	
	NORSK HYDRO ASA	98,439	54.320	5,347,206.480	
	ORKLA ASA	49,132	114.700	5,635,440.400	
	TELENOR ASA	43,057	155.000	6,673,835.000	
	EQUINOR ASA	59,779	247.900	14,819,214.100	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,626	372.100	4,326,034.600	
	MOWI ASA	32,574	187.200	6,097,852.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,018	258.000	3,616,644.000	
	AKER BP ASA	22,064	247.600	5,463,046.400	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	30,645	365.650	11,205,344.250	
	SALMAR ASA	4,713	452.600	2,133,103.800	
ノルウェー・クローネ 小計				82,540,206.830 (1,166,293,122)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	73,957	27.430	2,028,640.510	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,525	37.440	1,180,296.000	
	EXOR NV	5,778	83.750	483,907.500	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,428	41.890	311,158.920	
	DSM FIRMENICH AG	12,323	97.700	1,203,957.100	
	FERROVIAL	34,020	44.650	1,518,993.000	
	LOTUS BAKERIES NV	25	9,060.000	226,500.000	
	SYENSQO SA	4,807	68.740	330,433.180	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	13,810	16.330	225,517.300	
	COVESTRO V AG	11,566	60.500	699,743.000	
	BAYER AG-REG	65,129	25.320	1,649,066.280	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,731	19.060	318,892.860	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	122,803	24.040	2,952,184.120	
	COMMERZBANK AG	58,682	27.010	1,585,000.820	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,642	93.400	1,274,162.800	

SIEMENS AG-REG	50,438	218.050	10,998,005.900	
E.ON SE	148,932	15.530	2,312,913.960	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,201	77.240	1,483,085.240	
GEA GROUP AG	9,711	59.750	580,232.250	
CONTINENTAL AG	7,171	76.120	545,856.520	
BASF SE	59,170	42.090	2,490,465.300	
ALLIANZ SE-REG	25,658	352.900	9,054,708.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,235	70.480	791,842.800	
RHEINMETALL AG	2,941	1,833.000	5,390,853.000	
RWE AG	41,911	33.380	1,398,989.180	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	39,785	7.306	290,669.210	
BRENNTAG SE	7,967	60.120	478,976.040	
FRESENIUS SE & CO KGAA	28,027	43.860	1,229,264.220	
SAP SE	69,258	271.300	18,789,695.400	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,824	577.200	5,093,212.800	
ZALANDO SE	14,625	30.760	449,865.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	8,907	174.550	1,554,716.850	
RATIONAL AG	336	735.000	246,960.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,070	108.600	442,002.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,707	204.200	348,569.400	
TALANX AG	4,211	115.400	485,949.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,997	34.320	343,097.040	
DELIVERY HERO SE	12,282	23.850	292,925.700	
NEMETSCHEK SE	3,764	124.200	467,488.800	
SCOUT24 AG	4,899	120.400	589,839.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	22,677	46.110	1,045,636.470	
KNORR-BREMSE AG	4,732	88.900	420,674.800	
SIEMENS ENERGY AG	45,182	88.520	3,999,510.640	
BEIERSDORF AG	6,464	118.950	768,892.800	
MERCK KGAA	8,427	116.300	980,060.100	
ADIDAS AG	11,372	214.100	2,434,745.200	
HENKEL AG & CO KGAA	6,771	64.450	436,390.950	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	231,501	33.680	7,796,953.680	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	14,685	49.820	731,606.700	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,936	51.540	2,470,621.440	
QIAGEN N.V.	14,061	40.325	567,009.820	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	86,624	35.805	3,101,572.320	
HANNOVER RUECK SE	4,030	280.200	1,129,206.000	
DHL GROUP	63,695	40.360	2,570,730.200	

DEUTSCHE BOERSE AG	12,475	282.200	3,520,445.000	
MTU AERO ENGINES AG	3,613	356.800	1,289,118.400	
SYMRISE AG	8,658	106.550	922,509.900	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,705	72.550	268,797.750	
VONOVIA SE	49,069	29.230	1,434,286.870	
LEG IMMOBILIEN SE	4,856	74.150	360,072.400	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	55,277	20.180	1,115,489.860	
NN GROUP NV	17,832	56.560	1,008,577.920	
ARCELORMITTAL	31,074	26.740	830,918.760	
HEINEKEN NV	19,075	81.200	1,548,890.000	
AEGON LTD	87,754	6.278	550,919.610	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	60,471	36.600	2,213,238.600	
AKZO NOBEL N.V.	11,137	59.180	659,087.660	
WOLTERS KLUWER	15,849	156.200	2,475,613.800	
ING GROEP NV	208,773	18.530	3,868,563.690	
KONINKLIJKE KPN NV	257,935	4.186	1,079,715.910	
ASML HOLDING NV	26,150	652.400	17,060,260.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,855	22.780	680,096.900	
IMCD NV	3,862	117.650	454,364.300	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	5,313	107.950	573,538.350	
ASR NEDERLAND NV	9,732	55.880	543,824.160	
ADYEN NV	1,638	1,682.800	2,756,426.400	
PROSUS NV	86,578	46.965	4,066,135.770	
JDE PEET'S NV	11,285	24.120	272,194.200	
INPOST SA	14,300	14.340	205,062.000	
ASM INTERNATIONAL NV	3,154	490.000	1,545,460.000	
RANDSTAD NV	7,252	36.860	267,308.720	
HEINEKEN HOLDING NV	8,448	70.500	595,584.000	
TOTALENERGIES SE	135,045	52.270	7,058,802.150	
MICHELIN (CGDE)	44,504	32.390	1,441,484.560	
AIR LIQUIDE SA	38,395	184.300	7,076,198.500	
KERING	4,955	176.000	872,080.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	36,239	225.050	8,155,586.950	
BOUYGUES SA	12,369	37.930	469,156.170	
BNP PARIBAS	67,533	76.640	5,175,729.120	
THALES SA	6,139	267.800	1,644,024.200	
DANONE	42,772	74.380	3,181,381.360	
CARREFOUR SA	35,355	12.935	457,316.920	
L'OREAL	15,978	384.850	6,149,133.300	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,764	100.500	2,991,282.000	
LEGRAND SA	17,390	107.700	1,872,903.000	
PERNOD RICARD SA	13,353	92.880	1,240,226.640	
EURAZEO SE	2,599	60.400	156,979.600	
REXEL SA	14,843	24.950	370,332.850	
SOCIETE GENERALE SA	47,751	47.810	2,282,975.310	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,240	476.650	8,694,096.000	
ACCOR SA	13,005	45.750	594,978.750	
CAPGEMINI SE	10,845	147.250	1,596,926.250	
PUBLICIS GROUPE	15,216	93.860	1,428,173.760	
BUREAU VERITAS SA	20,709	30.260	626,654.340	
EIFFAGE	4,559	121.050	551,866.950	
SODEXO SA	5,916	57.700	341,353.200	
IPSEN	2,461	104.500	257,174.500	
AMUNDI SA	4,052	73.850	299,240.200	
TELEPERFORMANCE	3,431	88.720	304,398.320	
EURONEXT NV	5,201	145.600	757,265.600	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,815	57.460	449,049.900	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,910	193.700	369,967.000	
ESSILORLUXOTTICA	19,689	243.900	4,802,147.100	
DASSAULT AVIATION SA	1,289	316.400	407,839.600	
FDJ UNITED	7,358	31.680	233,101.440	
AXA SA	117,536	42.350	4,977,649.600	
EDENRED	15,773	26.850	423,505.050	
RENAULT SA	12,530	43.730	547,936.900	
HERMES INTERNATIONAL	2,061	2,382.000	4,909,302.000	
STMICROELECTRONICS NV	44,912	24.920	1,119,207.040	
DASSAULT SYSTEMES SE	44,423	32.950	1,463,737.850	
ORANGE	123,469	12.730	1,571,760.370	
ALSTOM	22,563	19.540	440,881.020	
SANOFI	73,577	87.120	6,410,028.240	
VINCI SA	32,817	127.250	4,175,963.250	
AIRBUS SE	39,426	170.180	6,709,516.680	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	41,461	30.240	1,253,780.640	
CREDIT AGRICOLE SA	70,174	16.105	1,130,152.270	
BIOMERIEUX	2,702	118.300	319,646.600	
ENGIE	121,144	18.935	2,293,861.640	
SAFRAN SA	23,850	265.500	6,332,175.000	
ARKEMA	3,724	61.300	228,281.200	

ADP	2,262	114.200	258,320.400	
GETLINK SE	20,144	16.320	328,750.080	
BOLLORE	46,528	5.460	254,042.880	
UCB SA	8,339	161.450	1,346,331.550	
KBC GROUP NV	15,265	86.360	1,318,285.400	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,411	72.650	393,109.150	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,875	62.780	4,135,632.500	
AGEAS	9,768	56.050	547,496.400	
D'IETEREN GROUP	1,402	178.900	250,817.800	
ELIA GROUP SA/NV	3,400	94.400	320,960.000	
SOFINA	1,011	254.400	257,198.400	
ARGENX SE	4,039	508.000	2,051,812.000	
PRYSMIAN SPA	18,610	58.840	1,095,012.400	
GENERALI	56,994	31.890	1,817,538.660	
MEDIOBANCA SPA	32,588	19.565	637,584.220	
TENARIS SA	26,963	15.210	410,107.230	
UNICREDIT SPA	92,982	56.550	5,258,132.100	
UNIPOL GRUPPO SPA	23,180	17.130	397,073.400	
TELECOM ITALIA SPA	716,514	0.379	271,773.760	
INTESA SANPAOLO	1,003,568	4.868	4,885,870.800	
POSTE ITALIANE SPA	29,833	18.845	562,202.880	
MONCLER SPA	15,521	54.960	853,034.160	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	7,629	52.600	401,285.400	
ENI SPA	146,354	13.178	1,928,653.010	
BPER BANCA	64,630	7.668	495,582.840	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	38,820	5.910	229,426.200	
BANCO BPM SPA	83,944	10.140	851,192.160	
DIASORIN SPA	1,344	90.940	122,223.360	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	18,401	10.340	190,266.340	
NEXI SPA	32,152	5.294	170,212.680	
BANCA MEDIOLANUM SPA	15,600	14.510	226,356.000	
LEONARDO SPA	26,885	53.140	1,428,668.900	
ENEL SPA	539,416	8.077	4,356,863.030	
SNAM SPA	131,435	5.252	690,296.620	
TERNA SPA	93,311	8.944	834,573.580	
FINECOBANK SPA	40,524	18.980	769,145.520	
STELLANTIS NV	132,358	8.678	1,148,602.720	
FERRARI NV	8,316	420.800	3,499,372.800	
TELEFONICA SA	243,404	4.661	1,134,506.040	

ENDESA SA	20,725	27.010	559,782.250	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	382,244	13.120	5,015,041.280	
IBERDROLA SA	384,318	15.925	6,120,264.150	
BANCO DE SABADELL SA	354,585	2.767	981,136.690	
BANKINTER SA	47,200	11.155	526,516.000	
REPSOL SA	76,779	11.930	915,973.470	
GRIFOLS SA	18,913	10.080	190,643.040	
BANCO SANTANDER SA	1,004,985	6.950	6,984,645.750	
AMADEUS IT GROUP SA	29,859	73.900	2,206,580.100	
CAIXABANK SA	261,770	7.388	1,933,956.760	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	87,000	3.990	347,130.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,617	57.750	670,881.750	
AENA SME SA	4,988	240.200	1,198,117.600	
CELLNEX TELECOM SA	32,639	34.060	1,111,684.340	
ACCIONA SA	1,612	150.700	242,928.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	72,301	47.420	3,428,513.420	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	26,487	18.140	480,474.180	
UPM-KYMMENE OYJ	35,388	23.920	846,480.960	
NOKIA OYJ	354,278	4.743	1,680,340.550	
WARTSILA OYJ ABP	32,783	18.225	597,470.170	
STORA ENSO OYJ-R SHS	38,002	8.692	330,313.380	
ELISA OYJ	9,284	47.840	444,146.560	
SAMPO OYJ-A SHS	160,775	9.364	1,505,497.100	
FORTUM OYJ	29,279	15.595	456,606.000	
KESKO OYJ-B SHS	18,150	20.860	378,609.000	
KONE OYJ-B	22,553	54.820	1,236,355.460	
NESTE OYJ	27,615	9.548	263,668.020	
ORION OYJ-CLASS B	7,066	61.500	434,559.000	
METSO CORPORATION	40,573	10.910	442,651.430	
NORDEA BANK ABP	208,352	12.755	2,657,529.760	
VERBUND AG	4,439	67.650	300,298.350	
OMV AG	9,614	42.760	411,094.640	
ERSTE GROUP BANK AG	20,378	70.800	1,442,762.400	
RYANAIR HOLDINGS PLC	59,500	23.740	1,412,530.000	
AIB GROUP PLC	137,275	6.815	935,529.120	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	65,450	11.975	783,763.750	
KINGSPAN GROUP PLC	10,273	74.100	761,229.300	
JERONIMO MARTINS	18,484	21.400	395,557.600	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	208,130	3.580	745,105.400	

	GALP ENERGIA SGPS SA	27,055	14.500	392,297.500	
	EDP RENOVAVEIS SA	20,383	9.255	188,644.660	
	KERRY GROUP PLC-A	11,056	95.500	1,055,848.000	
ユーロ 小計				378,517,430.800 (61,736,192,964)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	97,000	51.250	4,971,250.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	154,000	33.450	5,151,300.000	
	MTR CORP	109,000	27.300	2,975,700.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	101,500	83.800	8,505,700.000	
	SINO LAND CO	284,000	7.960	2,260,640.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	187,669	44.950	8,435,721.550	
	WHARF HOLDINGS LTD	77,000	22.300	1,717,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	29,000	66.900	1,940,100.000	
	CLP HOLDINGS LTD	115,000	66.000	7,590,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	102,507	24.550	2,516,546.850	
	HONG KONG & CHINA GAS	783,475	6.950	5,445,151.250	
	HANG SENG BANK LTD	52,700	112.800	5,944,560.000	
	WH GROUP LTD	583,500	7.290	4,253,715.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	84,300	403.000	33,972,900.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	135,169	32.250	4,359,200.250	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	45,000	51.250	2,306,250.000	
	AIA GROUP LTD	748,400	66.050	49,431,820.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	96,000	25.250	2,424,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	117,000	19.880	2,325,960.000	
	SANDS CHINA LTD	170,000	15.880	2,699,600.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	103,000	92.800	9,558,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	259,000	33.850	8,767,150.000	
香港・ドル 小計				177,552,764.900 (3,229,684,794)	
合計				651,256,862,312 [651,256,862,312]	

(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	9,737	1,992,287.570	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	22,107	3,572,933.340	
		BXP INC	10,000	712,300.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,400	1,707,550.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,200	1,601,032.000	
		EQUINIX INC	6,708	6,119,037.600	

		AMERICAN TOWER CORP	31,800	6,816,648.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	22,600	840,946.000	
		KIMCO REALTY CORP	46,100	966,256.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,700	861,883.000	
		INVITATION HOMES INC	39,500	1,312,980.000	
		VICI PROPERTIES INC	71,700	2,249,946.000	
		VENTAS INC	29,700	1,876,446.000	
		WEYERHAEUSER CO	49,214	1,293,836.060	
		CROWN CASTLE INTL CORP	29,600	2,966,808.000	
		IRON MOUNTAIN INC	20,000	2,004,200.000	
		SUN COMMUNITIES INC	8,700	1,082,889.000	
		PROLOGIS INC	62,854	6,815,259.220	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,500	740,985.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,300	858,334.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,400	1,244,144.000	
		WELLTOWER INC	44,000	6,690,200.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,400	810,540.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,000	1,214,880.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,400	784,052.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	40,600	770,994.000	
		REALTY INCOME CORP	60,495	3,382,880.400	
		PUBLIC STORAGE	10,700	3,245,203.000	
		REGENCY CENTERS CORP	11,700	838,539.000	
		UDR INC	21,400	880,182.000	
		WP CAREY INC	14,900	924,247.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,900	4,030,400.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	14,400	2,155,248.000	
	アメリカ・ドル 小計			73,364,066.190 (10,471,253,167)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,190	287,994.650	
		SEGRO PLC	83,895	582,399.090	
	イギリス・ポンド 小計			870,393.740 (168,403,781)	
	オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	198,019	2,835,632.080	
		APA GROUP	83,515	697,350.250	

		SCENTRE GROUP	326,820	1,209,234.000	
		STOCKLAND	149,947	826,207.970	
		GOODMAN GROUP	130,028	4,320,830.440	
		VICINITY CENTRES	243,623	596,876.350	
	オーストラリア・ドル 小計			10,486,131.090 (973,112,965)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	261,700	669,952.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	409,391	855,627.190	
	シンガポール・ドル 小計			1,525,579.190 (169,385,057)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,107	657,315.560	
		GECINA SA	3,108	293,239.800	
		KLEPIERRE	14,042	472,653.720	
		COVIVIO	3,649	187,193.700	
	ユーロ 小計			1,610,402.780 (262,656,693)	
	香港・ドル	LINK REIT	181,900	7,439,710.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	266,000	3,043,040.000	
	香港・ドル 小計			10,482,750.000 (190,681,222)	
投資証券 合計				12,235,492,885 [12,235,492,885]	
合計				12,235,492,885 [12,235,492,885]	

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 527銘柄 投資証券 33銘柄	97.9%	2.1%	76.4%

イギリス・ポンド	株式 72銘柄 投資証券 2銘柄	99.4%	0.6%	3.9%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 42銘柄 投資証券 6銘柄	91.7%	8.3%	1.8%
カナダ・ドル	株式 83銘柄	100%	-%	3.2%
シンガポール・ドル	株式 13銘柄 投資証券 2銘柄	93.2%	6.8%	0.4%
スイス・フラン	株式 42銘柄	100%	-%	2.5%
スウェーデン・クローナ	株式 40銘柄	100%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 213銘柄 投資証券 4銘柄	99.6%	0.4%	9.3%
香港・ドル	株式 22銘柄 投資証券 2銘柄	94.4%	5.6%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月5日現在 金　額（円）	2025年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	7,388,708,426	9,384,462,221
コール・ローン	1,600,798,871	1,472,913,366
国債証券	312,613,617,028	327,953,389,953
派生商品評価勘定	558,874	673,134
未収入金	80,135,777	22,488
未収利息	2,219,625,283	2,477,857,195

前払費用	139,792,047	141,945,764
流動資産合計	324,043,236,306	341,431,264,121
資産合計	324,043,236,306	341,431,264,121
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,185,483	6,380,249
未払金	5,429,991,507	6,934,753,101
未払解約金	202,685,174	336,617,753
流動負債合計	5,653,862,164	7,277,751,103
負債合計	5,653,862,164	7,277,751,103
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	86,486,918,304	92,937,832,002
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	231,902,455,838	241,215,681,016
元本等合計	318,389,374,142	334,153,513,018
純資産合計	318,389,374,142	334,153,513,018
負債純資産合計	324,043,236,306	341,431,264,121

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6月6日 至2025年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
1.　※1 期首	2023年6月6日	2024年6月6日
期首元本額	79,326,984,057円	86,486,918,304円
期中追加設定元本額	14,012,892,396円	16,594,186,735円
期中一部解約元本額	6,852,958,149円	10,143,273,037円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	349,186,959円	277,900,961円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,950,980円	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)	32,233,766円	25,635,257円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,812,611円	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)	185,995,811円	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）	726,370,573円	963,468,837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）	585,089,705円	672,154,087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）	944,891,035円	1,019,980,273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）	4,796,062,679円	7,010,791,746円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	1,136,063,780円	1,075,859,435円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,757,072円	1,386,676円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	21,265,158円	26,012,431円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,090,049,220円	1,318,701,571円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,508,886,852円	3,070,896,604円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	588,740,057円	710,943,759円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	1,737,489円	3,700,012円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51,775,854,367円	51,000,062,618円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,176,516,654円	1,216,718,420円
ダイワ・ライフ・バランス５０	874,268,687円	973,572,761円
ダイワ・ライフ・バランス７０	710,444,873円	789,760,245円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	711,384,027円	771,418,930円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	577,596,785円	628,012,877円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	235,532,957円	300,521,510円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	35,042,588円	32,814,899円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	21,429,624円	27,157,234円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,272,208,108円	2,689,911,544円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,872,476円	5,257,912円

ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,187,275円	2,866,255円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,880,555円	36,080,777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）	1,782,890,469円	2,887,925,527円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	90,058,800円	81,645,672円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	26,110,093円	26,217,407円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,642,436,764円	2,232,779,290円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	170,383,732円	146,975,221円
スタイル9（4資産分散・保守型）	81,098円	316,064円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	1,050,847円	3,763,751円
スタイル9（4資産分散・積極型）	937,857円	3,864,668円
スタイル9（6資産分散・保守型）	26,750円	117,677円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	691,478円	3,557,478円
スタイル9（6資産分散・積極型）	263,119円	1,604,058円
スタイル9（8資産分散・保守型）	35,928円	177,698円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	702,717円	2,258,783円
スタイル9（8資産分散・積極型）	749,639円	2,370,724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	2,755,221円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	139,510,747円	117,376,578円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,462,017円	67,481,829円

	ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	3,199,624,709円	6,337,156,767円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,871,250,340円	6,103,436,366円
	ダイワライフスタイル２５	25,543,259円	24,355,771円
	ダイワライフスタイル５０	59,503,241円	58,064,245円
	ダイワライフスタイル７５	17,291,977円	17,215,750円
	計	86,486,918,304円	92,937,832,002円
2.	期末日における受益権の総数	86,486,918,304口	92,937,832,002口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月6日 至2025年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月5日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,019,869,309	△2,579,686,985
合計	2,019,869,309	△2,579,686,985

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年6月5日現在				2025年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	83,768,730	-	83,209,960	558,770	52,836,879	-	52,375,964	460,915
アメリカ・ドル	-	-	-	-	52,836,879	-	52,375,964	460,915
イスラエル・シュケル	76,245,257	-	75,758,768	486,489	-	-	-	-

デンマーク・クローネ	7,523,473	-	7,451,192	72,281	-	-	-	-
買建	1,566,274,930	-	1,545,089,551	△21,185,379	1,172,485,879	-	1,166,317,849	△6,168,030
アメリカ・ドル	409,543,320	-	405,798,750	△3,744,570	-	-	-	-
イギリス・ポンド	-	-	-	-	33,547,809	-	33,548,940	1,131
イスラエル・シュケル	-	-	-	-	44,810,036	-	44,757,051	△52,985
オフショア・人民元	710,597,903	-	703,955,385	△6,642,518	661,843,970	-	657,942,058	△3,901,912
カナダ・ドル	156,594,702	-	154,254,760	△2,339,942	218,346,621	-	217,215,300	△1,131,321
シンガポール・ドル	51,914,150	-	51,497,600	△416,550	29,822,378	-	29,604,960	△217,418
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	17,962,692	-	17,814,260	△148,432
ニュージーランド・ドル	15,374,640	-	15,291,200	△83,440	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	12,131,042	-	11,925,100	△205,942	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	148,292,739	-	140,545,606	△7,747,133	-	-	-	-
ユーロ	61,826,434	-	61,821,150	△5,284	166,152,373	-	165,435,280	△717,093
合計	1,650,043,660	-	1,628,299,511	△20,626,609	1,225,322,758	-	1,218,693,813	△5,707,115

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
1口当たり純資産額	3.6814円	3.5955円
（1万口当たり純資産額）	(36,814円)	(35,955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	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	746,803.880	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	770,287.500	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	787,463.460	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,554,711.770	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,976,000.000	3,022,723.200	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	890,408.750	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	540,656.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	519,036.330	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	933,809.310	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,077,112.850	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,042,319.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,170,856.500	

4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,003,283.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,178,000.000	1,137,088.060	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	989,569.730	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,388,821.980	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,253,310.300	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,305,008.250	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,340,527.390	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,171,034.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,305,752.190	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,063,999.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	3,942,447.770	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,222,174.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,080,684.840	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,745,124.180	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,725,729.120	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,791,283.180	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,630,973.280	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,074,445.360	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,496,093.820	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,079,435.960	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,063,000.000	1,427,162.770	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,935,000.000	2,209,937.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,376,205.480	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	493,426.250	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	781,845.400	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,916,760.540	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,240,700.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,788,207.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,152,978.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	724,060.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,540,446.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,731,712.150	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,220,352.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,472,640.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,701,524.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,715,710.500	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,295,895.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,745,400.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,173,089.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,189,880.000	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,833,432.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	11,500,000.000	11,193,525.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,504,226.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,339,652.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,612,680.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,347,808.400	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,318,840.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,402,330.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	2,925,667.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,686,319.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,942,250.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,735,376.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,439,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,297,257.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,353,682.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,710,736.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,424,200.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,904,000.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,890,114.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,839,635.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,932,720.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,416,600.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,488,850.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,247,475.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,533,608.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	1,300,000.000	1,239,459.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,508,896.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,796,728.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,252,376.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,900,000.000	893,437.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	3,400,000.000	2,078,828.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,275,475.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,267,635.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,754,800.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,641,950.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	2,992,430.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	3,400,000.000	2,057,850.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,250,205.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,694,200.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,321,180.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,694,360.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,000,000.000	3,097,020.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,201,219.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,621,250.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,608,950.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,457,080.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,247,950.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,162,624.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,649,400.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,185,895.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,724,760.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,000,000.000	6,986,800.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	1,500,000.000	1,394,265.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	3,982,848.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,721,370.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,565,300.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,257,352.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,627,300.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,833,050.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,717,714.000	

		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,203,266.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,724,095.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,769,120.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,580,450.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,588,250.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,803,000.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,596,850.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,359,860.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,464,400.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,596,736.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,710,200.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,528,400.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,727,630.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	5,000,000.000	4,804,950.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,171,432.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	6,500,000.000	5,965,245.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,836,640.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,900,000.000	6,867,549.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,991,432.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,134,066.000	

		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,790,700.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,655,350.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,829,350.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,841,300.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,877,700.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	6,300,000.000	5,822,271.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,455,250.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,222,500.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,891,190.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,937,690.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,000,000.000	4,791,300.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,952,300.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,903,400.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,964,180.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,976,959.800	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,674,830.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,686,176.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,654,440.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,197,510.400	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,461,075.000	

		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,394,370.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,496,875.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,521,595.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,018,330.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,685,193.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,181,112.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,010,710.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,495,750.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	3,001,680.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,248,325.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,990,300.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,501,305.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,909,250.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,636,960.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,205,025.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,610,530.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,668,106.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	7,500,000.000	7,526,175.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,012,120.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,775,214.000	

		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,679,539.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,940,810.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,981,320.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	6,300,000.000	5,944,869.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,489,184.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,200,175.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,677,430.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,486,605.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	3,000,270.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,971,920.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,516,450.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,022,150.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,528,910.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,725,990.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,021,660.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,392,150.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,160,643.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	3,005,250.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,123,064.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,047,340.000	

		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,022,020.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,545,900.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,300,044.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,008,080.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,192,180.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,173,800.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,833,250.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,264,327.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,231,905.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,166,440.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,055,830.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,066,080.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,011,780.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,998,940.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,442,940.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	8,500,000.000	8,535,785.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	996,130.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	7,000,000.000	7,004,760.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	10,200,000.000	9,991,410.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	4,012,000.000	

		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	3,947,328.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,856,420.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,642,084.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,267,132.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,028,600.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,043,050.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,009,560.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,053,000.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,546,410.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,044,920.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,566,250.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,648,960.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	6,688,500.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,383,485.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,724,992.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,034,950.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,369,759.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,565,475.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,021,840.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,525,875.000	

		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	101,328.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,222,242.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,214,070.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,332,038.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	5,016,750.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,143,525.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,983,270.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	5,300,000.000	4,761,891.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,928,720.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,624,770.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,483,800.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,945,950.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	989,820.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,470,165.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	787,136.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,241,948.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,310,484.700	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,042,250.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	9,000,000.000	8,936,010.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,225,998.000	

		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	6,100,000.000	5,722,044.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,708,892.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,811,310.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	6,000,000.000	6,023,280.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	5,500,000.000	5,548,510.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	2,400,000.000	2,315,616.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130	3,500,000.000	3,505,600.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,000,000.000	4,015,360.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	4,000,000.000	4,075,360.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,579,345.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	1,500,000.000	1,506,465.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,029,160.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	6,500,000.000	6,588,855.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	8,600,000.000	8,784,728.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215	5,500,000.000	5,556,045.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	5,600,000.000	5,366,368.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	3,500,000.000	3,431,890.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131	6,500,000.000	6,518,005.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	4,000,000.000	4,060,520.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	4,000,000.000	4,002,080.000	

		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	4,000,000.000	4,013,400.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	3,000,000.000	3,003,390.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,996,950.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	3,500,000.000	3,500,525.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	7,000,000.000	7,021,280.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415	3,000,000.000	2,992,830.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	2,500,000.000	2,493,750.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430	3,500,000.000	3,473,190.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	2,300,000.000	2,251,286.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	3,500,000.000	3,469,095.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,000,000.000	3,990,440.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	4,500,000.000	4,488,030.000	
	アメリカ・ドル 小計			1,057,024,499.350 (150,869,106,792)	
	イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	705,305.120	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,426,910.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	905,784.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,045,000.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	835,731.300	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,472,218.100	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,396,155.000	

		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	697,409.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	641,469.400	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,600,000.000	735,888.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	1,844,199.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	2,190,000.000	1,272,652.800	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,072,747.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	3,300,000.000	867,570.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	2,200,000.000	2,001,076.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	622,098.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,515,260.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,982,400.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,550,000.000	708,257.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,579,661.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	779,796.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	3,100,000.000	1,950,520.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,389,851.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	3,100,000.000	2,351,970.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	584,441.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	4,100,000.000	3,338,343.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	1,220,000.000	398,818.000	

		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,001,800.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	896,760.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,407,652.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	1,907,750.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	784,700.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,700,000.000	2,738,205.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	3,300,000.000	3,327,291.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,414,350.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	2,300,000.000	2,289,880.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,280,000.000	1,098,739.200	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	2,200,000.000	2,167,418.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,105,250.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	2,500,000.000	2,442,875.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	2,000,000.000	1,869,980.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	1,300,000.000	1,311,713.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	1,600,000.000	1,616,944.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	1,000,000.000	990,620.000	
		5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	350,000.000	351,956.500	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,015,762.150	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,440,000.000	1,439,755.200	

		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,862,000.000	1,793,199.100	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,732,015.460	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,433,626.880	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,187,859.940	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,243,802.560	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	1,962,018.680	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,376,912.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,151,045.010	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,712,220.380	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,557,160.800	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	933,905.260	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,444,453.150	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,205,283.200	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,893,444.120	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	984,614.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,360,442.880	
イギリス・ポンド 小計				96,272,935.490 (18,626,887,559)	
イスラエル・シュケル		6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,847,916.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,389,156.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,728,954.000	

		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,050,440.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,124,760.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,058,888.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,000,000.000	2,156,130.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,883,976.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	1,720,000.000	1,173,384.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,800,000.000	3,733,576.000	
		4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,500,000.000	1,442,415.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,468,450.000	
		4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831	1,600,000.000	1,618,576.000	
イスラエル・シュケル 小計				25,676,621.000 (1,051,190,594)	
オーストラリア・ドル		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,041,668.720	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,346,661.320	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,333,372.040	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,051,039.290	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	2,207,000.000	1,939,246.760	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	691,122.960	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,650,481.360	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,142,742.460	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	942,943.800	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,470,405.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,844,083.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,736,372.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,101,019.000	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,501,131.200	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,269,350.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,737,980.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	745,570.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,102,100.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,157,400.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,372,928.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,567,944.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,942,240.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,513,760.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	871,920.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,109,603.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,700,000.000	1,698,402.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	1,500,000.000	1,496,520.000	
オーストラリア・ドル 小計			42,378,006.710 (3,932,679,023)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,322,500.000	

		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,374,000.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,101,650.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,324,480.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	25,000,000.000	26,817,750.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,371,020.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	16,500,000.000	17,365,095.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	29,000,000.000	30,403,890.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,679,875.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	16,300,000.000	22,323,828.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	27,000,000.000	28,241,190.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	22,949,490.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,105,080.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,568,895.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,078,300.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,783,800.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,361,950.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,827,465.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,698,570.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	11,888,624.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	23,000,000.000	29,148,820.000	

		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	15,500,000.000	16,231,445.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	15,093,635.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,227,040.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,250,070.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	15,200,000.000	16,255,336.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,704,100.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,283,950.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,996,935.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,368,000.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,189,680.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,319,170.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	34,057,920.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,916,575.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,560,512.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	24,060,660.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,938,240.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	20,030,370.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,598,200.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,316,850.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,860,250.000	

		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,799,500.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	21,700,000.000	27,221,782.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	35,000,000.000	37,517,900.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,648,680.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,961,100.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	42,482,000.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,249,900.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,775,250.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	30,000,000.000	31,516,800.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	44,457,480.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,677,200.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,793,800.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,696,400.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,466,500.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,716,800.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,340,900.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,408,320.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	35,000,000.000	36,258,950.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,391,380.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,600,100.000	

		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,961,170.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,094,500.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,834,600.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,397,040.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,146,700.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,448,040.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,459,690.000	
		1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	9,983,200.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,009,220.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	12,985,050.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	11,000,000.000	11,302,940.000	
		1.06% CHINA GOVERNMENT BOND 20261215	5,000,000.000	4,968,350.000	
		1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	9,100,000.000	9,008,636.000	
		1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	20,000,000.000	19,915,200.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	3,971,200.000	
		1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	29,000,000.000	28,750,310.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	5,000,000.000	4,996,300.000	
		1.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315	10,000,000.000	10,021,400.000	
		1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	35,000,000.000	35,361,900.000	
		1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	7,000,000.000	6,952,260.000	

	1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	30,000,000.000	29,990,100.000	
	1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	7,000,000.000	7,002,660.000	
オフショア・人民元 小計			1,865,536,418.000 (37,104,026,925)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	955,000.000	813,946.500	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,383,000.000	1,539,223.680	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,319,802.520	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,178,686.520	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	980,927.200	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	969,110.840	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,178,378.320	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,469,000.000	1,453,531.430	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,202,353.600	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	637,819.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,738,647.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,197,271.400	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,192,043.500	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,755,880.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	294,216.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,128,068.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,811,036.500	

		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,150,302.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,700,000.000	2,460,942.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,401,120.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	97,697.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,203,444.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,180,879.800	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,328,587.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,654,916.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,180,000.000	1,012,853.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,219,896.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,006,930.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,879,236.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,673,820.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,536,240.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	822,432.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	711,158.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	2,600,000.000	2,604,108.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,715,266.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	2,000,000.000	1,992,480.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	1,700,000.000	1,711,067.000	

	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	1,600,000.000	1,597,920.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	850,000.000	844,959.500	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501	700,000.000	702,016.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	300,000.000	297,984.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801	500,000.000	498,910.000	
カナダ・ドル 小計			59,696,106.110 (6,232,273,478)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	793,284.040	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	842,605.860	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	416,356.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	614,388.560	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	646,625.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	818,000.000	853,288.520	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	450,805.500	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	743,422.500	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	561,027.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	644,410.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	480,902.400	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	582,570.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	440,325.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	198,204.000	

	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	246,309.600	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	692,459.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	500,000.000	510,650.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	411,876.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	623,148.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	325,917.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	115,121.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	230,000.000	238,114.400	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401	160,000.000	163,564.800	
シンガポール・ドル 小計			11,595,375.080 (1,287,434,495)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,086,070.700	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,099,225.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,900,015.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,326,829.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,081,280.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,472,300.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	4,000,000.000	3,854,840.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	2,700,000.000	2,683,638.000	
スウェーデン・クローナ 小計			36,504,197.700 (543,912,546)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,607,253.960	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,960,311.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,841,164.400	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,841,735.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	436,065.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,988,440.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,528.500	
デンマーク・クローネ 小計			29,725,497.860 (649,799,384)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	612,114.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,413,975.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	401,643.200	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	1,100,000.000	1,071,367.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	457,845.800	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	225,519.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	998,910.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	940,000.000	813,165.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	247,710.600	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	500,000.000	492,180.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	1,100,000.000	1,129,117.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	673,232.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	497,975.000	

	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,256,476.000	
ニュージーランド・ドル 小計			10,291,230.400 (886,898,236)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,302,527.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,334,625.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,535,532.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,237,920.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,987,915.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	3,200,000.000	2,850,720.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	1,600,000.000	1,507,728.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	4,000,000.000	3,727,920.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,398,150.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	2,000,000.000	1,911,940.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	3,900,000.000	3,804,957.000	
ノルウェー・クローネ 小計			35,599,934.000 (503,027,067)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,290,072.780	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,043,390.200	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,459,721.200	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,490,090.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,079,990.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,000,000.000	4,016,850.000	

	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	3,700,000.000	3,651,456.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,415,400.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,205,150.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	6,000,000.000	5,992,080.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,347,720.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	2,010,840.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	931,440.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	1,400,000.000	1,370,894.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	856,953.940	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,474,106.500	
ポーランド・ズロチ 小計			53,636,154.620 (2,044,610,214)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,393,194.230	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,561,864.540	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,800,000.000	1,882,710.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	741,424.060	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,460,520.230	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,915,685.640	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,484,171.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,294,956.800	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,036,010.700	

	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,570,258.500	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,212,122.100	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,153,638.500	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,380,114.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,248,340.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,662.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,366,086.800	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,373,868.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,047,080.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,550,000.000	2,558,134.500	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,683,999.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,730,754.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,415,708.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,116,885.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	523,135.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,200,000.000	2,362,888.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,009,690.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,246,704.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	1,500,000.000	1,580,085.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	1,005,590.000	

マレーシア・リンギット 小計			50,012,280.600 (1,686,214,052)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	17,512,434.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,704,740.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	30,110,970.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	27,193,200.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	22,677,080.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,573,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,969,200.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	10,000,000.000	10,030,700.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	10,000,000.000	9,913,600.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	27,637,138.560	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,298,975.860	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,404,552.320	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,214,512.340	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	42,228,264.450	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	24,276,840.180	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	35,944,000.000	32,498,767.600	
メキシコ・ペソ 小計			321,244,775.310 (2,389,097,393)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	330,231.720	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	247,435.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	775,064.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	407,320.800	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	475,100.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	464,820.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	226,743.300	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	254,808.000	

		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	440,950.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	172,644.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	517,098.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	195,462.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	279,049.500	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	739,016.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	267,656.400	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	382,068.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	305,013.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,024,920.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	359,912.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	600,000.000	606,282.000	
		2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	503,665.000	
		3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415	350,000.000	340,242.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	500,000.000	501,305.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	617,004.380	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	555,824.640	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	120,765.600	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,247,859.200	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	337,473.000	

		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,161,084.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,205,516.800	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	880,285.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	659,424.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	242,452.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	750,000.000	253,867.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,044,828.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,954.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	112,581.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,677,870.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,345,875.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	1,000,000.000	746,180.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	300,651.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,318,707.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	468,815.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	200,000.000	205,394.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	842,096.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	503,725.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	497,915.000	
		2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	807,792.000	

		2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	300,000.000	301,083.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,623,529.320	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	645,323.300	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,063,000.000	1,053,773.160	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	851,878.760	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	476,759.800	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,075,866.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	406,481.400	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	494,088.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,435,063.700	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	1,350,000.000	1,209,289.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,423,740.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	465,066.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	420,000.000	374,707.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	553,418.600	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,146,132.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,360,384.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	175,016.600	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,191,568.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	469,768.000	

		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	745,704.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,520,790.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	542,574.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	686,763.000	
		2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,088,725.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	933,380.000	
		2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,699.000	
		3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	200,000.000	200,680.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	700,000.000	688,947.000	
		2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022	550,000.000	553,993.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,278,681.900	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,368,535.860	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,031,063.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,306,862.400	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,577,468.080	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,735,159.100	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,371,000.000	1,553,068.800	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,188,250.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,148,482.330	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,233,345.700	

		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,546,819.840	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,497,015.530	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,370,317.400	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,145,330.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,209,811.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,492,466.300	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,834,317.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,895,861.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,422,700.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,763,390.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	3,150,000.000	1,517,229.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,591,100.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	3,500,000.000	2,720,340.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,914,800.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	2,500,000.000	2,246,000.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,078,488.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,684,160.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,803,048.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,874,920.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	820,590.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,399,248.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	875,050.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,275,030.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,298,032.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,596,482.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,650,000.000	2,053,246.500	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,207,296.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,392,080.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,000,000.000	997,020.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	776,200.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,435,664.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,519,170.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,354,040.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	2,100,000.000	1,895,439.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	966,690.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,532,725.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,900,000.000	1,895,687.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	950,000.000	925,642.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	800,000.000	798,400.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	951,909.000	

		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	808,792.000	
		2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,011,280.000	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	100,303.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311	3,000,000.000	3,021,210.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	100,000.000	99,825.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,734,956.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,600,000.000	2,516,462.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,967,060.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	425,313.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,009,690.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,544.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,416.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,104,917.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,188.500	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	500,000.000	507,010.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,712,588.520	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	3,491,267.060	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,014,003.090	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	2,993,402.880	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,510,837.360	

		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,509,856.840	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,720,914.760	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,183,898.350	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,788,000.000	2,605,636.920	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,091,680.040	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,802,406.400	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	5,369,000.000	4,367,574.120	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	768,786.360	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,050,000.000	2,978,142.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,241,982.600	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,338,494.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,856,986.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,185,512.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,650,000.000	4,850,864.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,705,569.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,786,551.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,650,000.000	5,260,715.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,776,724.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,340,596.900	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,423,906.000	

		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,351,700.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	286,071.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,600,000.000	2,049,984.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,866,530.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	3,871,760.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,224,470.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	4,200,000.000	3,463,068.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,313,300.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,148,210.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,861,585.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	846,680.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,763,139.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,225,696.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,617,664.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,368,284.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,315,264.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	611,814.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,133,883.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,051,608.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	4,600,000.000	4,660,076.000	

		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	3,700,000.000	3,658,671.000	
		3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	1,200,000.000	1,191,504.000	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	900,000.000	862,263.000	
		3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	1,500,000.000	1,500,240.000	
		2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924	1,100,000.000	1,106,336.000	
		2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	1,200,000.000	1,204,968.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,241,931.430	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,954,139.850	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,893,064.810	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,466,899.000	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,879,000.000	1,786,872.630	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	136,000.380	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,150,522.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,300,630.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,112,916.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	850,992.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,249,738.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,234,565.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,450,000.000	651,891.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,127,945.000	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	624,339.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	836,217.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	873,440.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,500,000.000	1,185,990.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	895,365.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,317,069.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	617,064.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	987,330.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715	600,000.000	587,442.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,192,839.300	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,641,940.080	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,336,294.950	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,906,821.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,298,770.900	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,379,724.820	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,052,138.480	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,058,793.840	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	697,327.840	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,425,120.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,518,501.300	

		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,493,679.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,705,724.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,197,794.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,098,719.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,602,275.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	2,470,000.000	2,469,456.600	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,388,520.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,973,486.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,105,355.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,148,787.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,800,307.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,313,199.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,143,915.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,227,195.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,839,460.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,988,385.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,151,138.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,132,830.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,600,000.000	2,340,988.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	744,720.000	

		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	524,391.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,807,337.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,575,918.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	1,100,000.000	729,619.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	960,000.000	577,123.200	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	2,300,000.000	2,187,438.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,684,787.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	3,035,737.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,010,706.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,433,262.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	541,168.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	295,584.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	813,264.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,542,368.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,195,442.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	1,000,000.000	1,014,680.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,585,380.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,050,180.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	3,100,000.000	3,278,498.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,552,275.000	

		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,687,904.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,200,000.000	1,244,964.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	961,128.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,260,072.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,277,303.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	734,111.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	921,375.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,251,053.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,596,510.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	637,104.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	203,244.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,037,430.000	
		4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,069,420.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	414,108.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	729,862.000	
		4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	52,049.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,200,000.000	1,239,252.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,544,175.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,383.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	518,880.000	

		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	204,132.000	
		4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	1,000,000.000	1,000,550.000	
		3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,316,861.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	811,928.000	
		3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,000,000.000	1,016,450.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	200,000.000	201,600.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	300,000.000	297,684.000	
		2.55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225	800,000.000	807,432.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701	500,000.000	506,665.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615	500,000.000	506,670.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	700,000.000	708,918.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	600,000.000	605,880.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,403,627.280	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,353,814.310	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,130,098.550	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,608,344.900	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,860,286.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,751,282.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,535,823.650	

		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,602,125.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,991,834.320	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,424,651.180	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	2,006,000.000	2,194,062.500	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,225,128.640	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,504,000.000	1,640,548.160	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	845,208.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	652,728.590	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	751,384.890	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	967,313.770	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	761,883.850	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	479,154.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	776,664.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	679,965.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	709,635.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	913,719.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	418,746.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	275,593.500	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	484,925.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	714,080.000	

		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	685,120.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	269,260.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,169.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	193,634.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	294,648.000	
		3.15% IRISH TREASURY 20551018	320,000.000	302,627.200	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	898,425.000	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,514,927.010	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	355,690.920	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	702,553.560	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	1,371,000.000	1,326,168.300	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	397,161.220	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	370,593.850	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,003,814.320	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,003,634.360	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,708,819.840	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	1,106,037.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,610,406.500	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,886,434.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,682,642.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,024,826.000	

		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,356,056.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,828,420.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,836,548.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,552,592.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	3,450,000.000	3,073,087.500	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,526,096.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,335,795.200	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	766,262.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	1,200,000.000	1,171,332.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,250,048.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,600,000.000	1,152,352.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,906,278.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	306,215.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,370,200.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	526,197.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,662,595.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	399,138.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	2,200,000.000	2,132,790.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,835,400.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,068,720.000	

		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,386,196.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,673,038.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,300,000.000	1,252,927.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,653,040.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,319,136.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,189,229.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,568,265.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,400,000.000	1,464,106.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,650,076.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	202,128.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,004,310.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,650,608.000	
		3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,200,000.000	1,231,896.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	202,650.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,203,612.000	
		2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531	500,000.000	503,945.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131	500,000.000	492,270.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,602,205.380	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,907,755.640	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,146,082.900	

		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,233,653.030	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,054,839.800	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,941,318.300	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,699,000.000	2,032,479.720	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	850,000.000	928,744.000	
		4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	708,634.800	
		2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	850,096.800	
		3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	676,456.200	
		2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,306,045.000	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	570,000.000	609,860.100	
		2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	687,988.800	
		1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	994,780.000	
		0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	818,478.000	
		0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	604,369.800	
		0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	750,000.000	611,437.500	
		1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	630,000.000	344,005.200	
		0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	655,800.000	
		1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	366,168.400	
		1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	535,851.300	
		3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	511,665.000	

		2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	628,532.100	
		3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	232,838.400	
		3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615	300,000.000	300,066.000	
		3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615	300,000.000	297,375.000	
	ユーロ 小計			614,017,364.770 (100,146,232,195)	
国債証券 合計				327,953,389,953 [327,953,389,953]	
合計				327,953,389,953 [327,953,389,953]	

（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	284銘柄	100%	46.0%
イギリス・ポンド	国債証券	63銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券	83銘柄	100%	11.3%
カナダ・ドル	国債証券	42銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券	23銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券	14銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	11銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.6%
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	16銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	412銘柄	100%	30.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月5日現在 金　額（円）	2025年6月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,633,316,704	234,548,898
国債証券	78,982,841,780	88,204,585,170
地方債証券	5,056,420,277	4,539,075,962
特殊債券	4,399,795,427	4,207,828,732
社債券	6,808,299,900	7,194,397,700
未収利息	143,570,691	214,511,252
前払費用	24,495,748	21,079,134
流動資産合計	97,048,740,527	104,616,026,848
資産合計	97,048,740,527	104,616,026,848
負債の部		
流動負債		
未払金	2,075,940,000	-
未払解約金	161,602	5,486,491
流動負債合計	2,076,101,602	5,486,491
負債合計	2,076,101,602	5,486,491
純資産の部		
元本等		
元本　※1	79,534,327,542	90,273,892,056
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,438,311,383	14,336,648,301
元本等合計	94,972,638,925	104,610,540,357
純資産合計	94,972,638,925	104,610,540,357
負債純資産合計	97,048,740,527	104,616,026,848

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6月6日 至2025年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
1.　※1 期首	2023年6月6日	2024年6月6日
期首元本額	37,438,102,323円	79,534,327,542円
期中追加設定元本額	43,080,599,426円	13,388,683,726円
期中一部解約元本額	984,374,207円	2,649,119,212円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,574,576,557円	4,861,241,355円
日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	30,372,368,739円	33,620,826,557円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	2,936,179,418円	2,536,557,101円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	7,657,263,891円	9,571,377,416円
ダイワ・ライフ・バランス３０	12,692,085,787円	13,810,901,418円
ダイワ・ライフ・バランス５０	10,551,584,695円	12,108,828,154円
ダイワ・ライフ・バランス７０	4,353,349,045円	4,905,114,744円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	2,178,385,186円	2,389,511,536円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,750,979,994円	1,950,521,511円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	724,464,014円	931,290,131円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,395,945,791円	3,040,875,785円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	54,869,712円	59,449,056円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	27,058,330円	35,377,245円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	24,027,180円	225,044,852円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	193,800,497円	178,758,354円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	47,388,706円	48,216,841円
計	79,534,327,542円	90,273,892,056円
2. 期末日における受益権の総数	79,534,327,542口	90,273,892,056口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月6日 至2025年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月5日現在

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,186,348,380	△2,894,734,350
地方債証券	△46,225,816	△84,693,500
特殊債券	△57,326,908	△82,438,104
社債券	△51,814,200	△73,654,000
合計	△2,341,715,304	△3,135,519,954

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2024年6月5日現在	2025年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1941円 (11,941円)	1.1588円 (11,588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	462 2年国債	50,000,000	49,899,000	
	463 2年国債	100,000,000	99,753,000	
	464 2年国債	200,000,000	199,422,000	
	465 2年国債	100,000,000	99,666,000	
	466 2年国債	800,000,000	798,048,000	
	467 2年国債	450,000,000	449,401,500	
	469 2年国債	710,000,000	709,822,500	
	470 2年国債	575,000,000	575,787,750	
	149 5年国債	2,300,000,000	2,281,140,000	
	150 5年国債	1,450,000,000	1,434,746,000	
	151 5年国債	600,000,000	592,380,000	
	152 5年国債	190,000,000	187,904,300	
	153 5年国債	1,520,000,000	1,497,564,800	
	154 5年国債	1,900,000,000	1,871,766,000	
	155 5年国債	90,000,000	88,934,400	
	156 5年国債	1,700,000,000	1,675,639,000	
	157 5年国債	60,000,000	59,018,400	
	158 5年国債	2,150,000,000	2,108,978,000	
	159 5年国債	200,000,000	195,730,000	
	161 5年国債	560,000,000	551,364,800	
	162 5年国債	280,000,000	275,114,000	
	163 5年国債	1,600,000,000	1,577,200,000	
	164 5年国債	1,200,000,000	1,172,184,000	
	166 5年国債	620,000,000	609,887,800	
	168 5年国債	450,000,000	444,973,500	
	169 5年国債	640,000,000	630,508,800	
	170 5年国債	600,000,000	592,290,000	
	171 5年国債	650,000,000	636,467,000	
	173 5年国債	150,000,000	147,774,000	
	174 5年国債	500,000,000	494,640,000	
	175 5年国債	50,000,000	49,826,000	
	176 5年国債	745,000,000	745,804,600	
	177 5年国債	150,000,000	150,814,500	
	178 5年国債	890,000,000	889,795,300	
	1 40年国債	30,000,000	29,542,800	
	2 40年国債	48,000,000	45,111,840	
	3 40年国債	19,000,000	17,602,360	

4 40年国債	54,000,000	49,221,540	
5 40年国債	61,000,000	52,603,960	
6 40年国債	268,000,000	223,493,240	
7 40年国債	190,000,000	148,969,500	
8 40年国債	100,000,000	72,054,000	
9 40年国債	40,000,000	20,244,400	
10 40年国債	290,000,000	173,286,600	
11 40年国債	85,000,000	48,019,050	
12 40年国債	99,000,000	48,379,320	
13 40年国債	252,000,000	119,952,000	
14 40年国債	273,000,000	138,266,310	
15 40年国債	650,000,000	363,538,500	
16 40年国債	710,000,000	436,003,900	
17 40年国債	1,030,000,000	831,591,100	
1 CT10年国債	130,000,000	123,528,600	
344 10年国債	90,000,000	89,371,800	
345 10年国債	410,000,000	406,281,300	
346 10年国債	20,000,000	19,779,400	
347 10年国債	500,000,000	493,570,000	
348 10年国債	430,000,000	423,610,200	
349 10年国債	430,000,000	422,767,400	
350 10年国債	400,000,000	392,368,000	
351 10年国債	500,000,000	489,325,000	
352 10年国債	150,000,000	146,398,500	
353 10年国債	520,000,000	506,162,800	
355 10年国債	200,000,000	193,462,000	
356 10年国債	600,000,000	578,496,000	
357 10年国債	600,000,000	576,798,000	
358 10年国債	1,280,000,000	1,226,252,800	
359 10年国債	1,000,000,000	955,450,000	
360 10年国債	1,380,000,000	1,314,615,600	
361 10年国債	1,020,000,000	968,755,200	
362 10年国債	1,530,000,000	1,448,328,600	
363 10年国債	830,000,000	782,997,100	
364 10年国債	850,000,000	799,051,000	
365 10年国債	910,000,000	852,397,000	
366 10年国債	1,500,000,000	1,409,850,000	
367 10年国債	1,160,000,000	1,086,827,200	
368 10年国債	1,000,000,000	932,960,000	

369 10年国債	1,200,000,000	1,140,336,000	
370 10年国債	1,120,000,000	1,060,012,800	
371 10年国債	1,110,000,000	1,038,049,800	
372 10年国債	1,180,000,000	1,135,844,400	
373 10年国債	1,260,000,000	1,188,091,800	
374 10年国債	1,270,000,000	1,213,218,300	
375 10年国債	600,000,000	586,260,000	
376 10年国債	418,000,000	399,829,540	
377 10年国債	950,000,000	930,477,500	
378 10年国債	675,000,000	671,530,500	
2 30年国債	9,000,000	9,581,760	
3 30年国債	4,000,000	4,249,400	
4 30年国債	8,000,000	8,791,120	
5 30年国債	8,000,000	8,522,640	
6 30年国債	9,000,000	9,728,820	
7 30年国債	12,000,000	12,934,320	
10 30年国債	25,000,000	24,777,750	
11 30年国債	9,000,000	9,309,420	
12 30年国債	11,000,000	11,706,750	
13 30年国債	11,000,000	11,614,130	
14 30年国債	22,000,000	23,926,980	
15 30年国債	21,000,000	23,010,120	
16 30年国債	26,000,000	28,479,880	
17 30年国債	17,000,000	18,461,660	
18 30年国債	20,000,000	21,530,600	
19 30年国債	15,000,000	16,138,350	
20 30年国債	16,000,000	17,504,320	
21 30年国債	16,000,000	17,180,480	
22 30年国債	17,000,000	18,560,940	
23 30年国債	16,000,000	17,457,280	
24 30年国債	15,000,000	16,345,650	
25 30年国債	17,000,000	18,141,380	
26 30年国債	32,000,000	34,435,840	
27 30年国債	120,000,000	130,023,600	
28 30年国債	34,000,000	36,702,660	
29 30年国債	43,000,000	45,766,620	
30 30年国債	56,000,000	58,671,200	
31 30年国債	76,000,000	78,298,240	
32 30年国債	115,000,000	119,276,850	

33 30年国債	95,000,000	94,336,900	
34 30年国債	110,000,000	111,435,500	
35 30年国債	120,000,000	117,543,600	
36 30年国債	138,000,000	134,450,640	
37 30年国債	165,000,000	157,517,250	
38 30年国債	250,000,000	233,630,000	
39 30年国債	105,000,000	99,327,900	
40 30年国債	80,000,000	74,323,200	
41 30年国債	80,000,000	72,860,800	
42 30年国債	200,000,000	181,518,000	
43 30年国債	335,000,000	302,970,650	
44 30年国債	155,000,000	139,771,250	
45 30年国債	200,000,000	173,404,000	
46 30年国債	250,000,000	216,045,000	
47 30年国債	355,000,000	311,512,500	
48 30年国債	260,000,000	219,138,400	
49 30年国債	340,000,000	285,559,200	
50 30年国債	270,000,000	199,573,200	
51 30年国債	350,000,000	228,704,000	
52 30年国債	300,000,000	204,549,000	
53 30年国債	280,000,000	194,359,200	
54 30年国債	290,000,000	209,812,100	
55 30年国債	390,000,000	280,636,200	
56 30年国債	250,000,000	178,800,000	
57 30年国債	235,000,000	167,164,900	
58 30年国債	450,000,000	318,379,500	
59 30年国債	290,000,000	198,998,000	
60 30年国債	250,000,000	179,247,500	
61 30年国債	260,000,000	176,157,800	
62 30年国債	340,000,000	216,743,200	
63 30年国債	270,000,000	165,928,500	
64 30年国債	300,000,000	182,820,000	
65 30年国債	275,000,000	166,300,750	
66 30年国債	390,000,000	233,723,100	
67 30年国債	340,000,000	214,285,000	
68 30年国債	300,000,000	187,434,000	
69 30年国債	300,000,000	191,499,000	
70 30年国債	430,000,000	272,349,100	
71 30年国債	280,000,000	176,072,400	

72 30年国債	300,000,000	187,296,000	
73 30年国債	340,000,000	210,898,600	
74 30年国債	450,000,000	302,841,000	
75 30年国債	360,000,000	261,604,800	
76 30年国債	290,000,000	215,365,600	
77 30年国債	245,000,000	190,685,950	
78 30年国債	210,000,000	154,742,700	
79 30年国債	300,000,000	208,554,000	
80 30年国債	280,000,000	226,500,400	
81 30年国債	300,000,000	230,115,000	
82 30年国債	350,000,000	281,428,000	
83 30年国債	250,000,000	220,500,000	
84 30年国債	250,000,000	215,422,500	
85 30年国債	290,000,000	261,481,400	
86 30年国債	290,000,000	267,467,000	
92 20年国債	60,000,000	61,288,800	
93 20年国債	18,000,000	18,407,880	
94 20年国債	45,000,000	46,098,900	
95 20年国債	30,000,000	30,945,900	
96 20年国債	63,000,000	64,733,130	
97 20年国債	25,000,000	25,819,000	
98 20年国債	64,000,000	65,952,640	
99 20年国債	53,000,000	54,769,140	
100 20年国債	35,000,000	36,355,200	
101 20年国債	18,000,000	18,795,060	
102 20年国債	10,000,000	10,474,600	
103 20年国債	21,000,000	21,934,290	
104 20年国債	64,000,000	66,467,840	
105 20年国債	38,000,000	39,551,920	
106 20年国債	16,000,000	16,704,640	
107 20年国債	40,000,000	41,718,000	
108 20年国債	68,000,000	70,441,200	
109 20年国債	60,000,000	62,230,800	
110 20年国債	27,000,000	28,206,900	
111 20年国債	35,000,000	36,765,750	
113 20年国債	170,000,000	178,168,500	
114 20年国債	45,000,000	47,241,450	
115 20年国債	42,000,000	44,275,140	
116 20年国債	27,000,000	28,505,790	

117 20年国債	77,000,000	80,942,400	
118 20年国債	13,000,000	13,629,980	
119 20年国債	23,000,000	23,888,260	
120 20年国債	98,000,000	100,820,440	
123 20年国債	42,000,000	44,401,560	
124 20年国債	100,000,000	105,193,000	
125 20年国債	25,000,000	26,604,500	
126 20年国債	21,000,000	22,112,370	
127 20年国債	110,000,000	115,225,000	
128 20年国債	32,000,000	33,553,920	
129 20年国債	95,000,000	99,045,100	
130 20年国債	110,000,000	114,766,300	
131 20年国債	150,000,000	155,569,500	
132 20年国債	25,000,000	25,930,750	
133 20年国債	150,000,000	156,549,000	
134 20年国債	15,000,000	15,663,000	
135 20年国債	20,000,000	20,751,200	
136 20年国債	180,000,000	185,623,200	
137 20年国債	18,000,000	18,687,060	
139 20年国債	250,000,000	257,827,500	
140 20年国債	100,000,000	103,769,000	
141 20年国債	140,000,000	145,140,800	
142 20年国債	210,000,000	219,242,100	
143 20年国債	100,000,000	102,811,000	
144 20年国債	130,000,000	132,681,900	
145 20年国債	40,000,000	41,375,200	
146 20年国債	160,000,000	165,283,200	
147 20年国債	350,000,000	358,207,500	
148 20年国債	290,000,000	293,877,300	
149 20年国債	110,000,000	111,194,600	
150 20年国債	450,000,000	450,000,000	
151 20年国債	240,000,000	235,068,000	
152 20年国債	540,000,000	527,299,200	
153 20年国債	550,000,000	540,633,500	
154 20年国債	380,000,000	368,683,600	
155 20年国債	600,000,000	568,554,000	
156 20年国債	530,000,000	468,689,600	
157 20年国債	610,000,000	523,977,800	
158 20年国債	680,000,000	601,276,400	

	159 20年国債	560,000,000	497,929,600	
	160 20年国債	610,000,000	545,815,800	
	161 20年国債	430,000,000	378,008,700	
	162 20年国債	540,000,000	471,933,000	
	163 20年国債	450,000,000	390,951,000	
	164 20年国債	760,000,000	647,542,800	
	165 20年国債	550,000,000	465,641,000	
	166 20年国債	720,000,000	622,699,200	
	167 20年国債	400,000,000	334,288,000	
	168 20年国債	640,000,000	523,680,000	
	169 20年国債	500,000,000	400,035,000	
	170 20年国債	670,000,000	532,174,300	
	171 20年国債	400,000,000	315,408,000	
	172 20年国債	700,000,000	556,626,000	
	173 20年国債	520,000,000	410,519,200	
	174 20年国債	750,000,000	587,797,500	
	175 20年国債	450,000,000	356,044,500	
	176 20年国債	650,000,000	510,653,000	
	177 20年国債	430,000,000	329,448,800	
	178 20年国債	700,000,000	542,010,000	
	179 20年国債	510,000,000	392,251,200	
	180 20年国債	650,000,000	523,984,500	
	181 20年国債	450,000,000	367,038,000	
	182 20年国債	650,000,000	546,071,500	
	183 20年国債	410,000,000	360,726,200	
	184 20年国債	420,000,000	349,540,800	
	185 20年国債	560,000,000	463,685,600	
	186 20年国債	600,000,000	530,346,000	
	187 20年国債	450,000,000	382,801,500	
	188 20年国債	400,000,000	356,944,000	
	189 20年国債	350,000,000	327,344,500	
	190 20年国債	340,000,000	311,865,000	
	191 20年国債	330,000,000	312,024,900	
	192 20年国債	250,000,000	251,517,500	
	1 フィリピン共和国	100,000,000	98,744,900	
国債証券 合計			88,204,585,170	
地方債証券	797 東京都公債	100,000,000	95,513,500	
	28 東京都20年	100,000,000	101,540,200	

	3-5 北海道公債	100,000,000	93,654,300	
	262 神奈川県公債	300,000,000	289,848,000	
	457 大阪府公債	100,000,000	94,748,700	
	26-5 京都府20年	100,000,000	99,276,300	
	6-1 京都府5年	200,000,000	195,760,800	
	11兵庫県公債20年	100,000,000	103,303,300	
	8 静岡県20年	100,000,000	104,651,600	
	5-3 愛知県公債	100,000,000	94,563,500	
	6-1 愛知県5年	300,000,000	293,531,400	
	24-1 広島県20年	100,000,000	102,665,900	
	25-1 広島県20年	100,000,000	102,458,500	
	1 埼玉県15年	100,000,000	99,250,900	
	9 埼玉県20年	100,000,000	104,712,900	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	98,219,000	
	30-3 新潟県公債	134,160,000	129,842,462	
	3-1 茨城県公債	100,000,000	93,696,600	
	168 共同発行地方	100,000,000	98,833,800	
	170 共同発行地方	200,000,000	197,301,600	
	206 共同発行地方	200,000,000	190,056,800	
	244 共同発行地方	100,000,000	93,645,200	
	255 共同発行地方	300,000,000	288,650,400	
	3-3 堺市公債	100,000,000	92,887,200	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	93,801,400	
	2-1 静岡市公債	100,000,000	94,490,900	
	6-1 大阪市5年	200,000,000	196,238,800	
	6-2 大阪市公債	200,000,000	191,265,800	
	11 名古屋市20年	100,000,000	104,461,400	
	10 京都市20年	100,000,000	103,405,800	
	24-3 神戸市20年	100,000,000	102,276,400	
	2-2 横浜市公債	100,000,000	94,756,500	
	6 札幌市20年	100,000,000	104,580,700	
	17 北九州市20年	100,000,000	100,047,600	
	2-1 千葉市公債	100,000,000	95,137,800	
地方債証券 合計			4,539,075,962	
特殊債券	47日本政策投資C0	100,000,000	99,492,700	
	174 日本政策投資	100,000,000	93,916,900	
	184 日本政策投資	200,000,000	195,523,600	
	79 政保道路機構	100,000,000	104,031,500	
	81 政保道路機構	100,000,000	104,065,600	

	97 政保道路機構	100,000,000	104,455,500	
	143 政保道路機構	200,000,000	206,922,800	
	235 政保道路機構	100,000,000	96,953,400	
	321 政保道路機構	100,000,000	98,389,300	
	397 政保道路機構	100,000,000	95,436,700	
	478 政保道路機構	300,000,000	289,326,600	
	23 地方公共団20	100,000,000	102,397,300	
	F163地方公共団体	100,000,000	100,160,400	
	F168地方公共団体	200,000,000	202,457,200	
	3 地方公共団15年	100,000,000	100,407,300	
	F231地方公共団体	100,000,000	99,909,700	
	129 地方公共団体	100,000,000	95,020,900	
	F568地方公共団体	300,000,000	261,823,200	
	95 日本政策金融	300,000,000	296,951,100	
	4 国際協力銀行CO	100,000,000	98,387,900	
	127 都市再生	100,000,000	99,065,800	
	80 住宅支援機構	100,000,000	100,981,100	
	47 住宅機構RMBS	162,252,000	165,497,040	
	92 住宅機構RMBS	75,536,000	71,487,270	
	100 住宅機構RMBS	46,729,000	43,873,858	
	120 住宅機構RMBS	873,670,000	785,604,064	
	33 沖縄振興開発	100,000,000	95,290,000	
特殊債券 合計			4,207,828,732	
社債券	39 BPCE S.A.	100,000,000	99,338,800	
	4 香港上海銀行	100,000,000	99,490,000	
	33 首都高速道路	300,000,000	294,087,900	
	30 阪神高速道路	200,000,000	197,666,200	
	20 成田国際空港	100,000,000	99,114,100	
	8 ビーエヌピーパリバ	100,000,000	98,780,300	
	111 東日本高速道	300,000,000	293,992,500	
	101 中日本高速道	200,000,000	196,084,800	
	88 西日本高速道	300,000,000	292,028,100	
	32大和ハウス工業	100,000,000	99,294,700	
	22 積水ハウス	100,000,000	97,801,500	
	11サントリーホールデイング	100,000,000	97,932,600	
	3 伊藤園	100,000,000	97,737,500	
	29 東急不動産HD	100,000,000	97,731,500	
	18 セブンアンドアイ	100,000,000	96,368,300	
	35 東レ	100,000,000	97,342,700	

57 三井化学	200,000,000	197,831,400	
16 武田薬品	100,000,000	92,074,900	
32 住友電工	100,000,000	96,818,100	
16 クボタ	100,000,000	98,171,400	
17 パナソニツク	100,000,000	99,414,600	
40 ソニーG	100,000,000	98,112,800	
31 トヨタ自動車	100,000,000	93,899,300	
6 楽天カード	100,000,000	97,579,700	
4 オリツクス銀行	100,000,000	98,187,700	
26 りそなホールデイン	100,000,000	97,870,400	
39 芙蓉総合リース	200,000,000	197,573,800	
5 NTTフアイナンス	100,000,000	92,072,500	
33 NTTフアイナンス	200,000,000	195,322,800	
38 NTTフアイナンス	100,000,000	95,289,800	
58 日産フイナンシヤル	200,000,000	191,953,800	
81 ホンダフアイナンス	100,000,000	97,161,500	
102 トヨタフアイナンス	100,000,000	99,000,500	
103 トヨタフアイナンス	200,000,000	195,865,400	
42 リコーリース	100,000,000	98,542,800	
214 オリツクス	100,000,000	92,833,100	
1 SOMPOHD	100,000,000	97,921,000	
7 三井住友海上	100,000,000	98,926,500	
82 三井不動産	100,000,000	97,692,800	
80 三菱地所	100,000,000	102,297,500	
143 三菱地所	100,000,000	94,575,600	
55 西日本鉄道	200,000,000	195,722,000	
52 阪急阪神HLDG	100,000,000	95,498,100	
20 三菱倉庫	100,000,000	96,237,200	
34 KDDI	100,000,000	98,050,700	
9 ソフトバンク	100,000,000	97,717,600	
46 光通信	100,000,000	98,024,900	
566 中部電力	200,000,000	187,478,600	
448 中国電力	100,000,000	93,482,000	
563 東北電力	200,000,000	187,337,200	
489 九州電力	100,000,000	95,337,400	
87 電源開発	100,000,000	93,806,100	
83 東京電力PG	100,000,000	100,733,300	
16 JERA	100,000,000	98,291,600	
65 東京瓦斯	100,000,000	94,487,300	

	44 大阪瓦斯	100,000,000	92,937,000	
	50 大阪瓦斯	100,000,000	97,980,400	
	60 ソフトバンクグループ	100,000,000	99,495,100	
社債券 合計			7,194,397,700	
合計			104,145,887,564	

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(2025年6月6日から2025年12月5日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワつみたてインデックスバランス３０

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2025年12月5日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	539,715
親投資信託受益証券	143,460,605
未収入金	7,700
流動資産合計	144,008,020
資産合計	144,008,020
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,156
未払受託者報酬	11,111
未払委託者報酬	92,930
その他未払費用	5,485
流動負債合計	117,682
負債合計	117,682
純資産の部	
元本等	
元本	※1 107,619,928
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	36,270,410
（分配準備積立金）	13,413,048
元本等合計	143,890,338
純資産合計	143,890,338
負債純資産合計	144,008,020

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2025年6月6日 至　2025年12月5日
営業収益	
受取利息	1,055
有価証券売買等損益	8,974,098
営業収益合計	8,975,153
営業費用	
受託者報酬	11,111
委託者報酬	92,930
その他費用	5,485
営業費用合計	109,526
営業利益又は営業損失（△）	8,865,627
経常利益又は経常損失（△）	8,865,627
中間純利益又は中間純損失（△）	8,865,627
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（△）	251,109
期首剰余金又は期首欠損金（△）	25,572,579
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,140,896
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,140,896
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,057,583
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,057,583
中間剰余金又は中間欠損金（△）	36,270,410

(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2025年6月6日 至2025年12月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	当中間計算期間末 2025年12月5日現在
1．　※1 期首元本額	101,821,723円
期中追加設定元本額	9,982,557円
期中一部解約元本額	4,184,352円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	107,619,928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2025年6月6日 至2025年12月5日
	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2025年12月5日現在
1．　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2025年12月5日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2025年12月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3370円 (13,370円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2025年12月5日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		27,458,142,804
株式	※2※3	562,047,647,627
派生商品評価勘定		337,224,800
未収入金		162,508,300
未収配当金		1,097,966,638

その他未収収益	※4	29,117,549
差入委託証拠金		191,292,078
流動資産合計		591,323,899,796
資産合計		591,323,899,796
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		488,800
前受金		670,060,800
未払金		9,987,364,010
未払解約金		366,834,790
未払利息		4,575,817
受入担保金		11,882,951,240
流動負債合計		22,912,275,457
負債合計		22,912,275,457
純資産の部		
元本等		
元本	※1	224,548,688,297
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		343,862,936,042
元本等合計		568,411,624,339
純資産合計		568,411,624,339
負債純資産合計		591,323,899,796

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月6日 至2025年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年12月5日現在
1.　※1 期首	2025年6月6日
期首元本額	211,363,531,690円
期中追加設定元本額	27,423,757,455円
期中一部解約元本額	14,238,600,848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	2,756,377,552円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	3,383,169,570円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	898,561円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	6,314,008円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	81,223,299円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	8,264,060円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	205,657,242円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,424,789,298円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	923,318,442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）	156,533,865円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	9,975,025円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	233,889,452円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	11,639,914,337円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,536,958,910円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,243,336,032円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	6,121,438円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	71,084,732,984円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,638,891,886円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,138,810,175円
ダイワ・ライフ・バランス７０	6,167,351,282円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,507,069,422円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	37,539,255円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	75,461,826円
ダイワつみたてインデックス日本株式	8,031,278,317円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,518,163円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	15,557,473円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	296,147,585円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	33,191,585,543円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	36,779,842円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	15,785,951円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,200,101,172円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	205,214,750円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	25,994,337円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	37,511,726円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	226,166,559円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	21,033,572,336円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	21,086,527,255円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,189,089,209円
スタイル9（4資産分散・保守型）	1,607,988円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	11,150,486円
スタイル9（4資産分散・積極型）	17,691,815円
スタイル9（6資産分散・保守型）	701,746円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	20,287,834円
スタイル9（6資産分散・積極型）	24,537,893円
スタイル9（8資産分散・保守型）	1,087,176円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	18,694,666円
スタイル9（8資産分散・積極型）	50,932,383円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	2,856,432,897円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	862,187,339円
ダイワライフスタイル２５	72,230,841円
ダイワライフスタイル５０	372,420,599円
ダイワライフスタイル７５	336,767,778円

ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	7,032,528,717円
計	224,548,688,297円
2. 期末日における受益権の総数	224,548,688,297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　11,410,651,130円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　1,085,915,000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12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2025年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買建	6,714,948,500	-	7,051,800,000	336,851,500
合計	6,714,948,500	-	7,051,800,000	336,851,500

（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12月5日現在
1口当たり純資産額	2.5314円
（1万口当たり純資産額）	(25,314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12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,919,697,925
コール・ローン	19,196,732,353

株式		846,534,851,486
投資証券		13,792,077,317
派生商品評価勘定		712,245,128
未収配当金		829,619,156
差入委託証拠金		13,455,464,388
流動資産合計		896,440,687,753
資産合計		896,440,687,753
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		125,962,879
未払解約金		353,835,100
流動負債合計		479,797,979
負債合計		479,797,979
純資産の部		
元本等		
元本	※1	106,131,553,257
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		789,829,336,517
元本等合計		895,960,889,774
純資産合計		895,960,889,774
負債純資産合計		896,440,687,753

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月6日 至2025年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2025年12月5日現在
1.　※1 期首	2025年6月6日
期首元本額	100,222,632,522円
期中追加設定元本額	11,637,602,895円
期中一部解約元本額	5,728,682,160円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	182,688,205円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	932,937円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	10,541,563円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,494,612円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	62,418,221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）	129,553,107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）	10,025,218,556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）	802,000,247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）	7,784,875,194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）	606,272,095円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	15,575,112円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	45,205,107円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	11,846,042,307円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,653,576,763円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	373,164,081円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	31,291,511円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	50,868,904,702円
ダイワ・ライフ・バランス３０	398,433,128円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,030,448,941円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,027,565,815円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	988,711,089円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	8,048,863円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,495,439円
ダイワつみたてインデックス外国株式	3,435,977,111円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,743,294円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	3,116,189円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	49,439,868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）	1,027,238,584円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	33,216,199円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	23,760,596円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	497,152,517円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	26,431,124円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	101,775,161円
スタイル9（4資産分散・保守型）	637,673円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	4,525,116円
スタイル9（4資産分散・積極型）	7,263,159円
スタイル9（6資産分散・保守型）	256,119円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	8,154,842円
スタイル9（6資産分散・積極型）	9,886,276円
スタイル9（8資産分散・保守型）	349,707円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	6,571,239円
スタイル9（8資産分散・積極型）	18,916,450円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カントリー）	1,427,899,165円
ｉＦｒｅｅ 全世界株式インデックス（オール・カントリー）	12,777,190円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,029,785,213円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	396,550,080円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	6,523,924,633円

ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,395,231,779円
ダイワライフスタイル２５	5,440,630円
ダイワライフスタイル５０	28,074,289円
ダイワライフスタイル７５	25,351,068円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	62,203,629円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	61,446,762円
計	106,131,553,257円
2. 期末日における受益権の総数	106,131,553,257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12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2025年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち１年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				

買建	35,425,019,552	-	36,067,400,031	642,380,479
合計	35,425,019,552	-	36,067,400,031	642,380,479

（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12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	19,359,392,220	-	19,303,293,990	△56,098,230
アメリカ・ドル	12,616,021,580	-	12,566,801,160	△49,220,420
イギリス・ポンド	1,130,494,210	-	1,132,863,600	2,369,390
オーストラリア・ドル	680,717,140	-	684,766,130	4,048,990
カナダ・ドル	2,014,302,630	-	2,008,024,860	△6,277,770
スイス・フラン	1,203,201,770	-	1,197,308,040	△5,893,730
ユーロ	1,714,654,890	-	1,713,530,200	△1,124,690
合計	19,359,392,220	-	19,303,293,990	△56,098,230

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2025年12月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	8.4420円 (84,420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12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,272,189,639
コール・ローン	2,245,788,923
国債証券	377,889,243,512
派生商品評価勘定	160,930
未収入金	6,938
未収利息	2,866,535,481
前払費用	201,675,487
流動資産合計	386,475,600,910
資産合計	386,475,600,910

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		8,469,102
未払金		289,750
未払解約金		331,375,217
流動負債合計		340,134,069
負債合計		340,134,069
純資産の部		
元本等		
元本	※1	96,274,477,321
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		289,860,989,520
元本等合計		386,135,466,841
純資産合計		386,135,466,841
負債純資産合計		386,475,600,910

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月6日 至2025年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年12月5日現在
1.　※1 期首	2025年6月6日
期首元本額	92,937,832,002円
期中追加設定元本額	8,690,037,302円
期中一部解約元本額	5,353,391,983円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	247,762,561円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,871,011円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	21,389,429円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	12,269,783円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	128,585,190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）	1,065,687,444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）	697,600,002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）	1,051,297,680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）	8,822,081,123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）	1,107,514,379円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,205,357円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	27,921,194円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,253,691,262円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,401,023,773円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	776,090,136円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	4,331,295円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,803,739,989円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,228,466,258円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,009,871,547円
ダイワ・ライフ・バランス７０	846,559,006円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	803,490,653円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	663,359,049円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	323,179,514円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	34,896,556円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	30,902,868円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,938,913,596円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	5,326,303円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	3,206,714円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	41,195,179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）	3,370,771,545円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	80,675,074円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	24,732,473円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,054,354,985円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	128,181,459円
スタイル9（4資産分散・保守型）	392,493円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	4,859,374円
スタイル9（4資産分散・積極型）	5,578,020円
スタイル9（6資産分散・保守型）	159,591円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	4,577,590円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,267,102円

スタイル9（8資産分散・保守型）	233,240円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	3,046,026円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,360,739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）	329,922,036円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	109,858,428円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	63,498,066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）	6,429,803,847円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,204,664,196円
ダイワライフスタイル２５	22,712,424円
ダイワライフスタイル５０	57,823,339円
ダイワライフスタイル７５	17,576,423円
計	96,274,477,321円
2. 期末日における受益権の総数	96,274,477,321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12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2025年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,960,689,909	-	1,952,381,737	△8,308,172
アメリカ・ドル	144,509,315	-	144,230,043	△279,272
イギリス・ポンド	14,576,775	-	14,625,566	48,791
イスラエル・シュケル	63,525,189	-	63,455,896	△69,293
オーストラリア・ドル	47,723,551	-	47,835,637	112,086
オフショア・人民元	818,169,892	-	813,041,211	△5,128,681
カナダ・ドル	182,784,226	-	181,506,838	△1,277,388
シンガポール・ドル	39,477,916	-	39,206,889	△271,027
ニュージーランド・ドル	163,378,414	-	163,051,202	△327,212
ノルウェー・クローネ	35,011,265	-	34,842,465	△168,800
ユーロ	451,533,366	-	450,585,990	△947,376
合計	1,960,689,909	-	1,952,381,737	△8,308,172

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2025年12月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.0108円 (40,108円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年12月5日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	276,377,522
国債証券	99,384,592,170
地方債証券	5,001,668,635
特殊債券	4,413,423,466
社債券	6,929,109,300
未収利息	266,494,340
前払費用	45,837,628
流動資産合計	116,317,503,061
資産合計	116,317,503,061
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,708,340
流動負債合計	7,708,340
負債合計	7,708,340
純資産の部	
元本等	

元本	※1	103,259,884,339
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		13,049,910,382
元本等合計		116,309,794,721
純資産合計		116,309,794,721
負債純資産合計		116,317,503,061

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月6日 至2025年12月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2025年12月5日現在
1. ※1 期首	2025年6月6日
期首元本額	90,273,892,056円
期中追加設定元本額	13,591,449,571円
期中一部解約元本額	605,457,288円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	5,924,685,014円
日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	38,035,115,795円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	2,321,864,517円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	11,904,814,357円
ダイワ・ライフ・バランス３０	15,351,359,311円

ダイワ・ライフ・バランス５０	13,559,824,572円
ダイワ・ライフ・バランス７０	5,906,480,873円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	2,813,775,671円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	2,277,944,867円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	1,123,710,935円
ダイワつみたてインデックス日本債券	3,371,117,530円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	69,445,939円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	45,715,482円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	294,671,427円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	206,245,828円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	53,112,221円
計	103,259,884,339円
2.　期末日における受益権の総数	103,259,884,339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12月5日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2025年12月5日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2025年12月5日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1264円 (11,264円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年12月30日

Ⅰ	資産総額	146,417,456円
Ⅱ	負債総額	16,049円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	146,401,407円
Ⅳ	発行済数量	108,995,369口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3432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12月30日

Ⅰ	資産総額	596,196,420,962円
Ⅱ	負債総額	13,902,335,623円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	582,294,085,339円
Ⅳ	発行済数量	226,611,902,237口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5696円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2025年12月30日

Ⅰ	資産総額	116,888,650,745円
Ⅱ	負債総額	235,519,422円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	116,653,131,323円
Ⅳ	発行済数量	104,128,863,647口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1203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12月30日

Ⅰ	資産総額	920,890,694,269円
Ⅱ	負債総額	172,248,656円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	920,718,445,613円
Ⅳ	発行済数量	106,817,691,292口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	8.6195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12月30日

Ⅰ	資産総額	393,781,029,381円
Ⅱ	負債総額	42,214,925円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	393,738,814,456円
Ⅳ	発行済数量	96,567,012,315口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0774円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2025年12月末日現在

資本金の額　　414億2,454万1,896円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　326万657株

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

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品本部長

商品本部長は、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

運用チームまたは運用チームの戦略における基本的な運用方針を審議・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12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	84	399,990
追加型株式投資信託	768	37,412,564
株式投資信託　　合計	852	37,812,554
単位型公社債投資信託	69	145,956
追加型公社債投資信託	14	1,529,368
公社債投資信託　合計	83	1,675,324
総合計	935	39,487,878

３【委託会社等の経理状況】

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

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第66期事業年度（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。

また、第67期事業年度に係る中間会計期間（2025年４月１日から2025年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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	176	※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	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	－	－	－	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

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

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					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当期変動額						
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。

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

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。

①剰余金の配当の総額	16,551百万円
②配当の原資	利益剰余金
③１株当たり配当額	5,076円
④基準日	2025年３月31日
⑤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関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが１年以内の支払期日であります。

（３）金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(ⅰ)為替変動リスクの管理

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

(ⅱ)価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(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

(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)
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 利息の受取(注)	11,100 0	関係会社短期貸付金 ―	23,400 ―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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 利息の受取(注１)	63,600 89	関係会社短期貸付金 ―	70,000 ―
その他の関係会社	㈱かんぽ生命保険	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㈱	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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注２) 不動産の賃借料(注３)	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010

同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	―	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㈱	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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注２） 不動産の賃借料(注３)	15,779 1,038	未払手数料 長期差入保証金	3,657 1,037
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	―	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おりません。

(注２) １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自　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。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2025年９月30日)
資産の部	
流動資産	
現金・預金	4,296
有価証券	551
未収委託者報酬	20,930
関係会社短期貸付金	44,100
金銭の信託	19,355
その他	2,027
流動資産計	91,260

固定資産		
有形固定資産	※1	54
無形固定資産		
ソフトウェア		955
その他		165
無形固定資産計		1,121
投資その他の資産		
投資有価証券		10,809
関係会社株式		5,556
繰延税金資産		765
その他		1,096
投資その他の資産合計		18,226
固定資産計		19,403
資産合計		110,663

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2025年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		7,198
未払費用		4,757
未払法人税等		3,921
賞与引当金		969
その他	※2	1,065
流動負債計		17,912
固定負債		
退職給付引当金		2,338
役員退職慰労引当金		27
固定負債計		2,365
負債合計		20,278
純資産の部		
株主資本		
資本金		41,424
資本剰余金		
資本準備金		37,745
資本剰余金合計		37,745

利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	9,323
利益剰余金合計	9,697
株主資本合計	88,868
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,517
評価・換算差額等合計	1,517
純資産合計	90,385
負債・純資産合計	110,663

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 (自　2025年４月１日 至　2025年９月30日)
営業収益		
委託者報酬		48,780
その他営業収益		1,431
営業収益計		50,212
営業費用		
支払手数料		19,431
その他営業費用		11,139
営業費用計		30,571
一般管理費	※１	7,725
営業利益		11,915
営業外収益	※２	598
営業外費用	※３	707
経常利益		11,806
特別利益		－
特別損失		－
税引前中間純利益		11,806
法人税、住民税及び事業税		3,540
法人税等調整額		134
中間純利益		8,131

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2025年４月１日 至　2025年９月30日）

（単位:百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287
当中間期変動額						
新株の発行	－	－	－	－	－	－
剰余金の配当	－	－	－	△16,551	△16,551	△16,551
中間純利益	－	－	－	8,131	8,131	8,131
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当中間期変動額合計	－	－	－	△8,419	△8,419	△8,419
当中間期末残高	41,424	37,745	374	9,323	9,697	88,868

	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	1,361	1,361	98,649
当中間期変動額			
新株の発行	－	－	－
剰余金の配当	－	－	△ 16,551
中間純利益	－	－	8,131
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	155	155	155
当中間期変動額合計	155	155	△ 8,263
当中間期末残高	1,517	1,517	90,385

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

２．金銭の信託
時価法を採用しております。

３．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	**10～18年**
器具備品	**４～20年**

（２）無形固定資産

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

４．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

５．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。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 **（2025年９月30日現在）**
有形固定資産	**317百万円**

※２　消費税等の取扱い

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

３　保証債務

当中間会計期間（2025年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,421百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2025年４月　１日 至　2025年９月30日）
有形固定資産	7百万円
無形固定資産	237百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2025年４月　１日 至　2025年９月30日）
投資有価証券売却益	255百万円
有価証券償還益	138百万円
受取利息	125百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2025年４月　１日 至　2025年９月30日）
金銭の信託運用損	644百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2025年４月１日　至　2025年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　　**（単位：千株）**

	当事業年度期首株式数	当中間会計期間増加株式数	当中間会計期間減少株式数	当中間会計期間末株式数
発行済株式				
普通株式	3,260	－	－	3,260
合計	3,260	－	－	3,260

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2025年６月19日定時株主総会	普通株式	16,551	5,076	2025年３月31日	2025年６月20日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2025年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	2,489	8,527	－	11,017
金銭の信託	－	19,355	－	19,355
資産合計	2,489	27,883	－	30,372

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における無調整の相場価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としていることから、その時価をレベル２に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸等の取引先金融機関が提供する価格に基づき算定する資産の価格は、活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル２の時価に分類しております。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	342
子会社株式	3,528
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2025年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　3,528百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額(百万円)	取得原価(百万円)	差額(百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(１)株式	126	55	71
(２)その他	7,470	4,868	2,601
小計	7,596	4,923	2,673
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,420	3,879	△ 458
小計	3,420	3,879	△ 458
合計	11,017	8,802	2,214

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

（金銭の信託関係）

当中間会計期間（2025年９月30日）

運用目的の金銭の信託

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	当中間会計期間の損益に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	19,355	△ 644

（企業結合等関係）
（取得による企業結合）
当社は、2025年６月19日開催の当社取締役会において、投資商品の開発・運用・助言サービスを提供する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するための資金拠出を行うことを決議し、2025年７月１日付で同社の株式を取得いたしました。

１．企業結合の概要
（１）被取得企業の名称及び事業内容
名称：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社
事業内容：投資商品開発・運用・助言事業

（２）企業結合を行った主な理由
オルタナティブ投資に関わる知見やゲートキーパー機能を獲得することで、同領域におけるビジネス展開の足掛かりとするとともに、本件を契機により付加価値の高い事業領域への本格参入に向けて探索を進めるためです。

（３）企業結合日
2025年7月1日（株式取得日）
2025年6月30日（みなし取得日）

（４）企業結合の法的形式
現金による株式の取得

（５）結合後企業の名称
大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社

（６）取得した議決権比率
51%

（７）取得企業を決定するに至った主な根拠
当社が現金を対価として株式を取得したためです。

２．被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳
現金 2,142百万円

３．主要な取得関連費用の内容及び金額
アドバイザリー費用等 30百万円

（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48,780百万円、その他1,431百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報
（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2025年４月１日　至　2025年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2025年４月１日　至　2025年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2025年４月１日　至　2025年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2025年４月１日　至　2025年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2025年４月１日　至　2025年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自　2025年４月１日 至　2025年９月30日）	
１株当たり純資産額	27,720.07円
１株当たり中間純利益	2,493.87円

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2025年４月１日 至　2025年９月30日）	
中間純利益(百万円)	8,131
普通株式に係る中間純利益(百万円)	8,131
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	3,260,657

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2025年3月31日、株式会社大和証券グループ本社、株式会社かんぽ生命保険、三井物産株式会社、三井物産かんぽ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ぽ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】

	①　名　称	②　資本金の額 (2025年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	

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

２【関係業務の概要】

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

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

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

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7月25日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワつみたてインデックスバランス３０の2024年6月6日から2025年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワつみたてインデックスバランス３０の2025年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2025年４月１日から2026年３月31日までの第67期事業年度の中間会計期間（2025年４月１日から2025年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2025年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2025年４月１日から2025年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年1月23日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワつみたてインデックスバランス３０の2025年6月6日から2025年12月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワつみたてインデックスバランス３０の2025年12月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月6日から2025年12月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注) 1．　上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。