

【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3月11日提出 |
| 【発行者名】 | 大和アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 佐野 径 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 佐竹 優子 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【電話番号】 | 03-5555-3431 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | D C ダイワ・ターゲットイヤー2050 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 | 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当ありません。 |

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2050

(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。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2026年3月12日から2026年9月11日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの |
| 対象インデックス | 日経225 | 目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| | TOPIX | 目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| | その他の指数 | 目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| 特殊型 | ブル・ベア型 | 目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの |
| | 条件付運用型 | 目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの |
| | ロング・ショート型 / 絶対収益追求型 | 目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの |
| | その他型 | 目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの |

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの目的・特色 >

ファンドの目的

内外の株式、債券、リート(REIT)および短期金融資産に投資し、中長期的に安定した信託財産の成長をめざします。

ファンドの特色

1

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

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2050年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。
- 2050年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

< 2025年12月時点の基本配分比率 >

| | わが国の株式 | 海外の株式 | わが国のリート | 海外のリート | わが国の債券 | 海外の債券 |
|--------------------|--------|-------|---------|--------|--------|-------|
| DCダイワ・ターゲットイヤー2050 | 42% | 27% | 8% | 7% | 8% | 8% |

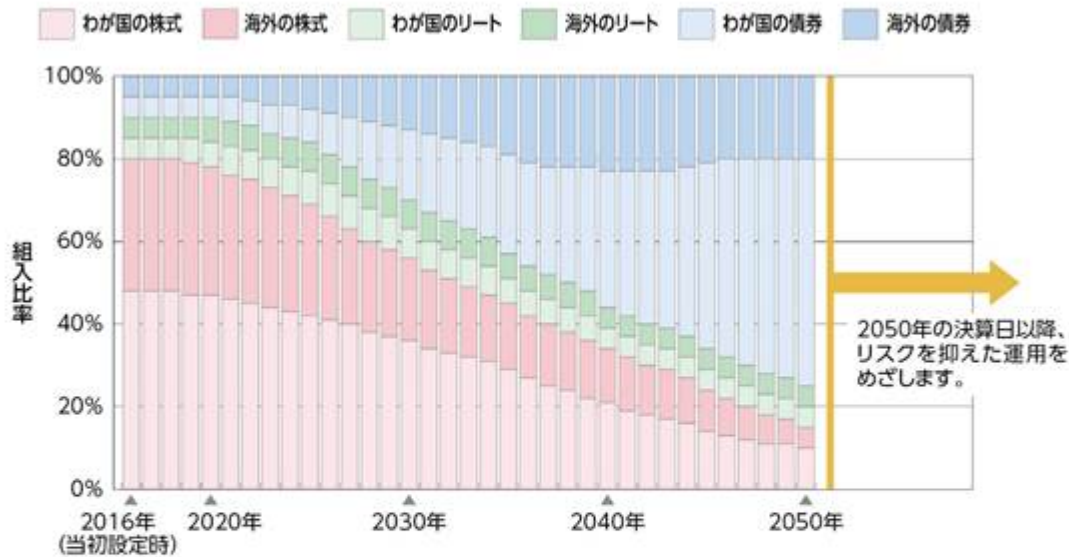
< 当初設定時の基本配分比率 >

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

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

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2025年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2024年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整(リバランス)を行なう場合があります。
- (注4) 投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

2

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

- 東京証券取引所上場株式(上場予定を含みます。)を投資対象とし、投資成果を東証株価指数(配当込み)の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
 - (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
 - (b) ポートフォリオは、東証株価指数(配当込み)における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数(配当込み)との連動性を維持するよう構築します。
 - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス



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

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

東証株価指数(TOPIX)とは

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

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

3

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

運用プロセス



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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

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

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

運用プロセス



- 組入銘柄はベンチマークである「東証REIT指数」(配当込み)の構成銘柄(採用予定を含みます。)とし、組入比率を高位に保ちます。
- 組入銘柄それぞれの時価総額に応じた投資比率に基づきポートフォリオを構築することを基本とします。
- ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。
- 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワJ-REITマザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

東証REIT指数とは

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

配当込み東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、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準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

5

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

運用プロセス



- ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてベンチマークであるS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)の構成銘柄の全てに投資することをめざします。
ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。
- 運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)とは

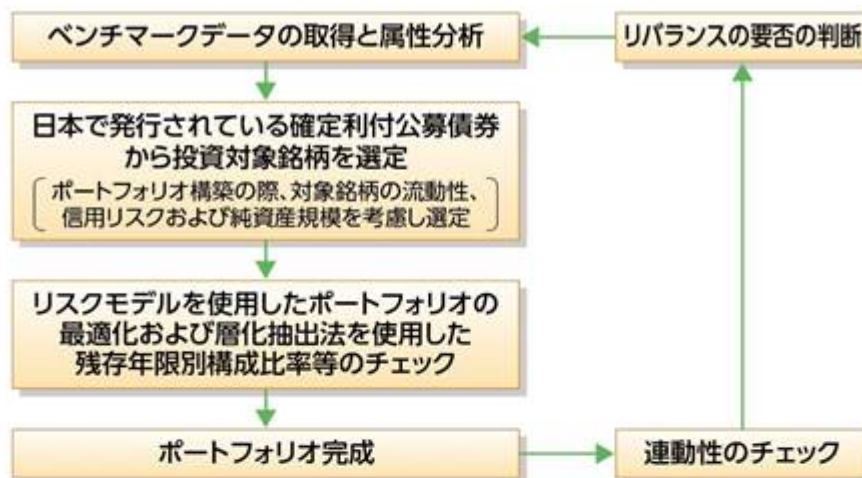
S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

6

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

運用プロセス



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

(注1)リスクモデルとは…

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

(注2)層化抽出法とは…

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

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

NOMURA-BPI総合指数とは

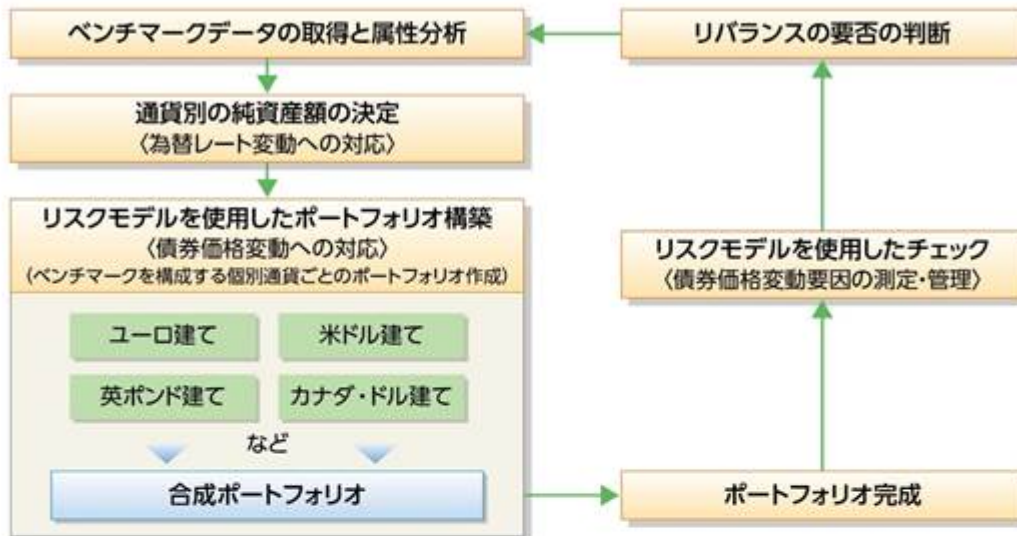
NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

7

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

運用プロセス



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

① 為替レート変動への対応

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

② 債券価格変動への対応

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

③ 債券価格変動要因の測定・管理

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

FTSE世界国債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。



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

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

NOMURA-BPI総合短期指数とは

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

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

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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

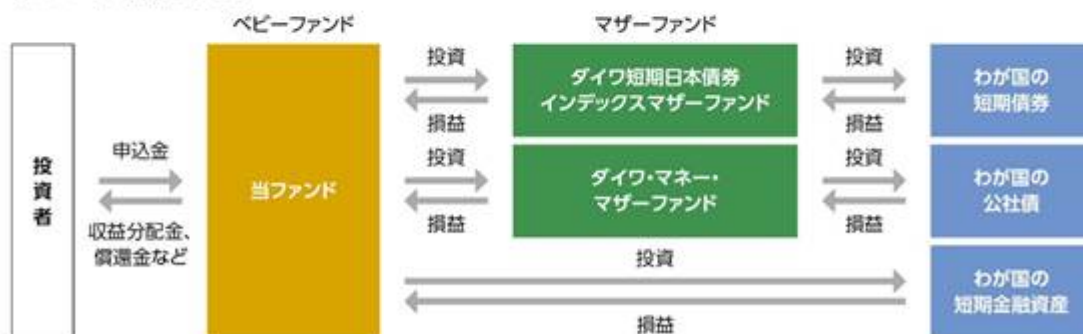
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

(2050年の決算日前日まで)



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

(2050年の決算日から)



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。

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

9

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

10

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

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

●分配方針

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

主な投資制限

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

(2)【ファンドの沿革】

2016年5月13日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

| | | |
|-------|------------------------|--|
| 受益者 | お申込者 | |
| | 収益分配金(注)、償還金など お申込金(3) | |
| お取扱窓口 | 販売会社 | <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 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</p> <p style="text-align: right;">など</p> |
| 1 | 収益分配金、償還金など お申込金(3) | |

| | | |
|------|---|---|
| 委託会社 | 大和アセットマネジメント株式会社 | 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など |
| 運用指図 | 2 | 損益 信託金(3) |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行 | 信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など |
| | | 損益 投資 |
| 投資対象 | 内外の株式・債券・リート（REIT）および短期金融資産 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。） | |

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から收受します。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 株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携
- 2025年 7月 1日 大和かんぼ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 |
|----------------|-------------------|----------------|------------|
| 株式会社大和証券グループ本社 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 | 株 2,608,525 | % 80.00 |
| 株式会社かんぼ生命保険 | 東京都千代田区大手町二丁目3番1号 | 株 652,132 | % 20.00 |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

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

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

投資態度

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

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

当初設定時の基本配分比率

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

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の32%

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

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券
.....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券
.....信託財産の純資産総額の 5%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の 5%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

(2)【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3. ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券

4. ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券

6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券

7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

8. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券

9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

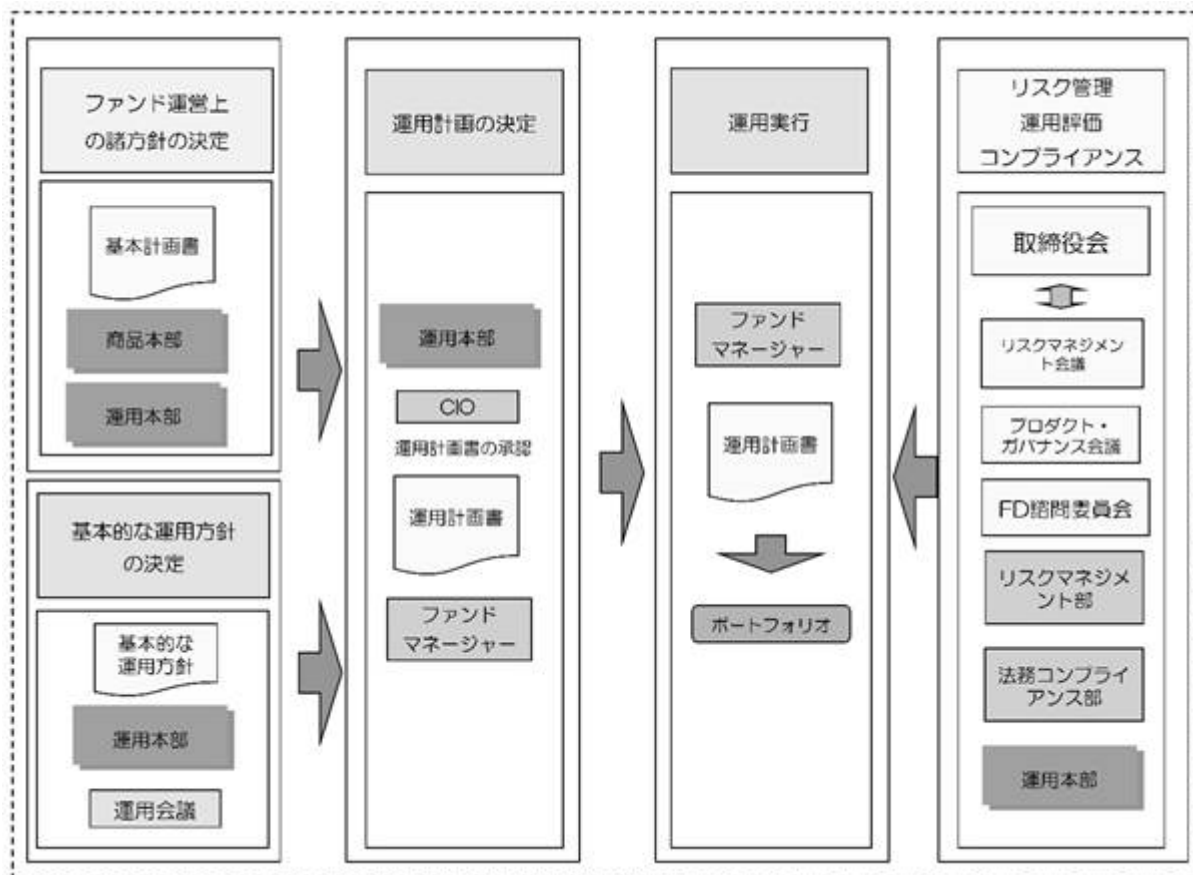
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品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。

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承認します。

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

リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2025年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)【配分方針】

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 各マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限ります。)
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

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

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

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

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

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
4. 外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

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

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

7．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

8. ダイワ・マネー・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

本邦通貨表示の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ. わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
10. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
11. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
12. 外国の者に対する権利で前11.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

投資信託証券

投資信託証券への投資は、行ないません。

同一銘柄の株式

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

同一銘柄の転換社債等

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

ロ．委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

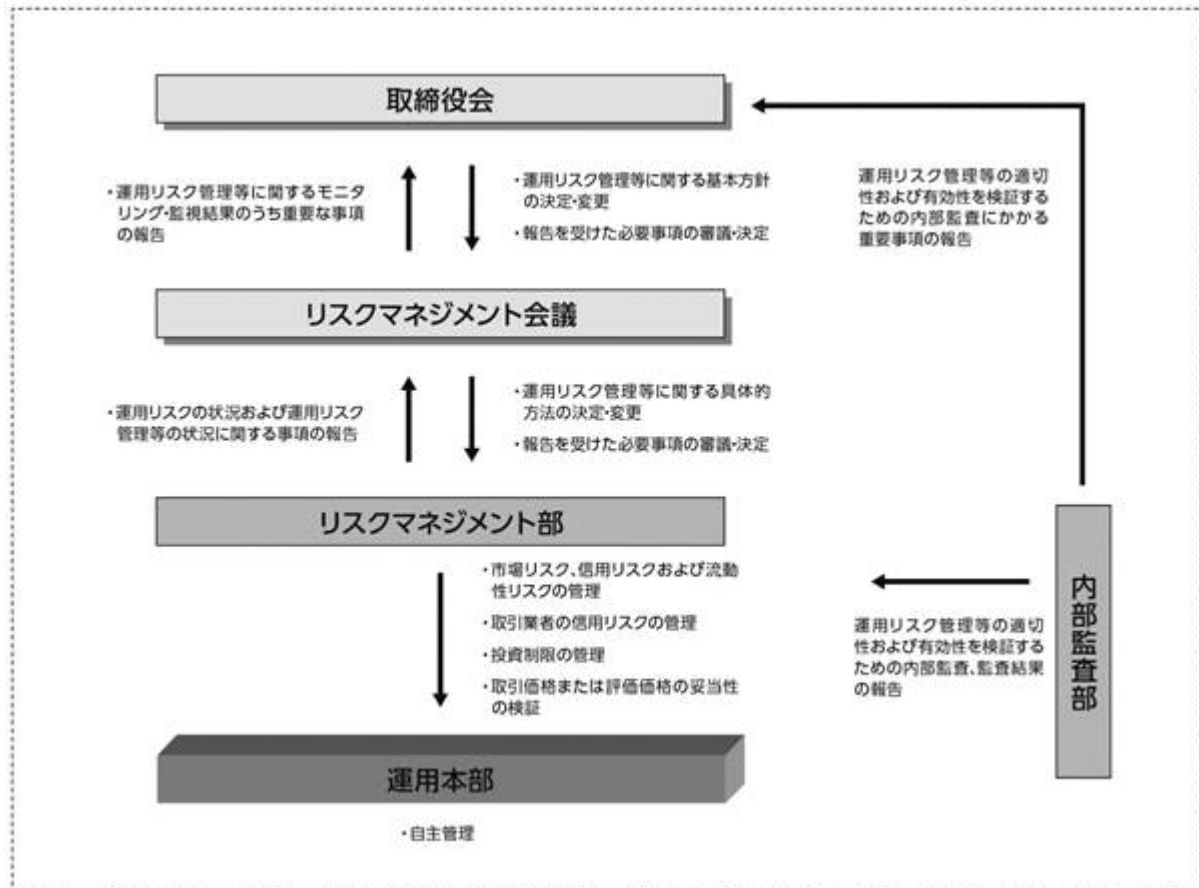
流動性リスクに関する事項

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付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・検証などを行いません。
- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。

また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

資産クラスの指数について

| | |
|---|--|
| 日本株 配当込みTOPIX | 配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社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準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。 |
| 先進国株 MSCIロクサイ・インデックス (配当込み、円ベース) | MSCIロクサイ・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) |
| 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 | 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算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。 |
| 先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | 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。 |
| 新興国債 JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース) | JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。 Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. |

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

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

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から第20計算期間まで >

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

< 第21計算期間から第30計算期間まで >

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

< 第31計算期間から第35計算期間まで >

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

< 第36計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315% および地方税5%) となります。

八．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」について

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

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

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

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

() 上記は、2025年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 | 1,430,993,061 | 99.81 |
| 内 日本 | 1,430,993,061 | 99.81 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 2,778,545 | 0.19 |
| 純資産総額 | 1,433,771,606 | 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）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|-----------------------------|----|-----------|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------|
| 1 | トピックス・インデックス・マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 233,453,627 | 2.5273 590,011,111 | 2.5696 599,882,439 | 41.84 |
| 2 | 外国株式インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 44,844,582 | 8.3483 374,376,989 | 8.6195 386,537,874 | 26.96 |
| 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 | 28,217,321 | 4.0313 113,752,821 | 4.0774 115,053,304 | 8.02 |
| 4 | ダイワ・REITマザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 28,678,863 | 3.9504 113,294,105 | 3.9892 114,405,720 | 7.98 |
| 5 | ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 110,435,188 | 1.0368 114,508,091 | 1.0354 114,344,593 | 7.98 |
| 6 | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 23,251,911 | 4.2648 99,166,146 | 4.3338 100,769,131 | 7.03 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

| | 純資産総額 (分配落) (円) | 純資産総額 (分配付) (円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末 (2016年12月19日) | 1,133,176 | 1,133,176 | 1.1332 | 1.1332 |
| 第2計算期間末 (2017年12月18日) | 1,335,634 | 1,335,634 | 1.2975 | 1.2975 |
| 第3計算期間末 (2018年12月18日) | 1,437,343 | 1,437,343 | 1.1966 | 1.1966 |
| 第4計算期間末 (2019年12月18日) | 19,747,038 | 19,747,038 | 1.3816 | 1.3816 |
| 第5計算期間末 (2020年12月18日) | 63,744,579 | 63,744,579 | 1.4508 | 1.4508 |
| 第6計算期間末 (2021年12月20日) | 457,362,711 | 457,362,711 | 1.7142 | 1.7142 |
| 第7計算期間末 (2022年12月19日) | 675,630,367 | 675,630,367 | 1.7323 | 1.7323 |
| 第8計算期間末 (2023年12月18日) | 967,175,428 | 967,175,428 | 2.0561 | 2.0561 |
| 第9計算期間末 (2024年12月18日) | 1,152,807,966 | 1,152,807,966 | 2.4549 | 2.4549 |
| 2024年12月末日 | 1,169,622,961 | - | 2.4970 | - |

| | | | | |
|---------------------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 2025年1月末日 | 1,178,127,906 | - | 2.4999 | - |
| 2月末日 | 1,135,804,184 | - | 2.4171 | - |
| 3月末日 | 1,125,396,260 | - | 2.3912 | - |
| 4月末日 | 1,120,643,755 | - | 2.3584 | - |
| 5月末日 | 1,172,269,219 | - | 2.4647 | - |
| 6月末日 | 1,209,414,356 | - | 2.5274 | - |
| 7月末日 | 1,266,534,755 | - | 2.6186 | - |
| 8月末日 | 1,290,578,404 | - | 2.6821 | - |
| 9月末日 | 1,335,193,868 | - | 2.7492 | - |
| 10月末日 | 1,394,994,053 | - | 2.8821 | - |
| 11月末日 | 1,407,638,491 | - | 2.9297 | - |
| 第10計算期間末 (2025年12月18日) | 1,405,702,783 | 1,405,702,783 | 2.9035 | 2.9035 |
| 12月末日 | 1,433,771,606 | - | 2.9568 | - |

【分配の推移】

| | 1口当たり分配金(円) |
|---------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000 |
| 第2計算期間 | 0.0000 |
| 第3計算期間 | 0.0000 |
| 第4計算期間 | 0.0000 |
| 第5計算期間 | 0.0000 |
| 第6計算期間 | 0.0000 |
| 第7計算期間 | 0.0000 |
| 第8計算期間 | 0.0000 |
| 第9計算期間 | 0.0000 |
| 第10計算期間 | 0.0000 |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 13.3 |
| 第2計算期間 | 14.5 |
| 第3計算期間 | 7.8 |
| 第4計算期間 | 15.5 |
| 第5計算期間 | 5.0 |
| 第6計算期間 | 18.2 |
| 第7計算期間 | 1.1 |
| 第8計算期間 | 18.7 |
| 第9計算期間 | 19.4 |

| | |
|---------|------|
| 第10計算期間 | 18.3 |
|---------|------|

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|---------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 0 | 0 |
| 第2計算期間 | 29,370 | 0 |
| 第3計算期間 | 248,633 | 76,842 |
| 第4計算期間 | 15,611,182 | 2,518,983 |
| 第5計算期間 | 66,431,048 | 36,786,378 |
| 第6計算期間 | 295,237,620 | 72,365,338 |
| 第7計算期間 | 229,640,562 | 106,439,426 |
| 第8計算期間 | 176,866,566 | 96,477,774 |
| 第9計算期間 | 118,084,432 | 118,893,881 |
| 第10計算期間 | 104,845,871 | 90,290,034 |

(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)

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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------------|----|----------------|-----------|-----|----------------|----------------|----------|
| 株価指数先物 取引 | 日本 | TOPIX 先物 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。

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)

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。

□ . 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。

八 . 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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------------|---------|-------------------------|-----------|-------------|----------------|----------------|----------|
| 株価指数先物 取引 | アメリカ | S&P500 EMINI MAR 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。

ダイワJ-REIT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(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 投資証券 | 245,207,068,500 | 95.95 |
| 内 日本 | 245,207,068,500 | 95.95 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 10,358,060,583 | 4.05 |
| 純資産総額 | 255,565,129,083 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------|----------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引(買建) | 10,291,620,000 | 4.03 |
| 内 日本 | 10,291,620,000 | 4.03 |

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

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

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

(2) 投資資産（2025年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|--------------|----|------|----------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------|
| 1 | 日本ビルファンド | 日本 | 投資証券 | 123,811 | 143,910.55 17,817,710,093 | 142,900.00 17,692,591,900 | 6.92 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 投資証券 | 107,189 | 131,292.26 14,073,086,393 | 130,900.00 14,031,040,100 | 5.49 |
| 3 | 日本都市ファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 108,372 | 116,660.05 12,642,683,876 | 124,100.00 13,448,965,200 | 5.26 |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------|----|------|---------|------------------------------|------------------------------|------|
| 4 | 野村不動産マスターF | 日本 | 投資証券 | 66,505 | 165,047.51 10,976,484,679 | 173,100.00 11,512,015,500 | 4.50 |
| 5 | KDX不動産投資法人 | 日本 | 投資証券 | 60,857 | 171,846.95 10,458,089,923 | 175,900.00 10,704,746,300 | 4.19 |
| 6 | GLP投資法人 | 日本 | 投資証券 | 68,672 | 136,701.69 9,387,578,847 | 148,900.00 10,225,260,800 | 4.00 |
| 7 | 日本プロロジスリート | 日本 | 投資証券 | 107,437 | 86,078.74 9,248,042,655 | 92,900.00 9,980,897,300 | 3.91 |
| 8 | 大和ハウスリート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 65,705 | 129,213.71 8,489,986,931 | 143,200.00 9,408,956,000 | 3.68 |
| 9 | オリックス不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 83,168 | 101,350.02 8,429,078,872 | 106,300.00 8,840,758,400 | 3.46 |
| 10 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 投資証券 | 48,117 | 182,699.55 8,790,954,325 | 183,000.00 8,805,411,000 | 3.45 |
| 11 | インヴィンシブル投資法人 | 日本 | 投資証券 | 115,207 | 67,392.17 7,764,049,912 | 64,400.00 7,419,330,800 | 2.90 |
| 12 | アドバンス・レジデンス | 日本 | 投資証券 | 42,975 | 168,027.18 7,220,968,217 | 171,400.00 7,365,915,000 | 2.88 |
| 13 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 76,795 | 88,974.99 6,832,835,071 | 81,800.00 6,281,831,000 | 2.46 |
| 14 | 日本プライムリアルティ | 日本 | 投資証券 | 57,873 | 106,195.60 6,145,858,088 | 105,700.00 6,117,176,100 | 2.39 |
| 15 | 産業ファンド | 日本 | 投資証券 | 38,212 | 130,231.34 4,976,400,075 | 154,200.00 5,892,290,400 | 2.31 |
| 16 | 三井不ロジパーク | 日本 | 投資証券 | 46,085 | 109,998.34 5,069,273,646 | 122,100.00 5,626,978,500 | 2.20 |
| 17 | 積水ハウス・リート投資 | 日本 | 投資証券 | 61,604 | 81,624.91 5,028,421,294 | 90,000.00 5,544,360,000 | 2.17 |
| 18 | 三井不動産アコモデーションファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 36,032 | 129,939.59 4,681,983,514 | 134,400.00 4,842,700,800 | 1.89 |
| 19 | API投資法人 | 日本 | 投資証券 | 32,223 | 138,141.08 4,451,320,095 | 140,800.00 4,536,998,400 | 1.78 |
| 20 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 41,376 | 98,055.56 4,057,147,238 | 104,100.00 4,307,241,600 | 1.69 |
| 21 | ラサールロジポート投資 | 日本 | 投資証券 | 27,057 | 142,250.25 3,848,865,105 | 158,600.00 4,291,240,200 | 1.68 |
| 22 | 森ヒルズリート | 日本 | 投資証券 | 24,156 | 141,483.96 3,417,686,613 | 149,000.00 3,599,244,000 | 1.41 |
| 23 | コンフォリア・レジデンシャル | 日本 | 投資証券 | 10,581 | 325,083.92 3,439,713,047 | 333,500.00 3,528,763,500 | 1.38 |

| | | | | | | | |
|----|----------------|----|------|--------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 24 | 大和証券リビング投資法人 | 日本 | 投資証券 | 30,557 | 110,042.45 3,362,567,225 | 114,100.00 3,486,553,700 | 1.36 |
| 25 | イオンリート投資 | 日本 | 投資証券 | 25,343 | 134,598.69 3,411,134,752 | 137,300.00 3,479,593,900 | 1.36 |
| 26 | フロンティア不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 36,680 | 90,531.94 3,320,711,590 | 93,000.00 3,411,240,000 | 1.33 |
| 27 | ヒューリックリート投資法 | 日本 | 投資証券 | 18,442 | 168,680.07 3,110,797,948 | 176,500.00 3,255,013,000 | 1.27 |
| 28 | 大和証券オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 8,526 | 376,541.27 3,210,390,870 | 374,500.00 3,192,987,000 | 1.25 |
| 29 | 森トラストリート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 40,228 | 76,425.21 3,074,433,490 | 78,100.00 3,141,806,800 | 1.23 |
| 30 | NTT都市開発リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 21,015 | 137,526.58 2,890,121,216 | 140,400.00 2,950,506,000 | 1.15 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 投資証券 | 95.95% |
| 合計 | 95.95% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|-----------------|----|----------------|-----------|-------|---------------|----------------|----------|
| 不動産投信指 数先物取引 | 日本 | TREIT 先物 0803月 | 買建 | 5,160 | 9,931,452,000 | 10,291,620,000 | 4.03% |

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

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

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年12月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | | 1,443,915,807 | 2.38 |
| | 内 アメリカ | 1,443,915,807 | 2.38 |
| 投資証券 | | 57,817,319,489 | 95.50 |
| | 内 ガーンジー | 75,269,382 | 0.12 |
| | 内 韓国 | 121,229,550 | 0.20 |
| | 内 香港 | 512,856,796 | 0.85 |
| | 内 シンガポール | 2,139,897,422 | 3.53 |
| | 内 イスラエル | 118,993,036 | 0.20 |
| | 内 イギリス | 2,385,349,087 | 3.94 |
| | 内 アイルランド | 19,956,985 | 0.03 |
| | 内 オランダ | 85,712,691 | 0.14 |
| | 内 ベルギー | 602,932,275 | 1.00 |
| | 内 フランス | 1,200,680,174 | 1.98 |
| | 内 ドイツ | 12,220,965 | 0.02 |
| | 内 スペイン | 276,239,803 | 0.46 |
| | 内 イタリア | 7,173,548 | 0.01 |
| | 内 カナダ | 723,747,781 | 1.20 |
| | 内 アメリカ | 44,684,130,690 | 73.80 |
| | 内 オーストラリア | 4,778,773,762 | 7.89 |
| | 内 ニュージーランド | 72,155,542 | 0.12 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 1,282,397,232 | 2.12 |
| 純資産総額 | | 60,543,632,528 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------|--------|---------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引(買建) | | 1,647,767,222 | 2.72 |
| | 内 ドイツ | 418,060,440 | 0.69 |
| | 内 アメリカ | 1,229,706,782 | 2.03 |
| 為替予約取引(買建) | | 624,543,220 | 1.03 |
| | 内 日本 | 624,543,220 | 1.03 |

(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)

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 | WELLTOWER INC | アメリカ | 投資証券 | 165,477 | 32,447.52 5,369,323,135 | 29,690.03 4,913,018,484 | 8.11 |
| 2 | PROLOGIS REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 223,955 | 20,118.74 4,505,693,289 | 20,114.82 4,504,816,484 | 7.44 |
| 3 | EQUINIX REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 23,673 | 117,955.90 2,792,371,405 | 119,768.40 2,835,277,333 | 4.68 |
| 4 | SIMON PROPERTY GROUP REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 78,712 | 29,166.18 2,295,735,517 | 29,373.78 2,312,069,538 | 3.82 |
| 5 | REALTY INCOME REIT CORP | アメリカ | 投資証券 | 221,794 | 9,014.41 1,999,373,344 | 8,894.17 1,972,674,339 | 3.26 |
| 6 | DIGITAL REALTY TRUST REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 77,851 | 25,027.83 1,948,449,250 | 24,368.56 1,897,117,076 | 3.13 |
| 7 | GOODMAN GROUP UNITS | オーストラリア | 投資証券 | 514,406 | 3,109.38 1,599,485,919 | 3,282.96 1,688,775,556 | 2.79 |
| 8 | PUBLIC STORAGE REIT | アメリカ | 投資証券 | 38,075 | 42,937.20 1,634,834,192 | 40,599.13 1,545,812,225 | 2.55 |
| 9 | VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND;ET | アメリカ | 投資信託 受益証券 | 103,580 | 14,098.69 1,460,358,818 | 13,940.10 1,443,915,807 | 2.38 |
| 10 | VENTAS REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 113,255 | 12,611.37 1,428,308,304 | 12,470.00 1,412,290,303 | 2.33 |
| 11 | VICI PPTYS INC | アメリカ | 投資証券 | 257,696 | 4,508.30 1,161,809,702 | 4,430.64 1,141,760,267 | 1.89 |
| 12 | EXTRA SPACE STORAGE REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 51,174 | 20,840.01 1,066,473,951 | 20,468.65 1,047,462,920 | 1.73 |
| 13 | AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 34,098 | 28,478.73 971,069,869 | 28,791.38 981,728,612 | 1.62 |
| 14 | IRON MOUNTAIN INC | アメリカ | 投資証券 | 71,268 | 13,500.01 962,121,562 | 12,936.55 921,962,245 | 1.52 |
| 15 | EQUITY RESIDENTIAL REIT | アメリカ | 投資証券 | 83,478 | 9,666.64 806,958,471 | 9,907.11 827,026,296 | 1.37 |
| 16 | ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 15,528 | 41,254.34 640,597,526 | 41,173.71 639,345,437 | 1.06 |

| | | | | | | | |
|----|------------------------------------|---------|------|-----------|--------------------------|--------------------------|------|
| 17 | MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | アメリカ | 投資証券 | 28,229 | 21,270.08 600,434,616 | 21,790.02 615,110,497 | 1.02 |
| 18 | INVITATION HOMES INC | アメリカ | 投資証券 | 135,978 | 4,411.54 599,891,838 | 4,342.97 590,548,973 | 0.98 |
| 19 | SCENTRE GROUP UNIT | オーストラリア | 投資証券 | 1,325,831 | 428.08 567,604,242 | 439.19 582,299,407 | 0.96 |
| 20 | SUN COMMUNITIES REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 28,028 | 20,164.77 565,178,876 | 19,541.81 547,718,109 | 0.90 |
| 21 | W. P. CAREY REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 52,837 | 10,539.14 556,860,059 | 10,141.95 535,870,571 | 0.89 |
| 22 | KIMCO REALTY REIT CORP | アメリカ | 投資証券 | 163,275 | 3,232.49 527,805,455 | 3,192.25 521,215,990 | 0.86 |
| 23 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN | アメリカ | 投資証券 | 71,254 | 7,182.97 511,822,880 | 6,982.57 497,536,470 | 0.82 |
| 24 | SEGRO REIT PLC | イギリス | 投資証券 | 326,548 | 1,510.45 493,267,433 | 1,509.18 492,822,107 | 0.81 |
| 25 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT | アメリカ | 投資証券 | 68,235 | 6,818.34 465,252,976 | 6,996.66 477,417,532 | 0.79 |
| 26 | LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 香港 | 投資証券 | 659,374 | 741.38 488,853,452 | 700.12 461,641,848 | 0.76 |
| 27 | UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS | フランス | 投資証券 | 26,946 | 16,891.26 455,156,574 | 17,080.01 460,238,160 | 0.76 |
| 28 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I | アメリカ | 投資証券 | 46,733 | 9,838.23 459,773,073 | 9,537.63 445,722,306 | 0.74 |
| 29 | HOST HOTELS & RESORTS REIT INC | アメリカ | 投資証券 | 154,199 | 2,762.65 426,015,211 | 2,879.13 443,960,262 | 0.73 |
| 30 | CAMDEN PROPERTY TRUST REIT | アメリカ | 投資証券 | 25,652 | 16,650.62 427,124,077 | 17,220.03 441,728,322 | 0.73 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 投資信託受益証券 | 2.38% |
| 投資証券 | 95.50% |
| 合計 | 97.88% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|-----------------|------|------------------------------------|-----------|-----------|---------------|---------------|----------|
| 不動産投信指 数先物取引 | アメリカ | DOW JONES US REAL ESTATE MAR 26 | 買建 | 218 | 1,225,572,941 | 1,229,706,782 | 2.03% |
| | ドイツ | STOXX EUROPE 600 RE MAR 26 | 買建 | 360 | 407,269,172 | 418,060,440 | 0.69% |
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2026年1 月 | 買建 | 2,626,200 | 410,587,068 | 410,862,636 | 0.68% |
| | | ユーロ買/円売 2026年1 月 | 買建 | 1,160,000 | 209,633,645 | 213,680,584 | 0.35% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2025年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 | 660,495,640 | 99.09 |
| 内 日本 | 660,495,640 | 99.09 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 6,059,366 | 0.91 |
| 純資産総額 | 666,555,006 | 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)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----|-----------|----|------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | 155 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 72,000,000 | 98.52 70,940,160 | 98.39 70,842,240 | 0.300000 2027/12/20 | 10.63 |
| 2 | 108 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 69,000,000 | 102.17 70,501,440 | 101.80 70,248,210 | 1.900000 2028/12/20 | 10.54 |
| 3 | 153 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 64,000,000 | 98.59 63,098,440 | 98.51 63,050,240 | 0.005000 2027/06/20 | 9.46 |
| 4 | 100 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 60,000,000 | 102.50 61,502,400 | 102.24 61,346,400 | 2.200000 2028/03/20 | 9.20 |
| 5 | 152 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 61,000,000 | 99.03 60,408,300 | 98.98 60,383,290 | 0.100000 2027/03/20 | 9.06 |
| 6 | 154 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 60,000,000 | 98.41 59,049,000 | 98.31 58,989,600 | 0.100000 2027/09/20 | 8.85 |
| 7 | 163 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 58,000,000 | 98.05 56,869,000 | 97.81 56,730,960 | 0.400000 2028/09/20 | 8.51 |
| 8 | 161 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 53,000,000 | 98.02 51,954,480 | 97.84 51,856,260 | 0.300000 2028/06/20 | 7.78 |
| 9 | 470 2年国債 | 日本 | 国債証券 | 32,000,000 | 99.92 31,975,040 | 99.85 31,954,240 | 0.800000 2027/03/01 | 4.79 |
| 10 | 473 2年国債 | 日本 | 国債証券 | 21,000,000 | 99.77 20,951,900 | 99.68 20,933,010 | 0.800000 2027/06/01 | 3.14 |
| 11 | 98 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 17,000,000 | 101.87 17,319,090 | 101.69 17,287,640 | 2.100000 2027/09/20 | 2.59 |
| 12 | 101 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 16,000,000 | 102.94 16,470,880 | 102.67 16,427,840 | 2.400000 2028/03/20 | 2.46 |
| 13 | 156 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 16,000,000 | 98.33 15,733,120 | 98.20 15,712,160 | 0.200000 2027/12/20 | 2.36 |
| 14 | 106 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 14,000,000 | 102.91 14,407,680 | 102.58 14,361,340 | 2.200000 2028/09/20 | 2.15 |
| 15 | 97 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 14,000,000 | 102.05 14,287,000 | 101.85 14,260,260 | 2.200000 2027/09/20 | 2.14 |
| 16 | 104 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 13,000,000 | 102.47 13,321,230 | 102.18 13,283,660 | 2.100000 2028/06/20 | 1.99 |
| 17 | 99 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 6,000,000 | 102.08 6,125,340 | 101.86 6,111,960 | 2.100000 2027/12/20 | 0.92 |
| 18 | 350 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,000,000 | 97.84 4,892,350 | 97.69 4,884,550 | 0.100000 2028/03/20 | 0.73 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------|----|------|-----------|--------------------|--------------------|------------------------|------|
| 19 | 352 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,000,000 | 97.24 4,862,450 | 97.01 4,850,700 | 0.100000 2028/09/20 | 0.73 |
| 20 | 469 2年国債 | 日本 | 国債証券 | 4,000,000 | 99.82 3,992,880 | 99.75 3,990,200 | 0.700000 2027/02/01 | 0.60 |
| 21 | 468 2年国債 | 日本 | 国債証券 | 3,000,000 | 99.74 2,992,290 | 99.69 2,990,880 | 0.600000 2027/01/01 | 0.45 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 国債証券 | 99.09% |
| 合計 | 99.09% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2025年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)

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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------|----|----------------------------|-----------|------------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 英ポンド買/円売 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・シユケル 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・リングgit 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

●DCダイワ・ターゲットイヤー2050

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 | 29,568円 |
| 純資産総額 | 14億円 |



| 基準価額の騰落率 | |
|----------|--------|
| 期間 | ファンド |
| 1か月間 | 0.9% |
| 3か月間 | 7.6% |
| 6か月間 | 17.0% |
| 1年間 | 18.4% |
| 3年間 | 74.5% |
| 5年間 | 102.4% |
| 設定来 | 195.7% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 第1期 | 第2期 | 第3期 | 第4期 | 第5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|-----|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | 16年12月 | 17年12月 | 18年12月 | 19年12月 | 20年12月 | 21年12月 | 22年12月 | 23年12月 | 24年12月 | 25年12月 |
| 分配金 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成 | 銘柄数 | 比率 | 通貨別構成 | 比率 | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位銘柄 | 国・地域名 | 比率 | |
|-------------|-------|-------|-----------|--------|--------------|---------------|-------------------|------|------|
| 国内株式・先物 | 1,659 | 41.8% | 日本円 | 57.9% | 直接利回り(%) | トヨタ自動車 | 日本 | 1.5% | |
| 外国株式・先物 | 1,097 | 26.6% | 米ドル | 29.9% | 最終利回り(%) | NVIDIA CORP | アメリカ | 1.5% | |
| 国内リート・先物 | 59 | 8.0% | ユーロ | 5.2% | 修正デュレーション | APPLE INC | アメリカ | 1.3% | |
| 国内債券 | 21 | 7.9% | 英ポンド | 1.8% | 残存年数 | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 1.3% | |
| 外国債券 | 1,057 | 7.8% | カナダドル | 1.2% | 債券格付別構成 | ソニーグループ | 日本 | 1.2% | |
| 外国リート・先物 | 294 | 7.3% | 豪ドル | 1.1% | AAA | 86.4% | WELLTOWER INC | アメリカ | 0.8% |
| 外国投資信託等 | 5 | 0.2% | オフショア人民元 | 0.9% | AA | 9.0% | PROLOGIS REIT INC | アメリカ | 0.6% |
| | | | スイス・フラン | 0.7% | A | 4.6% | 日本ビルファンド | 日本 | 0.6% |
| | | | シンガポール・ドル | 0.4% | BBB | - | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 0.4% |
| コール・ローン、その他 | 3.1% | 3.1% | その他 | 1.0% | BB | - | 日本都市ファンド投資法人 | 日本 | 0.4% |
| 合計 | 4,192 | - | 合計 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | 9.4% | |

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

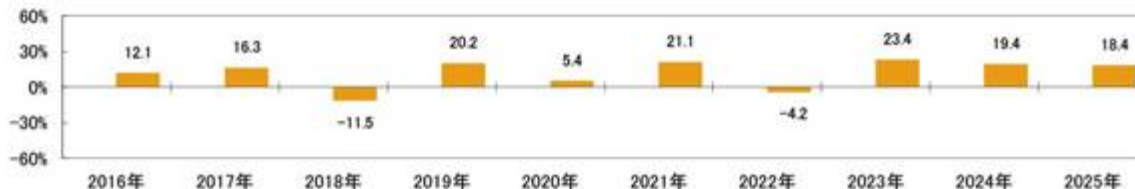
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(5月13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。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

〈参考情報〉ファンドの総経費率

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

※対象期間は2024年12月19日～2025年12月18日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電

信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

信託の終了

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

したときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<https://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金にかかる請求権 >

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

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

< 償還金にかかる請求権 >

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

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

< 換金請求権 >

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2024年12月19日から2025年12月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2050

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第9期 2024年12月18日現在 | 第10期 2025年12月18日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 4,936,295 | 5,499,490 |
| 親投資信託受益証券 | 1,150,550,134 | 1,402,872,638 |
| 未収入金 | 3,261,000 | 2,686,000 |
| 流動資産合計 | 1,158,747,429 | 1,411,058,128 |
| 資産合計 | 1,158,747,429 | 1,411,058,128 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 3,651,221 | 2,684,635 |
| 未払受託者報酬 | 186,762 | 217,985 |
| 未払委託者報酬 | 2,054,877 | 2,398,310 |
| その他未払費用 | 46,603 | 54,415 |
| 流動負債合計 | 5,939,463 | 5,355,345 |
| 負債合計 | 5,939,463 | 5,355,345 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,469,590,791 | 1,484,146,628 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 683,217,175 | 921,556,155 |
| （分配準備積立金） | 267,613,034 | 426,688,003 |
| 元本等合計 | 1,152,807,966 | 1,405,702,783 |
| 純資産合計 | 1,152,807,966 | 1,405,702,783 |
| 負債純資産合計 | 1,158,747,429 | 1,411,058,128 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第9期 | | 第10期 | |
|---|-----|------------------------------|------|------------------------------|
| | 自 | 2023年12月19日 至 2024年12月18日 | 自 | 2024年12月19日 至 2025年12月18日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 4,644 | | 19,385 |
| 有価証券売買等損益 | | 189,871,845 | | 221,775,504 |
| 営業収益合計 | | 189,876,489 | | 221,794,889 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 34 | | - |
| 受託者報酬 | | 362,317 | | 406,597 |
| 委託者報酬 | | 3,986,430 | | 4,473,533 |
| その他費用 | | 90,418 | | 101,487 |
| 営業費用合計 | | 4,439,199 | | 4,981,617 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 185,437,290 | | 216,813,272 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 185,437,290 | | 216,813,272 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 185,437,290 | | 216,813,272 |
| 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（ ） | | 26,716,874 | | 11,613,231 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 496,775,188 | | 683,217,175 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 156,283,196 | | 164,812,887 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 156,283,196 | | 164,812,887 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 128,561,625 | | 131,673,948 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 128,561,625 | | 131,673,948 |
| 分配金 | | 1 - | | 1 - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 683,217,175 | | 921,556,155 |

(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10期 |
|-----------------|--|
| | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 第9期 | 第10期 |
|-------------------------|---------------|---------------|
| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
| 1. 1 期首元本額 | 470,400,240円 | 469,590,791円 |
| 期中追加設定元本額 | 118,084,432円 | 104,845,871円 |
| 期中一部解約元本額 | 118,893,881円 | 90,290,034円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の 総数 | 469,590,791口 | 484,146,628口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分 | 第9期 | 第10期 |
|------------|---|--|
| | 自2023年12月19日 至2024年12月18日 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
| 1 分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 (4,408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 (158,715,429円)、投資信託約 款に規定される収益調整金 (415,604,141円)及び分配準備 積立金(108,893,197円)より分 配対象額は683,217,175円(1万 口当たり14,549.20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 (18,657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 (205,181,384円)、投資信託約 款に規定される収益調整金 (494,868,152円)及び分配準備 積立金(221,487,962円)より分 配対象額は921,556,155円(1万 口当たり19,034.65円)であり、 分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 第10期 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 第10期 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第9期 2024年12月18日現在 | 第10期 2025年12月18日現在 |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 165,896,416 | 211,380,422 |
| 合計 | 165,896,416 | 211,380,422 |

（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9期 2024年12月18日現在 | 第10期 2025年12月18日現在 |
|----------------------|-----------------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第10期 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第9期 2024年12月18日現在 | 第10期 2025年12月18日現在 |
|--------------|----------------------|-----------------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.4549円 | 2.9035円 |
| （1万口当たり純資産額） | （24,549円） | （29,035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 | 232,867,249 | 588,502,111 | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|---------------|--|
| 外国株式インデックスマザーファンド | 44,912,318 | 374,887,609 | |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 28,034,880 | 113,008,601 | |
| ダイワJ - R E I Tマザーファンド | 29,043,888 | 114,732,070 | |
| ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド | 23,142,505 | 98,698,155 | |
| ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド | 109,021,210 | 113,044,092 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 1,402,872,638 | |
| 合計 | | 1,402,872,638 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2024年12月18日現在 金額（円） | 2025年12月18日現在 金額（円） |
|---------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 18,115,112,162 | 19,810,356,005 |
| 株式 | 400,098,341,150 | 561,088,476,920 |

| | | | |
|-----------------|---|-----------------|-----------------|
| 派生商品評価勘定 | | 317,850 | 127,250 |
| 未収入金 | | 606,500 | - |
| 未収配当金 | | 40,745,686 | 48,564,041 |
| 前払金 | | 20,385,000 | 26,130,000 |
| その他未収収益 | 4 | 7,066,226 | 11,446,978 |
| 差入委託証拠金 | | - | 63,622,860 |
| 流動資産合計 | | 418,282,574,574 | 581,048,724,054 |
| 資産合計 | | 418,282,574,574 | 581,048,724,054 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 34,588,400 | 71,213,550 |
| 未払解約金 | | 143,616,770 | 719,223,980 |
| 未払利息 | | 1,160,023 | 2,278,600 |
| 受入担保金 | | 12,735,844,660 | 10,254,398,561 |
| 流動負債合計 | | 12,915,209,853 | 11,047,114,691 |
| 負債合計 | | 12,915,209,853 | 11,047,114,691 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 202,918,715,077 | 225,546,566,885 |
| 剰余金 | | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 202,448,649,644 | 344,455,042,478 |
| 元本等合計 | | 405,367,364,721 | 570,001,609,363 |
| 純資産合計 | | 405,367,364,721 | 570,001,609,363 |
| 負債純資産合計 | | 418,282,574,574 | 581,048,724,054 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|--------------------|------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| 1. 1 期首 | 2023年12月19日 | 2024年12月19日 |
| 期首元本額 | 167,363,042,675円 | 202,918,715,077円 |
| 期中追加設定元本額 | 54,208,209,542円 | 53,198,902,810円 |
| 期中一部解約元本額 | 18,652,537,140円 | 30,571,051,002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 | 2,749,376,688円 | 2,731,605,500円 |
| ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA | 3,722,637,732円 | 3,383,151,818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 | 904,647円 | 898,339円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 8,959,470円 | 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) | 127,893,647円 | 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) | 11,283,120円 | 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) | 302,620,796円 | 205,657,242円 |
| 国内株式ファンド(適格機関投 資家専用) | 1,171,311,234円 | 1,419,979,170円 |
| 日本株式インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用) | 862,207,445円 | 922,419,969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) | 963,731,047円 | 156,533,865円 |
| D-I's TOPIXインデッ クス | 11,679,154円 | 9,973,569円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 246,515,707円 | 232,867,249円 |
| iFree TOPIXインデッ クス | 9,959,603,282円 | 11,717,086,512円 |
| iFree 8資産バランス | 5,200,333,681円 | 5,526,666,419円 |
| iFree 年金バランス | 1,228,550,661円 | 1,245,644,827円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 4,364,951円 | 6,079,864円 |
| DCダイワ日本株式インデック ス | 72,963,753,872円 | 70,964,159,641円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30 | 2,973,734,629円 | 2,625,742,895円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50 | 5,197,844,995円 | 5,127,917,409円 |
| ダイワ・ライフ・バランス70 | 6,247,921,235円 | 6,163,501,893円 |
| 年金ダイワ日本株式インデック ス | 10,598,144,797円 | 10,504,216,260円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 48,865,163円 | 37,305,727円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 76,595,831円 | 75,475,909円 |
| ダイワつみたてインデックス日 本株式 | 6,604,969,865円 | 8,110,537,056円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス30 | 12,474,384円 | 11,518,163円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス50 | 14,025,228円 | 15,557,473円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス70 | 83,687,341円 | 295,812,368円 |
| ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用) | 24,141,805,204円 | 33,566,457,270円 |

| | | |
|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| ダイワ世界バランスファンド4 0VA | 47,149,049円 | 36,779,842円 |
| ダイワ世界バランスファンド6 0VA | 19,954,146円 | 15,785,951円 |
| ダイワ・バランスファンド35 VA | 2,951,993,147円 | 2,179,338,998円 |
| ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用) | 278,988,473円 | 204,073,989円 |
| ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用) | 39,319,630円 | 25,994,337円 |
| ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用) | 53,700,842円 | 36,041,308円 |
| ダイワ・ノーロードTOPIX ファンド | 234,374,933円 | 218,820,591円 |
| ダイワファンドラップTOPI Xインデックス | 15,707,598,819円 | 21,493,105,629円 |
| ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用) | 14,902,340,770円 | 20,832,208,529円 |
| ダイワファンドラップオンライ ンTOPIXインデックス | 3,541,584,334円 | 3,187,805,090円 |
| スタイル9(4資産分散・保守 型) | 886,764円 | 1,607,988円 |
| スタイル9(4資産分散・ balan ス型) | 6,283,264円 | 11,159,551円 |
| スタイル9(4資産分散・積極 型) | 9,095,535円 | 17,907,573円 |
| スタイル9(6資産分散・保守 型) | 367,913円 | 701,494円 |
| スタイル9(6資産分散・ balan ス型) | 11,597,753円 | 20,310,693円 |
| スタイル9(6資産分散・積極 型) | 13,270,370円 | 24,660,544円 |
| スタイル9(8資産分散・保守 型) | 577,437円 | 1,096,436円 |
| スタイル9(8資産分散・ balan ス型) | 9,307,452円 | 18,694,666円 |
| スタイル9(8資産分散・積極 型) | 28,207,165円 | 51,648,049円 |
| ダイワ国内株式インデックス (投資一任専用) | 4,999,558円 | 3,366,404,183円 |
| ダイワ・インデックスセレクト TOPIX | 976,015,710円 | 847,252,411円 |

| | | | |
|----|-----------------------------------|---|---|
| | ダイワライフスタイル2 5 | 92,382,825円 | 72,022,380円 |
| | ダイワライフスタイル5 0 | 431,876,444円 | 363,352,487円 |
| | ダイワライフスタイル7 5 | 379,440,247円 | 335,370,055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） | 7,641,606,691円 | 7,031,856,337円 |
| 計 | | 202,918,715,077円 | 225,546,566,885円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 202,918,715,077口 | 225,546,566,885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 12,125,038,290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 9,783,411,200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 1,018,970,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,114,135,000円 |
| 5. | 4 その他未収収益 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|----|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 13,825,653,988 | 33,958,854,756 |
| 合計 | 13,825,653,988 | 33,958,854,756 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | (円) | うち 1年超 | | | (円) | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 株値指数 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 5,510,405,000 | - | 5,476,245,000 | 34,160,000 | 9,020,510,000 | - | 8,949,570,000 | 70,940,000 |
| 合計 | 5,510,405,000 | - | 5,476,245,000 | 34,160,000 | 9,020,510,000 | - | 8,949,570,000 | 70,940,000 |

(注) 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.9977円 | 2.5272円 |
| (1万口当たり純資産額) | (19,977円) | (25,272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 | 6,900 | 4,740.00 | 32,706,000 | 貸付株式数 2,700株 |
| ニッスイ | 151,400 | 1,200.00 | 181,680,000 | |
| マルハニチロ | 26,700 | 3,825.00 | 102,127,500 | |
| ユキグニファクトリー | 14,100 | 1,042.00 | 14,692,200 | 貸付株式数 5,400株 |
| カネコ種苗 | 4,700 | 1,551.00 | 7,289,700 | |
| サカタのタネ | 20,000 | 4,190.00 | 83,800,000 | 貸付株式数 100株 |
| ホクト | 14,700 | 2,063.00 | 30,326,100 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| ショーボンドHD | 21,700 | 5,123.00 | 111,169,100 | |
| ミライト・ワン | 56,300 | 3,365.00 | 189,449,500 | 貸付株式数 1,800株 |
| タマホーム | 10,400 | 3,570.00 | 37,128,000 | 貸付株式数 4,000株 |
| 住石ホールディングス | 14,800 | 521.00 | 7,710,800 | 貸付株式数 5,800株 |
| 日鉄鉱業 | 33,100 | 2,059.00 | 68,152,900 | 貸付株式数 12,700株 |
| 三井松島HLDGS | 20,100 | 1,359.00 | 27,315,900 | 貸付株式数 15,400株 |
| I N P E X | 554,600 | 3,115.00 | 1,727,579,000 | |
| 石油資源開発 | 101,900 | 1,526.00 | 155,499,400 | |
| K&Oエナジーグループ | 7,500 | 3,560.00 | 26,700,000 | |
| リョーサン菱洋HD | 23,800 | 3,010.00 | 71,638,000 | 貸付株式数 9,300株 |
| 第一カッター興業 | 4,200 | 1,386.00 | 5,821,200 | |
| 安藤・間 | 87,700 | 1,860.50 | 163,165,850 | |
| 東急建設 | 51,700 | 1,341.00 | 69,329,700 | |
| コムシスホールディングス | 58,600 | 4,363.00 | 255,671,800 | |
| ピーアールホールディングス | 24,200 | 336.00 | 8,131,200 | |
| 高松コンストラクションGP | 12,300 | 3,895.00 | 47,908,500 | 貸付株式数 1,900株 |
| 東建コーポレーション | 3,600 | 14,730.00 | 53,028,000 | |
| ヤマウラ | 9,300 | 1,473.00 | 13,698,900 | 貸付株式数 3,000株 |
| オリエンタル白石 | 61,100 | 409.00 | 24,989,900 | |
| 大成建設 | 96,800 | 14,270.00 | 1,381,336,000 | |
| 大林組 | 373,700 | 3,261.00 | 1,218,635,700 | |
| 清水建設 | 315,700 | 2,637.00 | 832,500,900 | |
| 長谷工コーポレーション | 106,000 | 3,068.00 | 325,208,000 | |
| 松井建設 | 9,400 | 1,460.00 | 13,724,000 | |
| 鹿島建設 | 256,100 | 5,786.00 | 1,481,794,600 | |
| 不動テトラ | 6,500 | 2,629.00 | 17,088,500 | 貸付株式数 2,500株 |
| 鉄建建設 | 7,300 | 4,245.00 | 30,988,500 | |
| 西松建設 | 18,400 | 5,733.00 | 105,487,200 | |
| 大豊建設 | 15,900 | 760.00 | 12,084,000 | |
| 奥村組 | 18,700 | 6,090.00 | 113,883,000 | |
| 東鉄工業 | 12,700 | 4,485.00 | 56,959,500 | |
| 浅沼組 | 46,300 | 1,037.00 | 48,013,100 | |
| 戸田建設 | 142,100 | 1,239.50 | 176,132,950 | |
| 熊谷組 | 68,600 | 1,514.00 | 103,860,400 | |
| 矢作建設 | 21,600 | 2,315.00 | 50,004,000 | |
| ピーエス・コンストラクション | 10,500 | 2,780.00 | 29,190,000 | |
| 日本ハウスHLDGS | 24,700 | 323.00 | 7,978,100 | 貸付株式数 7,600株 |
| 大東建託 | 197,300 | 3,017.00 | 595,254,100 | |

| | | | | |
|------------|---------|----------|---------------|---------------|
| 新日本建設 | 16,200 | 1,987.00 | 32,189,400 | |
| 東亜道路 | 17,800 | 1,649.00 | 29,352,200 | |
| 東亜建設 | 42,600 | 2,656.00 | 113,145,600 | |
| 日本国土開発 | 35,400 | 522.00 | 18,478,800 | |
| 若築建設 | 3,400 | 4,365.00 | 14,841,000 | |
| 五洋建設 | 163,800 | 1,468.50 | 240,540,300 | 貸付株式数 64,300株 |
| 世紀東急 | 18,100 | 1,621.00 | 29,340,100 | 貸付株式数 7,100株 |
| 福田組 | 4,000 | 7,640.00 | 30,560,000 | 貸付株式数 1,500株 |
| 住友林業 | 299,700 | 1,595.00 | 478,021,500 | |
| 大和ハウス | 319,600 | 5,267.00 | 1,683,333,200 | |
| ライト工業 | 22,000 | 3,405.00 | 74,910,000 | |
| 積水ハウス | 350,500 | 3,442.00 | 1,206,421,000 | |
| 日特建設 | 11,000 | 1,267.00 | 13,937,000 | |
| 北陸電気工事 | 6,600 | 1,413.00 | 9,325,800 | |
| ユアテック | 24,400 | 2,684.00 | 65,489,600 | |
| 日本リーテック | 9,000 | 2,210.00 | 19,890,000 | 貸付株式数 2,900株 |
| 四電工 | 14,500 | 1,487.00 | 21,561,500 | |
| 中電工 | 15,400 | 4,435.00 | 68,299,000 | |
| 関電工 | 63,300 | 4,829.00 | 305,675,700 | |
| きんでん | 79,300 | 6,611.00 | 524,252,300 | |
| 東京エネシス | 10,800 | 1,793.00 | 19,364,400 | 貸付株式数 4,700株 |
| トーエネック | 22,300 | 1,863.00 | 41,544,900 | |
| 住友電設 | 9,100 | 9,710.00 | 88,361,000 | |
| 日本電設工業 | 21,700 | 3,135.00 | 68,029,500 | |
| エクシオグループ | 110,300 | 2,462.00 | 271,558,600 | |
| 新日本空調 | 15,000 | 3,140.00 | 47,100,000 | |
| クラフティア | 25,000 | 7,546.00 | 188,650,000 | |
| 三機工業 | 23,600 | 5,620.00 | 132,632,000 | |
| 日揮ホールディングス | 125,900 | 1,819.50 | 229,075,050 | |
| 中外炉工業 | 3,100 | 4,245.00 | 13,159,500 | |
| 太平電業 | 23,000 | 2,175.00 | 50,025,000 | |
| 高砂熱学 | 61,900 | 4,485.00 | 277,621,500 | |
| 朝日工業社 | 12,000 | 3,390.00 | 40,680,000 | 貸付株式数 3,900株 |
| 明星工業 | 19,400 | 1,668.00 | 32,359,200 | |
| 大気社 | 29,600 | 3,295.00 | 97,532,000 | |
| ダイダン | 22,300 | 7,180.00 | 160,114,000 | |
| 日比谷総合設備 | 8,400 | 4,565.00 | 38,346,000 | 貸付株式数 1,800株 |
| ニッポン | 41,100 | 2,416.00 | 99,297,600 | |
| 日清製粉G本社 | 115,200 | 1,904.00 | 219,340,800 | |
| 日東富士製粉 | 2,100 | 7,120.00 | 14,952,000 | |

| | | | | | |
|-----------------------|-----------|----------|-------------|-------|---------|
| 昭和産業 | 9,800 | 2,873.00 | 28,155,400 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| 中部飼料 | 14,700 | 1,763.00 | 25,916,100 | | |
| フィード・ワン | 15,300 | 1,050.00 | 16,065,000 | | |
| 日本甜菜糖 | 6,100 | 3,635.00 | 22,173,500 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| DM三井製糖 | 9,700 | 3,265.00 | 31,670,500 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| ウェルネオシュガー | 6,500 | 2,832.00 | 18,408,000 | | |
| L I F U L L | 35,500 | 173.00 | 6,141,500 | 貸付株式数 | 13,900株 |
| M I X I | 22,000 | 2,716.00 | 59,752,000 | | |
| ジェイエシーリクルート メント | 43,800 | 1,095.00 | 47,961,000 | | |
| 日本M&Aセンターホールデ ィングス | 192,900 | 716.60 | 138,232,140 | 貸付株式数 | 75,800株 |
| フィットイージー | 2,700 | 2,528.00 | 6,825,600 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| メンバーズ | 4,100 | 1,241.00 | 5,088,100 | | |
| UTグループ | 15,800 | 2,868.00 | 45,314,400 | | |
| アイティメディア | 6,500 | 1,495.00 | 9,717,500 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| E・Jホールディングス | 8,000 | 1,701.00 | 13,608,000 | | |
| オープンアップグループ | 40,400 | 1,870.00 | 75,548,000 | | |
| コシダカホールディングス | 33,200 | 1,202.00 | 39,906,400 | 貸付株式数 | 13,000株 |
| パソナグループ | 14,200 | 1,876.00 | 26,639,200 | 貸付株式数 | 5,500株 |
| リンクアンドモチベーショ ン | 28,800 | 507.00 | 14,601,600 | 貸付株式数 | 11,300株 |
| エス・エム・エス | 46,300 | 1,344.00 | 62,227,200 | | |
| パーソルホールディングス | 1,103,900 | 290.00 | 320,131,000 | | |
| クックパッド | 23,700 | 147.00 | 3,483,900 | 貸付株式数 | 12,100株 |
| 森永製菓 | 45,500 | 2,636.00 | 119,938,000 | | |
| 中村屋 | 2,900 | 3,065.00 | 8,888,500 | | |
| 江崎グリコ | 33,200 | 5,418.00 | 179,877,600 | | |
| me i t o | 5,100 | 2,355.00 | 12,010,500 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 井村屋グループ | 6,300 | 2,516.00 | 15,850,800 | | |
| 不二家 | 7,900 | 2,639.00 | 20,848,100 | 貸付株式数 | 3,100株 |
| 山崎製パン | 77,600 | 3,385.00 | 262,676,000 | | |
| モロゾフ | 11,200 | 1,515.00 | 16,968,000 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| 亀田製菓 | 7,400 | 3,925.00 | 29,045,000 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 寿スピリッツ | 61,700 | 1,824.00 | 112,540,800 | 貸付株式数 | 26,300株 |
| カルビー | 53,100 | 2,964.00 | 157,388,400 | | |
| 森永乳業 | 43,100 | 3,746.00 | 161,452,600 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 六甲バター | 9,500 | 1,245.00 | 11,827,500 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| ヤクルト | 160,900 | 2,438.50 | 392,354,650 | 貸付株式数 | 63,200株 |
| 明治ホールディングス | 161,600 | 3,410.00 | 551,056,000 | | |
| 雪印メグミルク | 31,200 | 3,275.00 | 102,180,000 | 貸付株式数 | 1,300株 |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| プリマハム | 15,600 | 2,655.00 | 41,418,000 | |
| 日本ハム | 43,600 | 6,829.00 | 297,744,400 | |
| 丸大食品 | 11,700 | 2,219.00 | 25,962,300 | |
| S Foods | 12,800 | 2,683.00 | 34,342,400 | |
| 柿安本店 | 4,900 | 2,633.00 | 12,901,700 | 貸付株式数 1,900株 |
| 伊藤ハム米久HLDGS | 20,300 | 5,690.00 | 115,507,000 | |
| 学情 | 5,500 | 1,750.00 | 9,625,000 | 貸付株式数 2,100株 |
| スタジオアリス | 6,100 | 2,037.00 | 12,425,700 | 貸付株式数 2,300株 (300株) |
| クロスキャット | 6,700 | 1,025.00 | 6,867,500 | 貸付株式数 100株 |
| システナ | 168,800 | 522.00 | 88,113,600 | |
| N J S | 2,700 | 5,300.00 | 14,310,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| デジタルアーツ | 6,200 | 6,300.00 | 39,060,000 | 貸付株式数 2,800株 |
| 日鉄ソリューションズ | 32,200 | 4,426.00 | 142,517,200 | 貸付株式数 15,400株 |
| A L S O K | 202,300 | 1,260.00 | 254,898,000 | |
| キューブシステム | 6,900 | 1,080.00 | 7,452,000 | 貸付株式数 600株 |
| いちご | 98,200 | 420.00 | 41,244,000 | |
| 日本駐車場開発 | 138,100 | 252.00 | 34,801,200 | |
| コア | 5,200 | 1,992.00 | 10,358,400 | |
| カカクコム | 78,600 | 2,229.00 | 175,199,400 | |
| セントケア・ホールディング グ | 8,500 | 1,219.00 | 10,361,500 | |
| ルネサンス | 9,400 | 1,061.00 | 9,973,400 | 貸付株式数 3,600株 (1,600株) |
| ディップ | 21,200 | 2,148.00 | 45,537,600 | 貸付株式数 8,100株 |
| SBSホールディングス | 10,500 | 3,770.00 | 39,585,000 | 貸付株式数 4,100株 |
| デジタルホールディングス | 5,900 | 2,014.00 | 11,882,600 | |
| 新日本科学 | 12,800 | 1,836.00 | 23,500,800 | 貸付株式数 4,900株 |
| エムスリー | 239,300 | 2,088.50 | 499,778,050 | |
| ワールドホールディングス | 5,600 | 2,615.00 | 14,644,000 | 貸付株式数 2,100株 |
| ディー・エヌ・エー | 48,400 | 2,549.50 | 123,395,800 | 貸付株式数 18,600株 |
| 博報堂 D Y HLDGS | 154,400 | 1,168.50 | 180,416,400 | |
| ぐるなび | 22,600 | 164.00 | 3,706,400 | 貸付株式数 8,700株 |
| タカミヤ | 16,400 | 414.00 | 6,789,600 | 貸付株式数 6,400株 |
| ファンコミュニケーションズ | 17,600 | 531.00 | 9,345,600 | 貸付株式数 3,600株 |
| ライク | 6,300 | 1,508.00 | 9,500,400 | 貸付株式数 2,300株 (2,000株) |
| エスプール | 31,300 | 261.00 | 8,169,300 | 貸付株式数 12,200株 |
| WDBホールディングス | 5,300 | 1,595.00 | 8,453,500 | 貸付株式数 2,000株 |

| | | | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|-------|---------|
| 手間いらず | 1,700 | 3,135.00 | 5,329,500 | 貸付株式数 | 500株 |
| アドウェイズ | 13,000 | 274.00 | 3,562,000 | 貸付株式数 | 4,800株 |
| バリューコマース | 10,600 | 688.00 | 7,292,800 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| インフォマート | 114,300 | 394.00 | 45,034,200 | 貸付株式数 | 44,800株 |
| サッポロホールディングス | 34,700 | 8,139.00 | 282,423,300 | | |
| アサヒグループホールディングン | 870,900 | 1,632.50 | 1,421,744,250 | | |
| キリンHD | 483,100 | 2,397.50 | 1,158,232,250 | | |
| シマダヤ | 5,400 | 1,761.00 | 9,509,400 | | |
| 宝ホールディングス | 95,600 | 1,603.00 | 153,246,800 | | |
| オエノンホールディングス | 34,700 | 509.00 | 17,662,300 | 貸付株式数 | 12,000株 |
| 養命酒 | 3,800 | 4,450.00 | 16,910,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| 飛島ホールディングス | 11,900 | 2,268.00 | 26,989,200 | | |
| コカ・コーラボトラーズJHD | 80,700 | 3,118.00 | 251,622,600 | 貸付株式数 | 29,600株 |
| ライフドリンクカンパニー | 20,700 | 1,767.00 | 36,576,900 | 貸付株式数 | 9,700株 |
| サントリー食品インター | 81,700 | 4,807.00 | 392,731,900 | | |
| ダイドーグループHD | 13,100 | 2,481.00 | 32,501,100 | 貸付株式数 | 5,100株 |
| 伊藤園 | 37,500 | 3,064.00 | 114,900,000 | 貸付株式数 | 14,700株 |
| キーコーヒー | 13,000 | 1,994.00 | 25,922,000 | 貸付株式数 | 5,000株 |
| 日清オイリオグループ | 16,300 | 5,190.00 | 84,597,000 | | |
| 不二製油 | 23,100 | 3,613.00 | 83,460,300 | | |
| J-オイルミルズ | 13,300 | 1,975.00 | 26,267,500 | | |
| インターメスティック | 5,400 | 1,990.00 | 10,746,000 | 貸付株式数 | 3,400株 |
| サンエー | 21,100 | 2,950.00 | 62,245,000 | | |
| カワチ薬品 | 9,700 | 2,935.00 | 28,469,500 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| エービーシー・マート | 65,400 | 2,703.00 | 176,776,200 | | |
| ハードオフコーポレーション | 4,900 | 1,980.00 | 9,702,000 | | |
| 高千穂交易 | 9,900 | 2,129.00 | 21,077,100 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| アスクル | 27,700 | 1,432.00 | 39,666,400 | 貸付株式数 | 10,800株 |
| ゲオホールディングス | 14,000 | 1,795.00 | 25,130,000 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| アンドエスティHD | 17,200 | 2,815.00 | 48,418,000 | 貸付株式数 | 6,200株 |
| リガク・ホールディングス | 70,900 | 1,114.00 | 78,982,600 | 貸付株式数 | 27,800株 |
| 伊藤忠食品 | 2,800 | 11,540.00 | 32,312,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| くら寿司 | 14,600 | 3,215.00 | 46,939,000 | 貸付株式数 | 5,700株 |
| キャンドウ | 4,400 | 3,410.00 | 15,004,000 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| バルグループHLDGS | 48,900 | 2,122.00 | 103,765,800 | | |
| エディオン | 59,200 | 2,101.00 | 124,379,200 | 貸付株式数 | 19,000株 |
| あらた | 19,100 | 3,085.00 | 58,923,500 | | |
| サーラコーポレーション | 26,200 | 1,101.00 | 28,846,200 | 貸付株式数 | 7,400株 |

| | | | | | |
|--------------------|---------|-----------|---------------|-------|---------------------|
| トーメンデバイス | 1,800 | 11,600.00 | 20,880,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| ハローズ | 5,700 | 4,640.00 | 26,448,000 | | |
| JPホールディングス | 31,000 | 681.00 | 21,111,000 | 貸付株式数 | 11,300株 |
| フジオフードG本社 | 20,300 | 1,176.00 | 23,872,800 | 貸付株式数 | 8,000株 (100株) |
| あみやき亭 | 9,000 | 1,366.00 | 12,294,000 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| 東京エレクトロデバイス | 12,400 | 3,215.00 | 39,866,000 | 貸付株式数 | 4,800株 |
| 円谷フィールズホールディ | 23,100 | 1,839.00 | 42,480,900 | 貸付株式数 | 9,000株 |
| 双日 | 120,200 | 4,781.00 | 574,676,200 | | |
| アルフレッサホールディン グス | 118,000 | 2,464.50 | 290,811,000 | | |
| 大黒天物産 | 4,500 | 5,780.00 | 26,010,000 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| ハニーズホールディングス | 11,100 | 1,534.00 | 17,027,400 | 貸付株式数 | 3,100株 |
| キッコーマン | 384,300 | 1,459.00 | 560,693,700 | | |
| 味の素 | 575,800 | 3,353.00 | 1,930,657,400 | | |
| ブルドックソ - ス | 6,100 | 1,849.00 | 11,278,900 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| キューピー | 62,300 | 4,360.00 | 271,628,000 | 貸付株式数 | 900株 |
| ハウス食品G本社 | 43,400 | 2,915.00 | 126,511,000 | | |
| カゴメ | 62,000 | 2,702.00 | 167,524,000 | 貸付株式数 | 23,900株 |
| アリアケジャパン | 13,000 | 5,260.00 | 68,380,000 | | |
| エバラ食品工業 | 2,900 | 2,512.00 | 7,284,800 | | |
| キオクシアホールディング ス | 71,400 | 9,510.00 | 679,014,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| ニチレイ | 101,900 | 1,921.00 | 195,749,900 | | |
| 横浜冷凍 | 31,300 | 1,351.00 | 42,286,300 | 貸付株式数 | 8,600株 |
| 東洋水産 | 53,700 | 11,075.00 | 594,727,500 | | |
| イトアンドHLDGS | 5,500 | 1,955.00 | 10,752,500 | 貸付株式数 | 2,300株 |
| ヨシムラ・フード・HLDGS | 8,500 | 692.00 | 5,882,000 | 貸付株式数 | 3,300株 |
| 日清食品HD | 131,100 | 2,935.00 | 384,778,500 | | |
| フジッコ | 13,200 | 1,580.00 | 20,856,000 | 貸付株式数 | 5,200株 |
| ロックフィールド | 13,000 | 1,321.00 | 17,173,000 | 貸付株式数 | 5,000株 |
| 日本たばこ産業 | 704,700 | 5,772.00 | 4,067,528,400 | | |
| ケンコーマヨネーズ | 7,300 | 1,859.00 | 13,570,700 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| わらべや日洋HD | 7,800 | 3,295.00 | 25,701,000 | | |
| なとり | 7,300 | 1,891.00 | 13,804,300 | | |
| ファーマフーズ | 15,400 | 678.00 | 10,441,200 | 貸付株式数 | 5,400株 |
| 北の達人コーポ | 49,700 | 136.00 | 6,759,200 | 貸付株式数 | 19,500株 (1,300株) |
| ユーグレナ | 78,200 | 402.00 | 31,436,400 | 貸付株式数 | 30,200株 |
| 紀文食品 | 10,100 | 1,063.00 | 10,736,300 | 貸付株式数 | 3,900株 |

| | | | | | |
|----------------|---------|-----------|-------------|-------|---------|
| ピクルスホールディングス | 6,800 | 1,290.00 | 8,772,000 | 貸付株式数 | 2,600株 |
| スター・マイカ・HLDGS | 12,300 | 1,247.00 | 15,338,100 | 貸付株式数 | 4,700株 |
| SREホールディングス | 5,700 | 3,320.00 | 18,924,000 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| 片倉工業 | 12,400 | 2,981.00 | 36,964,400 | 貸付株式数 | 4,800株 |
| グンゼ | 18,300 | 4,245.00 | 77,683,500 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| ヒューリック | 338,200 | 1,714.00 | 579,674,800 | | |
| ラサ商事 | 6,500 | 1,778.00 | 11,557,000 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| アルペン | 12,000 | 2,356.00 | 28,272,000 | 貸付株式数 | 4,700株 |
| ラクーンホールディングス | 8,800 | 615.00 | 5,412,000 | 貸付株式数 | 3,400株 |
| クオールホールディングス | 15,400 | 2,198.00 | 33,849,200 | 貸付株式数 | 2,300株 |
| アルコニックス | 19,200 | 2,385.00 | 45,792,000 | | |
| 神戸物産 | 108,500 | 3,859.00 | 418,701,500 | 貸付株式数 | 42,600株 |
| ソリトンシステムズ | 6,100 | 1,945.00 | 11,864,500 | | |
| ジンスホールディングス | 8,500 | 5,620.00 | 47,770,000 | | |
| ビックカメラ | 66,300 | 1,646.50 | 109,162,950 | | |
| DCMホールディングス | 64,500 | 1,627.00 | 104,941,500 | | |
| ペッパーフードサービス | 43,300 | 186.00 | 8,053,800 | 貸付株式数 | 17,000株 |
| MonotaRO | 176,700 | 2,385.50 | 421,517,850 | | |
| あいホールディングス | 22,400 | 2,798.00 | 62,675,200 | | |
| J. フロントリテイリング | 143,000 | 2,207.00 | 315,601,000 | | |
| ドトール・日レスHD | 22,100 | 2,574.00 | 56,885,400 | | |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 216,900 | 2,847.00 | 617,514,300 | | |
| ブロンコビリー | 7,300 | 3,910.00 | 28,543,000 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| ZOZO | 196,400 | 1,355.50 | 266,220,200 | | |
| トレジャー・ファクトリー | 8,600 | 1,652.00 | 14,207,200 | 貸付株式数 | 3,300株 |
| 物語コーポレーション | 24,200 | 4,450.00 | 107,690,000 | 貸付株式数 | 9,300株 |
| 三越伊勢丹HD | 201,000 | 2,347.00 | 471,747,000 | | |
| 東洋紡 | 51,000 | 1,213.00 | 61,863,000 | | |
| ユニチカ | 40,700 | 255.00 | 10,378,500 | 貸付株式数 | 15,700株 |
| 富士紡ホールディングス | 5,500 | 7,770.00 | 42,735,000 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 日清紡ホールディングス | 89,500 | 1,285.00 | 115,007,500 | | |
| 倉敷紡績 | 8,700 | 8,370.00 | 72,819,000 | | |
| ダイワボウHD | 50,900 | 3,043.00 | 154,888,700 | | |
| シキボウ | 7,900 | 1,041.00 | 8,223,900 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 日東紡績 | 15,000 | 10,380.00 | 155,700,000 | | |
| トヨタ紡織 | 57,900 | 2,481.50 | 143,678,850 | | |
| マクニカホールディングス | 86,800 | 2,427.00 | 210,663,600 | 貸付株式数 | 13,400株 |
| Hamee | 5,700 | 455.00 | 2,593,500 | 貸付株式数 | 2,200株 |

| | | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|-------|------------------|
| ラクト・ジャパン | 5,300 | 3,480.00 | 18,444,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| クリエイトSDH | 17,700 | 3,375.00 | 59,737,500 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| グリムス | 4,200 | 2,441.00 | 10,252,200 | | |
| バイタルKSKHD | 17,100 | 1,350.00 | 23,085,000 | | |
| 八洲電機 | 9,400 | 2,889.00 | 27,156,600 | | |
| メディアスホールディングス | 8,100 | 812.00 | 6,577,200 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| レスター | 10,600 | 2,695.00 | 28,567,000 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| TOKAIホールディングス | 67,700 | 1,074.00 | 72,709,800 | | |
| 三洋貿易 | 15,300 | 1,468.00 | 22,460,400 | | |
| シュッピン | 13,700 | 1,121.00 | 15,357,700 | 貸付株式数 | 5,200株 |
| ビューティガレージ | 3,400 | 1,507.00 | 5,123,800 | 貸付株式数 | 500株 |
| オイシックス・ラ・大地 | 18,400 | 1,499.00 | 27,581,600 | 貸付株式数 | 7,700株 |
| ウイン・パートナーズ | 9,100 | 1,303.00 | 11,857,300 | | |
| ネクステージ | 28,500 | 2,754.00 | 78,489,000 | | |
| ジョイフル本田 | 33,700 | 2,157.00 | 72,690,900 | 貸付株式数 | 12,000株 |
| エターナルホスピタリティ グル | 5,100 | 3,475.00 | 17,722,500 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ホットランドホールディング グ | 9,500 | 2,093.00 | 19,883,500 | 貸付株式数 | 3,700株 (200株) |
| すかいらーくHD | 170,400 | 3,449.00 | 587,709,600 | 貸付株式数 | 66,900株 |
| SFPホールディングス | 7,000 | 2,076.00 | 14,532,000 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| 綿半ホールディングス | 9,700 | 1,447.00 | 14,035,900 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| 日本毛織 | 30,200 | 1,765.00 | 53,303,000 | 貸付株式数 | 11,600株 |
| ヨシックスホールディング ス | 3,700 | 2,997.00 | 11,088,900 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| ユナイテッド・スーパー マーケ | 61,400 | 893.00 | 54,830,200 | 貸付株式数 | 23,000株 |
| 野村不動産HLDGS | 323,400 | 947.80 | 306,518,520 | | |
| 三重交通グループHD | 28,300 | 536.00 | 15,168,800 | 貸付株式数 | 11,100株 |
| 地主 | 9,500 | 2,986.00 | 28,367,000 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| フィル・カンパニー | 2,000 | 1,043.00 | 2,086,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| JPMC | 6,200 | 1,285.00 | 7,967,000 | | |
| フージャースHD | 20,200 | 1,279.00 | 25,835,800 | | |
| オープンハウスグループ | 36,000 | 9,062.00 | 326,232,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| 東急不動産HD | 317,100 | 1,430.00 | 453,453,000 | | |
| 飯田GHD | 98,800 | 2,461.00 | 243,146,800 | | |
| 帝国繊維 | 12,200 | 3,300.00 | 40,260,000 | 貸付株式数 | 4,800株 |
| 日本コークス工業 | 119,900 | 99.00 | 11,870,100 | | |
| あさひ | 10,400 | 1,343.00 | 13,967,200 | 貸付株式数 | 4,000株 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| コスモス薬品 | 24,700 | 8,010.00 | 197,847,000 | |
| シップヘルスケアHD | 45,700 | 2,627.00 | 120,053,900 | |
| ソフトクリエイイトHD | 9,700 | 2,096.00 | 20,331,200 | 貸付株式数 3,200株 |
| セブン&アイ・HLDGS | 1,376,600 | 2,243.50 | 3,088,402,100 | |
| クリエイイト・レストランツ・ホール | 187,500 | 769.00 | 144,187,500 | 貸付株式数 73,600株 (1,300株) |
| 明治電機工業 | 6,200 | 2,352.00 | 14,582,400 | |
| ツルハホールディングス | 191,100 | 2,800.00 | 535,080,000 | |
| サンマルクホールディングス | 11,100 | 2,700.00 | 29,970,000 | |
| トリドールホールディングス | 35,100 | 4,193.00 | 147,174,300 | 貸付株式数 13,800株 (400株) |
| 帝人 | 104,600 | 1,301.00 | 136,084,600 | |
| 東レ | 862,300 | 1,014.00 | 874,372,200 | |
| クラレ | 157,400 | 1,557.50 | 245,150,500 | |
| 旭化成 | 782,000 | 1,371.50 | 1,072,513,000 | |
| TOKYO BASE | 17,200 | 450.00 | 7,740,000 | 貸付株式数 6,700株 |
| 稲葉製作所 | 6,700 | 1,577.00 | 10,565,900 | 貸付株式数 2,400株 |
| 宮地エンジニアリングG | 15,800 | 1,770.00 | 27,966,000 | |
| トーカロ | 35,000 | 2,190.00 | 76,650,000 | |
| SUMCO | 231,400 | 1,269.00 | 293,646,600 | 貸付株式数 78,000株 |
| 川田テクノロジーズ | 9,200 | 4,285.00 | 39,422,000 | |
| RS TECHNOLOGIES | 8,200 | 3,555.00 | 29,151,000 | |
| AND DOホールディングス | 7,000 | 1,028.00 | 7,196,000 | 貸付株式数 2,400株 |
| ケイアイスター不動産 | 4,900 | 6,280.00 | 30,772,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| ジェイ・エス・ビー | 4,800 | 3,565.00 | 17,112,000 | 貸付株式数 1,800株 |
| ロードスターキャピタル | 6,600 | 2,871.00 | 18,948,600 | 貸付株式数 2,600株 |
| アズーム | 2,000 | 5,090.00 | 10,180,000 | 貸付株式数 800株 |
| 霞ヶ関キャピタル | 11,500 | 7,820.00 | 89,930,000 | 貸付株式数 4,500株 |
| JMホールディングス | 18,000 | 1,695.00 | 30,510,000 | 貸付株式数 6,400株 |
| コメダホールディングス | 30,600 | 3,040.00 | 93,024,000 | |
| アレンザホールディングス | 9,300 | 1,184.00 | 11,011,200 | 貸付株式数 3,400株 (1,200株) |
| 串カツ田中HLDGS | 3,700 | 2,023.00 | 7,485,100 | 貸付株式数 1,400株 |
| パロックジャパン | 14,500 | 762.00 | 11,049,000 | 貸付株式数 5,700株 |
| クスリのアオキHLDGS | 32,400 | 3,726.00 | 120,722,400 | 貸付株式数 12,500株 |
| 力の源HD | 9,300 | 1,357.00 | 12,620,100 | 貸付株式数 3,600株 |
| FOOD&LIFE COMPAN | 71,600 | 7,530.00 | 539,148,000 | |
| アセンテック | 5,100 | 1,613.00 | 8,226,300 | |

| | | | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|-------|--------------------|
| セーレン | 25,600 | 3,200.00 | 81,920,000 | 貸付株式数 | 2,300株 |
| 小松マテーレ | 17,100 | 835.00 | 14,278,500 | | |
| ワコールホールディングス | 23,100 | 4,473.00 | 103,326,300 | | |
| ホギメディカル | 12,900 | 6,670.00 | 86,043,000 | | |
| T S Iホールディングス | 35,900 | 1,057.00 | 37,946,300 | 貸付株式数 | 13,800株 |
| ワールド | 19,500 | 3,055.00 | 59,572,500 | 貸付株式数 | 6,700株 |
| T I S | 124,900 | 5,303.00 | 662,344,700 | | |
| グリーホールディングス | 39,600 | 405.00 | 16,038,000 | | |
| G M Oペパボ | 1,400 | 2,301.00 | 3,221,400 | 貸付株式数 | 500株 |
| コーエーテクモHD | 74,000 | 1,944.00 | 143,856,000 | | |
| 三菱総合研究所 | 5,700 | 4,875.00 | 27,787,500 | | |
| ファインデックス | 8,200 | 907.00 | 7,437,400 | | |
| ブレインパッド | 8,500 | 2,688.00 | 22,848,000 | | |
| K L a b | 32,100 | 348.00 | 11,170,800 | 貸付株式数 | 12,600株 |
| ポルトゥウィンホール ディン | 16,800 | 315.00 | 5,292,000 | | |
| ネクソン | 290,900 | 3,739.00 | 1,087,675,100 | | |
| アイスタイル | 45,100 | 444.00 | 20,024,400 | 貸付株式数 | 17,400株 |
| エムアップホールディング ス | 14,500 | 1,750.00 | 25,375,000 | | |
| エイチームホールディング ス | 9,200 | 1,141.00 | 10,497,200 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| セルシス | 16,000 | 1,617.00 | 25,872,000 | 貸付株式数 | 6,200株 |
| エニグモ | 13,200 | 424.00 | 5,596,800 | 貸付株式数 | 4,800株 (4,700株) |
| コロプラ | 40,200 | 423.00 | 17,004,600 | | |
| ブロードリーフ | 43,100 | 732.00 | 31,549,200 | | |
| デジタルハーツHLDGS | 7,400 | 934.00 | 6,911,600 | | |
| メディアドゥ | 4,000 | 1,774.00 | 7,096,000 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| じげん | 33,900 | 463.00 | 15,695,700 | 貸付株式数 | 13,300株 |
| ブイキューブ | 14,900 | 113.00 | 1,683,700 | 貸付株式数 | 6,000株 |
| フィックスターズ | 16,300 | 1,548.00 | 25,232,400 | 貸付株式数 | 6,400株 |
| 北里コーポレーション | 9,300 | 1,529.00 | 14,219,700 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| オプティム | 12,200 | 495.00 | 6,039,000 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| セレス | 5,300 | 2,029.00 | 10,753,700 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| S H I F T | 106,000 | 960.00 | 101,760,000 | 貸付株式数 | 40,700株 |
| 特種東海製紙 | 20,600 | 1,551.00 | 31,950,600 | 貸付株式数 | 8,000株 |
| セック | 3,600 | 2,959.00 | 10,652,400 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| テクマトリックス | 23,500 | 2,288.00 | 53,768,000 | | |
| プロシップ | 9,500 | 1,616.00 | 15,352,000 | 貸付株式数 | 4,000株 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|---------------|
| ガンホー・オンライン・エンター | 27,400 | 2,419.00 | 66,280,600 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 23,600 | 9,739.00 | 229,840,400 | |
| システムリサーチ | 8,800 | 1,986.00 | 17,476,800 | 貸付株式数 3,000株 |
| インターネットイニシアティブ | 64,600 | 2,849.00 | 184,045,400 | |
| さくらインターネット | 16,600 | 2,895.00 | 48,057,000 | 貸付株式数 7,000株 |
| GMOグローバルサインHD | 3,600 | 2,359.00 | 8,492,400 | 貸付株式数 1,200株 |
| SRAホールディングス | 6,700 | 5,190.00 | 34,773,000 | |
| 朝日ネット | 12,700 | 681.00 | 8,648,700 | |
| e B A S E | 14,500 | 433.00 | 6,278,500 | 貸付株式数 5,700株 |
| アバントグループ | 16,600 | 1,759.00 | 29,199,400 | 貸付株式数 1,000株 |
| アドソル日進 | 9,500 | 1,596.00 | 15,162,000 | |
| フリービット | 6,200 | 1,625.00 | 10,075,000 | |
| コムチュア | 15,600 | 1,672.00 | 26,083,200 | |
| アステリア | 9,200 | 962.00 | 8,850,400 | 貸付株式数 3,600株 |
| アイル | 6,600 | 2,505.00 | 16,533,000 | |
| 王子ホールディングス | 446,800 | 850.80 | 380,137,440 | |
| 日本製紙 | 66,600 | 1,130.00 | 75,258,000 | |
| 北越コーポレーション | 66,300 | 896.00 | 59,404,800 | 貸付株式数 26,000株 |
| 大王製紙 | 59,600 | 921.00 | 54,891,600 | |
| マークライنز | 7,000 | 1,546.00 | 10,822,000 | |
| メディカル・データ・ビジ | 12,300 | 1,686.00 | 20,737,800 | 貸付株式数 4,800株 |
| g u m i | 22,000 | 337.00 | 7,414,000 | 貸付株式数 8,500株 |
| テラスカイ | 4,000 | 1,998.00 | 7,992,000 | 貸付株式数 1,700株 |
| デジタル・インフォメーション | 6,800 | 2,697.00 | 18,339,600 | |
| ネオジャパン | 3,100 | 1,841.00 | 5,707,100 | |
| P R T I M E S | 2,400 | 2,741.00 | 6,578,400 | 貸付株式数 500株 |
| ラクス | 111,200 | 1,055.50 | 117,371,600 | |
| ダブルスタンダード | 4,200 | 1,715.00 | 7,203,000 | |
| オープンドア | 6,800 | 312.00 | 2,121,600 | 貸付株式数 3,000株 |
| アカツキ | 5,800 | 2,727.00 | 15,816,600 | |
| UBICOMホールディングス | 3,800 | 1,072.00 | 4,073,600 | |
| カナミックネットワーク | 14,800 | 539.00 | 7,977,200 | 貸付株式数 5,800株 |
| レンゴー | 119,400 | 1,167.50 | 139,399,500 | |
| トーモク | 6,800 | 3,385.00 | 23,018,000 | |
| ザ・パック | 23,700 | 1,274.00 | 30,193,800 | 貸付株式数 9,100株 |
| チェンジホールディングス | 22,800 | 974.00 | 22,207,200 | |
| オークネット | 10,900 | 2,024.00 | 22,061,600 | 貸付株式数 4,200株 |

| | | | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|-------|---------|
| オロ | 4,900 | 2,065.00 | 10,118,500 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| ユーザーローカル | 5,700 | 1,906.00 | 10,864,200 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| PKSHA TECHNOLOGY | 14,100 | 3,160.00 | 44,556,000 | 貸付株式数 | 5,500株 |
| マネーフォワード | 26,900 | 4,288.00 | 115,347,200 | 貸付株式数 | 10,500株 |
| レゾナック・ホールディング | 114,000 | 5,788.00 | 659,832,000 | | |
| 住友化学 | 949,300 | 436.00 | 413,894,800 | | |
| 住友精化 | 4,900 | 5,370.00 | 26,313,000 | | |
| 日産化学 | 60,300 | 5,367.00 | 323,630,100 | | |
| ラサ工業 | 3,800 | 5,870.00 | 22,306,000 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| クレハ | 17,600 | 3,940.00 | 69,344,000 | 貸付株式数 | 6,900株 |
| 多木化学 | 4,600 | 3,765.00 | 17,319,000 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| テイカ | 8,400 | 1,217.00 | 10,222,800 | | |
| 石原産業 | 19,600 | 2,701.00 | 52,939,600 | | |
| 日本曹達 | 25,000 | 3,570.00 | 89,250,000 | | |
| 東ソー | 171,800 | 2,316.00 | 397,888,800 | | |
| トクヤマ | 41,300 | 4,050.00 | 167,265,000 | | |
| セントラル硝子 | 14,900 | 3,420.00 | 50,958,000 | | |
| 東亜合成 | 49,800 | 1,620.00 | 80,676,000 | | |
| 大阪ソーダ | 41,200 | 2,171.00 | 89,445,200 | | |
| 関東電化 | 22,800 | 1,018.00 | 23,210,400 | 貸付株式数 | 9,700株 |
| GMOフィナンシャルゲート | 1,900 | 4,940.00 | 9,386,000 | 貸付株式数 | 700株 |
| SUN ASTERISK | 10,300 | 469.00 | 4,830,700 | 貸付株式数 | 3,900株 |
| デンカ | 46,800 | 2,634.00 | 123,271,200 | | |
| イビデン | 74,500 | 11,155.00 | 831,047,500 | | |
| 信越化学 | 1,049,200 | 4,788.00 | 5,023,569,600 | | |
| 日本カ - バイド | 5,800 | 2,454.00 | 14,233,200 | | |
| プラスアルファ・コンサル | 15,100 | 2,452.00 | 37,025,200 | | |
| ティン | | | | | |
| 電算システムHD | 5,200 | 3,520.00 | 18,304,000 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 堺化学 | 9,700 | 3,025.00 | 29,342,500 | | |
| 第一稀元素化学工 | 11,800 | 1,073.00 | 12,661,400 | 貸付株式数 | 4,900株 |
| エア・ウォーター | 111,300 | 2,194.00 | 244,192,200 | | |
| 日本酸素HLDGS | 133,500 | 4,655.00 | 621,442,500 | | |
| 日本化学工業 | 4,700 | 2,639.00 | 12,403,300 | | |
| 日本パ - カライジング | 58,400 | 1,409.00 | 82,285,600 | | |
| 高圧ガス | 17,100 | 1,026.00 | 17,544,600 | 貸付株式数 | 5,700株 |
| 四国化成ホールディング | 13,300 | 2,725.00 | 36,242,500 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| オリオンビール | 19,000 | 1,293.00 | 24,567,000 | 貸付株式数 | 7,400株 |
| 戸田工業 | 2,700 | 1,100.00 | 2,970,000 | 貸付株式数 | 600株 |

| | | | | |
|--------------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| ステラ ケミファ | 6,300 | 4,150.00 | 26,145,000 | |
| 保土谷化学 | 7,400 | 1,871.00 | 13,845,400 | 貸付株式数 2,800株 |
| 日本触媒 | 75,600 | 1,901.00 | 143,715,600 | |
| 大日精化 | 8,000 | 3,995.00 | 31,960,000 | |
| カネカ | 29,100 | 4,306.00 | 125,304,600 | |
| 協和キリン | 138,900 | 2,569.00 | 356,834,100 | |
| ブルーゾーンホールディング ク | 14,800 | 8,402.00 | 124,349,600 | |
| APPIER GROUP | 45,100 | 1,080.00 | 48,708,000 | 貸付株式数 17,400株 |
| 三菱瓦斯化学 | 83,900 | 2,772.50 | 232,612,750 | |
| 三井化学 | 106,200 | 3,834.00 | 407,170,800 | |
| 東京応化工業 | 56,300 | 5,535.00 | 311,620,500 | |
| 大阪有機化学 | 9,900 | 3,790.00 | 37,521,000 | |
| 三菱ケミカルグループ | 825,400 | 887.50 | 732,542,500 | |
| KHネオケム | 19,600 | 2,471.00 | 48,431,600 | 貸付株式数 7,600株 |
| ビジョナル | 14,100 | 10,665.00 | 150,376,500 | |
| ダイセル | 129,300 | 1,367.50 | 176,817,750 | 貸付株式数 3,300株 |
| 住友ベークライト | 41,300 | 5,152.00 | 212,777,600 | |
| 積水化学 | 252,200 | 2,601.00 | 655,972,200 | |
| 日本ゼオン | 85,300 | 1,758.50 | 150,000,050 | |
| アイカ工業 | 29,800 | 3,479.00 | 103,674,200 | |
| UBE | 60,800 | 2,505.50 | 152,334,400 | |
| 積水樹脂 | 14,000 | 2,159.00 | 30,226,000 | |
| 旭有機材 | 7,900 | 4,685.00 | 37,011,500 | 貸付株式数 3,000株 |
| ニチバン | 7,300 | 1,992.00 | 14,541,600 | 貸付株式数 1,700株 |
| リケンテクノス | 20,300 | 1,501.00 | 30,470,300 | |
| 大倉工業 | 6,000 | 4,810.00 | 28,860,000 | 貸付株式数 2,300株 |
| 積水化成成品 | 18,600 | 402.00 | 7,477,200 | |
| 群栄化学 | 2,800 | 3,955.00 | 11,074,000 | |
| ダイキョーニシカワ | 25,000 | 777.00 | 19,425,000 | |
| 森六 | 6,300 | 2,324.00 | 14,641,200 | |
| 恵和 | 7,600 | 1,245.00 | 9,462,000 | |
| 日本化薬 | 84,600 | 1,679.50 | 142,085,700 | |
| カーリット | 10,600 | 1,778.00 | 18,846,800 | |
| CLホールディングス | 3,600 | 1,108.00 | 3,988,800 | 貸付株式数 1,200株 |
| プレステージ・インター | 44,800 | 720.00 | 32,256,000 | |
| ハイマックス | 3,700 | 1,273.00 | 4,710,100 | |
| テクセンドフォトマスク | 32,800 | 2,944.00 | 96,563,200 | 貸付株式数 8,800株 |
| アミューズ | 6,600 | 1,880.00 | 12,408,000 | |
| 野村総合研究所 | 230,400 | 6,119.00 | 1,409,817,600 | |

| | | | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|-------|------------------|
| ドリームインキュベータ | 3,800 | 2,482.00 | 9,431,600 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| クイック | 29,900 | 894.00 | 26,730,600 | | |
| 日本システム技術 | 10,900 | 2,432.00 | 26,508,800 | 貸付株式数 | 4,200株 |
| 電通グループ | 117,100 | 3,425.00 | 401,067,500 | | |
| インテージホールディングス | 8,900 | 1,784.00 | 15,877,600 | 貸付株式数 | 3,400株 |
| テイクアンドギヴニーズ | 5,800 | 770.00 | 4,466,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 東邦システムサイエンス | 5,500 | 1,166.00 | 6,413,000 | 貸付株式数 | 2,100株 |
| びあ | 5,500 | 2,608.00 | 14,344,000 | 貸付株式数 | 2,100株 |
| イオンファンタジー | 5,200 | 2,893.00 | 15,043,600 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ソースネクスト | 61,300 | 155.00 | 9,501,500 | 貸付株式数 | 23,600株 |
| シーティーエス | 14,800 | 1,040.00 | 15,392,000 | | |
| メディカルシステムネットワーク | 12,100 | 513.00 | 6,207,300 | | |
| 日本精化 | 7,800 | 2,848.00 | 22,214,400 | | |
| 扶桑化学工業 | 12,500 | 6,360.00 | 79,500,000 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| トリケミカル | 14,300 | 2,596.00 | 37,122,800 | 貸付株式数 | 4,900株 |
| シンプレクスHD | 93,500 | 1,064.00 | 99,484,000 | | |
| HEROZ | 4,700 | 812.00 | 3,816,400 | 貸付株式数 | 1,800株 (300株) |
| ラクスル | 23,500 | 1,965.00 | 46,177,500 | 貸付株式数 | 9,000株 |
| メルカリ | 65,200 | 2,945.50 | 192,046,600 | 貸付株式数 | 23,300株 |
| I P S | 3,500 | 3,010.00 | 10,535,000 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| システムサポートホールディング | 4,100 | 2,820.00 | 11,562,000 | | |
| A D E K A | 45,700 | 3,794.00 | 173,385,800 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| 日油 | 135,400 | 3,186.00 | 431,384,400 | | |
| ハリマ化成グループ | 9,200 | 880.00 | 8,096,000 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| ボードルア | 6,400 | 2,356.00 | 15,078,400 | | |
| N E | 5,800 | 690.00 | 4,002,000 | | |
| イーソル | 7,900 | 502.00 | 3,965,800 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| ウイングアーク1ST | 12,300 | 3,555.00 | 43,726,500 | | |
| ヒト・コミュニケーションズHD | 4,700 | 1,033.00 | 4,855,100 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| サーバーワークス | 2,400 | 1,770.00 | 4,248,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| S a n s a n | 33,500 | 1,711.00 | 57,318,500 | | |
| ギフトィ | 9,200 | 1,171.00 | 10,773,200 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| 花王 | 287,300 | 6,344.00 | 1,822,631,200 | | |
| 第一工業製薬 | 4,700 | 8,070.00 | 37,929,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 石原ケミカル | 5,000 | 2,182.00 | 10,910,000 | 貸付株式数 | 1,900株 |

| | | | | |
|------------|-----------|----------|---------------|---------------|
| 三洋化成 | 7,300 | 4,960.00 | 36,208,000 | |
| メドレー | 14,400 | 2,396.00 | 34,502,400 | 貸付株式数 5,600株 |
| ベース | 5,000 | 3,225.00 | 16,125,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| J M D C | 17,300 | 3,680.00 | 63,664,000 | 貸付株式数 200株 |
| 武田薬品 | 1,051,200 | 4,485.00 | 4,714,632,000 | |
| アステラス製薬 | 1,036,200 | 2,117.00 | 2,193,635,400 | |
| 住友ファーマ | 105,200 | 2,279.00 | 239,750,800 | |
| 塩野義製薬 | 431,000 | 2,739.00 | 1,180,509,000 | |
| 日本新薬 | 30,400 | 5,968.00 | 181,427,200 | |
| 中外製薬 | 369,800 | 8,191.00 | 3,029,031,800 | |
| 科研製薬 | 17,500 | 4,080.00 | 71,400,000 | |
| エーザイ | 154,200 | 4,583.00 | 706,698,600 | |
| 理研ビタミン | 10,100 | 2,944.00 | 29,734,400 | |
| ロート製薬 | 124,800 | 2,562.50 | 319,800,000 | |
| 小野薬品 | 263,600 | 2,188.50 | 576,888,600 | |
| 久光製薬 | 26,500 | 4,349.00 | 115,248,500 | |
| 持田製薬 | 14,400 | 3,485.00 | 50,184,000 | |
| 参天製薬 | 210,900 | 1,647.50 | 347,457,750 | |
| 扶桑薬品 | 4,600 | 2,276.00 | 10,469,600 | 貸付株式数 900株 |
| ツムラ | 40,600 | 4,073.00 | 165,363,800 | |
| テルモ | 782,600 | 2,340.00 | 1,831,284,000 | |
| HUグループHD | 38,000 | 3,245.00 | 123,310,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 18,500 | 4,655.00 | 86,117,500 | |
| 生化学工業 | 20,000 | 693.00 | 13,860,000 | |
| 栄研化学 | 18,700 | 2,459.00 | 45,983,300 | 貸付株式数 6,600株 |
| J C R ファーマ | 51,400 | 731.00 | 37,573,400 | 貸付株式数 19,800株 |
| 東和薬品 | 15,900 | 3,655.00 | 58,114,500 | |
| 富士製薬工業 | 8,800 | 1,908.00 | 16,790,400 | 貸付株式数 3,400株 |
| ゼリア新薬工業 | 16,100 | 2,101.00 | 33,826,100 | 貸付株式数 2,400株 |
| ネクセラファーマ | 51,800 | 860.00 | 44,548,000 | 貸付株式数 20,300株 |
| 第一三共 | 1,084,700 | 3,341.00 | 3,623,982,700 | |
| 杏林製薬 | 23,800 | 1,528.00 | 36,366,400 | |
| 大幸薬品 | 24,500 | 297.00 | 7,276,500 | 貸付株式数 9,800株 |
| ダイト | 15,900 | 1,355.00 | 21,544,500 | |
| 大塚ホールディングス | 263,100 | 9,250.00 | 2,433,675,000 | |
| ペプチドリーム | 57,300 | 1,707.00 | 97,811,100 | |
| 大日本塗料 | 13,100 | 1,310.00 | 17,161,000 | |
| 日本ペイントHOLD | 626,500 | 1,036.00 | 649,054,000 | 貸付株式数 62,800株 |
| 関西ペイント | 94,100 | 2,425.00 | 228,192,500 | 貸付株式数 36,900株 |
| 中国塗料 | 24,200 | 4,320.00 | 104,544,000 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|-----------|---------------|------------------------|
| 藤倉化成 | 13,600 | 617.00 | 8,391,200 | |
| 太陽ホールディングス | 56,600 | 4,982.00 | 281,981,200 | |
| D I C | 41,900 | 3,753.00 | 157,250,700 | |
| サカタインクス | 26,200 | 2,333.00 | 61,124,600 | |
| ARTIENCE | 22,200 | 3,460.00 | 76,812,000 | |
| アルプス技研 | 10,100 | 2,697.00 | 27,239,700 | 貸付株式数 3,800株 |
| サンックスホールディングス | 15,100 | 202.00 | 3,050,200 | 貸付株式数 500株 |
| 日本空調サービス | 13,000 | 1,198.00 | 15,574,000 | 貸付株式数 5,100株 |
| オリエンタルランド | 713,700 | 2,854.50 | 2,037,256,650 | |
| フォーカスシステムズ | 7,900 | 1,834.00 | 14,488,600 | 貸付株式数 2,700株 |
| ダスキン | 27,500 | 4,382.00 | 120,505,000 | |
| パーク24 | 82,900 | 2,091.00 | 173,343,900 | |
| 明光ネットワークジャパン | 15,900 | 708.00 | 11,257,200 | |
| ファルコホールディングス | 4,800 | 2,604.00 | 12,499,200 | |
| クレスコ | 20,400 | 1,720.00 | 35,088,000 | |
| フジ・メディア・HD | 92,800 | 3,666.00 | 340,204,800 | 貸付株式数 36,400株 |
| ラウンドワン | 114,600 | 1,084.00 | 124,226,400 | |
| リゾートトラスト | 114,700 | 1,988.50 | 228,080,950 | |
| オービック | 219,400 | 4,911.00 | 1,077,473,400 | |
| ジャストシステム | 17,000 | 5,010.00 | 85,170,000 | |
| TDCソフト | 22,100 | 1,363.00 | 30,122,300 | 貸付株式数 8,500株 |
| LINEヤフー | 1,818,900 | 419.00 | 762,119,100 | |
| ビー・エム・エル | 16,200 | 3,870.00 | 62,694,000 | |
| トレンドマイクロ | 68,300 | 7,005.00 | 478,441,500 | |
| IDホールディングス | 7,600 | 2,200.00 | 16,720,000 | |
| リソー教育グループ | 37,900 | 200.00 | 7,580,000 | |
| 日本オラクル | 22,600 | 13,595.00 | 307,247,000 | |
| 早稲田アカデミー | 5,900 | 2,321.00 | 13,693,900 | 貸付株式数 2,500株 (200株) |
| アルファシステムズ | 3,700 | 4,085.00 | 15,114,500 | 貸付株式数 1,200株 |
| フューチャー | 25,200 | 1,960.00 | 49,392,000 | |
| CAC HOLDINGS | 7,200 | 2,051.00 | 14,767,200 | |
| ユー・エス・エス | 229,700 | 1,781.50 | 409,210,550 | |
| オービックビジネスC | 19,900 | 8,682.00 | 172,771,800 | |
| アイティフォー | 12,300 | 1,662.00 | 20,442,600 | |
| 東計電算 | 3,300 | 4,025.00 | 13,282,500 | 貸付株式数 1,200株 |
| サイバーエージェント | 245,500 | 1,311.00 | 321,850,500 | |
| 楽天グループ | 954,900 | 939.10 | 896,746,590 | |

| | | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|-------|---------|
| クリーク・アンド・リバー社 | 7,100 | 1,439.00 | 10,216,900 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| SBIグローバルアセット | 22,600 | 584.00 | 13,198,400 | | |
| テー・オー・ダブリュー | 21,600 | 377.00 | 8,143,200 | | |
| 大塚商会 | 133,900 | 3,305.00 | 442,539,500 | | |
| サイボウズ | 16,300 | 2,856.00 | 46,552,800 | 貸付株式数 | 6,400株 |
| GMOインターネット | 2,900 | 659.00 | 1,911,100 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| 山田コンサルティングGP | 5,300 | 1,753.00 | 9,290,900 | | |
| セントラルスポーツ | 5,100 | 2,434.00 | 12,413,400 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| パラカ | 3,200 | 2,059.00 | 6,588,800 | | |
| 電通総研 | 14,400 | 7,750.00 | 111,600,000 | | |
| デジタルガレージ | 16,800 | 2,754.00 | 46,267,200 | | |
| イーエムシステムズ | 15,500 | 807.00 | 12,508,500 | 貸付株式数 | 6,000株 |
| ウェザーニューズ | 9,400 | 3,710.00 | 34,874,000 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| C I J | 31,400 | 520.00 | 16,328,000 | 貸付株式数 | 12,300株 |
| ビジネスエンジニアリング | 2,800 | 7,990.00 | 22,372,000 | | |
| WOWOW | 8,900 | 1,332.00 | 11,854,800 | 貸付株式数 | 3,400株 |
| スカラ | 11,000 | 393.00 | 4,323,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| フルキャストホールディングス | 9,300 | 1,680.00 | 15,624,000 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| エン | 19,700 | 1,537.00 | 30,278,900 | 貸付株式数 | 7,500株 |
| セルソース | 6,900 | 386.00 | 2,663,400 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| あすか製薬HD | 11,400 | 2,041.00 | 23,267,400 | 貸付株式数 | 4,400株 |
| サイググループHD | 61,000 | 2,369.00 | 144,509,000 | | |
| 富士フイルムHLDGS | 712,200 | 3,381.00 | 2,407,948,200 | | |
| コニカミノルタ | 265,700 | 686.70 | 182,456,190 | | |
| 資生堂 | 229,000 | 2,360.00 | 540,440,000 | | |
| ライオン | 135,600 | 1,687.00 | 228,757,200 | | |
| 高砂香料 | 44,400 | 1,447.00 | 64,246,800 | | |
| マンダム | 22,400 | 2,758.00 | 61,779,200 | | |
| ミルボン | 19,000 | 2,466.00 | 46,854,000 | 貸付株式数 | 7,300株 |
| コーセー | 26,700 | 5,366.00 | 143,272,200 | 貸付株式数 | 10,300株 |
| コタ | 13,100 | 1,163.00 | 15,235,300 | 貸付株式数 | 5,100株 |
| ポーラ・オルビスHD | 60,600 | 1,320.00 | 79,992,000 | 貸付株式数 | 23,800株 |
| ノエビアホールディングス | 10,500 | 4,560.00 | 47,880,000 | | |
| 新日本製薬 | 6,700 | 2,029.00 | 13,594,300 | | |
| I - n e | 3,100 | 1,452.00 | 4,501,200 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| アクシージア | 7,400 | 394.00 | 2,915,600 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| エステー | 11,100 | 1,547.00 | 17,171,700 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| コニシ | 37,200 | 1,327.00 | 49,364,400 | | |

| | | | | |
|-----------------|-----------|----------|---------------|---------------|
| 長谷川香料 | 22,600 | 2,806.00 | 63,415,600 | |
| 小林製薬 | 30,900 | 5,267.00 | 162,750,300 | |
| 荒川化学工業 | 10,000 | 1,174.00 | 11,740,000 | |
| メック | 8,600 | 5,080.00 | 43,688,000 | 貸付株式数 3,300株 |
| 日本高純度化学 | 2,900 | 3,240.00 | 9,396,000 | 貸付株式数 1,100株 |
| タカラバイオ | 31,800 | 786.00 | 24,994,800 | 貸付株式数 14,200株 |
| J C U | 12,900 | 4,965.00 | 64,048,500 | |
| O A T アグリオ | 4,400 | 2,170.00 | 9,548,000 | 貸付株式数 1,700株 |
| デクセリアルズ | 101,000 | 2,783.50 | 281,133,500 | |
| アース製薬 | 10,800 | 5,100.00 | 55,080,000 | |
| 北興化学 | 8,800 | 1,581.00 | 13,912,800 | |
| 大成ラミックグループ | 3,400 | 2,688.00 | 9,139,200 | |
| クミアイ化学 | 52,800 | 693.00 | 36,590,400 | 貸付株式数 20,700株 |
| 日本農薬 | 18,100 | 995.00 | 18,009,500 | |
| ニチレキグループ | 12,600 | 2,419.00 | 30,479,400 | 貸付株式数 2,800株 |
| ユシロ | 6,100 | 2,745.00 | 16,744,500 | |
| J X 金属 | 337,400 | 1,682.00 | 567,506,800 | |
| 富士石油 | 13,500 | 477.00 | 6,439,500 | |
| 出光興産 | 510,900 | 1,169.00 | 597,242,100 | |
| ENEOSホールディングス | 1,669,100 | 1,070.50 | 1,786,771,550 | |
| コスモエネルギーHLDGS | 65,400 | 4,153.00 | 271,606,200 | |
| A N Y C O L O R | 16,100 | 4,720.00 | 75,992,000 | |
| 日本ビジネスシステムズ | 6,400 | 1,627.00 | 10,412,800 | 貸付株式数 200株 |
| テスホールディングス | 28,000 | 311.00 | 8,708,000 | 貸付株式数 11,000株 |
| インフロニアHD | 121,100 | 2,062.00 | 249,708,200 | |
| 横浜ゴム | 66,000 | 6,262.00 | 413,292,000 | |
| TOYO TIRE | 74,700 | 4,363.00 | 325,916,100 | |
| ブリヂストン | 345,800 | 7,162.00 | 2,476,619,600 | |
| 住友ゴム | 127,400 | 2,420.00 | 308,308,000 | |
| 藤倉コンポジット | 11,400 | 1,878.00 | 21,409,200 | |
| オカモト | 6,200 | 5,500.00 | 34,100,000 | |
| アキレス | 6,400 | 1,407.00 | 9,004,800 | |
| フ コ ク | 6,200 | 1,859.00 | 11,525,800 | 貸付株式数 2,400株 |
| ニッタ | 11,600 | 4,155.00 | 48,198,000 | |
| 住友理工 | 26,500 | 2,588.00 | 68,582,000 | |
| 三ツ星ベルト | 15,100 | 3,850.00 | 58,135,000 | 貸付株式数 5,900株 |
| パンドー化学 | 17,500 | 2,016.00 | 35,280,000 | |
| A G C | 114,900 | 5,212.00 | 598,858,800 | |
| 日本板硝子 | 65,800 | 490.00 | 32,242,000 | |
| 有沢製作所 | 20,700 | 1,684.00 | 34,858,800 | |

| | | | | |
|--------------|-----------|-----------|---------------|---------------|
| 日本電気硝子 | 39,400 | 6,048.00 | 238,291,200 | |
| オハラ | 4,500 | 1,044.00 | 4,698,000 | 貸付株式数 1,700株 |
| 住友大阪セメント | 20,500 | 3,730.00 | 76,465,000 | |
| 太平洋セメント | 72,900 | 3,801.00 | 277,092,900 | |
| 日本ヒュ-ム | 10,300 | 2,674.00 | 27,542,200 | 貸付株式数 3,900株 |
| 日本コンクリ-ト | 22,900 | 322.00 | 7,373,800 | 貸付株式数 8,800株 |
| 三谷セキサン | 4,900 | 8,260.00 | 40,474,000 | |
| アジアパイルHD | 18,500 | 1,427.00 | 26,399,500 | 貸付株式数 7,100株 |
| 東海カーボン | 118,900 | 956.20 | 113,692,180 | |
| 日本カーボン | 6,800 | 4,405.00 | 29,954,000 | 貸付株式数 2,600株 |
| 東洋炭素 | 10,200 | 4,580.00 | 46,716,000 | 貸付株式数 4,000株 |
| ノリタケ | 12,400 | 5,550.00 | 68,820,000 | |
| TOTO | 73,300 | 4,233.00 | 310,278,900 | |
| 日本碍子 | 131,200 | 3,272.00 | 429,286,400 | |
| 日本特殊陶業 | 96,500 | 6,687.00 | 645,295,500 | |
| MARUWA | 4,900 | 41,000.00 | 200,900,000 | 貸付株式数 800株 |
| 品川リフラ | 14,500 | 2,039.00 | 29,565,500 | 貸付株式数 5,700株 |
| 黒崎播磨 | 9,600 | 4,140.00 | 39,744,000 | |
| ヨータイ | 6,900 | 1,767.00 | 12,192,300 | |
| フジインコーポレーテッド | 35,300 | 2,303.00 | 81,295,900 | 貸付株式数 13,800株 |
| ニチアス | 32,900 | 6,622.00 | 217,863,800 | 貸付株式数 800株 |
| 日本製鉄 | 3,313,600 | 602.40 | 1,996,112,640 | |
| 神戸製鋼所 | 244,400 | 1,988.00 | 485,867,200 | |
| 中山製鋼所 | 25,000 | 584.00 | 14,600,000 | 貸付株式数 9,800株 |
| 合同製鐵 | 6,800 | 3,760.00 | 25,568,000 | 貸付株式数 2,600株 |
| JFEホールディングス | 394,300 | 1,966.50 | 775,390,950 | |
| 東京製鐵 | 33,900 | 1,423.00 | 48,239,700 | |
| 共英製鋼 | 13,800 | 2,390.00 | 32,982,000 | |
| 大和工業 | 22,900 | 10,570.00 | 242,053,000 | |
| 東京鐵鋼 | 5,000 | 5,750.00 | 28,750,000 | |
| 大阪製鐵 | 5,600 | 2,753.00 | 15,416,800 | 貸付株式数 2,100株 |
| ヨドコウ | 70,100 | 1,315.00 | 92,181,500 | |
| 中部鋼鈑 | 11,100 | 2,090.00 | 23,199,000 | 貸付株式数 3,500株 |
| 丸一鋼管 | 122,100 | 1,436.00 | 175,335,600 | |
| モリ工業 | 13,700 | 996.00 | 13,645,200 | 貸付株式数 5,200株 |
| 大同特殊鋼 | 86,100 | 1,585.50 | 136,511,550 | |
| 日本冶金工 | 8,200 | 4,350.00 | 35,670,000 | |
| 愛知製鋼 | 22,700 | 2,895.00 | 65,716,500 | |
| 大平洋金属 | 10,300 | 2,085.00 | 21,475,500 | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| 新日本電工 | 66,600 | 328.00 | 21,844,800 | |
| 栗本鉄工所 | 28,200 | 1,625.00 | 45,825,000 | 貸付株式数 8,800株 |
| 日本製鋼所 | 36,100 | 7,395.00 | 266,959,500 | |
| 三菱製鋼 | 8,300 | 1,722.00 | 14,292,600 | |
| 日本精線 | 9,600 | 1,185.00 | 11,376,000 | |
| エンビプロHD | 12,000 | 565.00 | 6,780,000 | 貸付株式数 4,700株 |
| 大紀アルミニウム | 17,300 | 1,096.00 | 18,960,800 | |
| 日本軽金属HD | 35,500 | 2,450.00 | 86,975,000 | 貸付株式数 1,900株 |
| 三井金属 | 30,300 | 17,250.00 | 522,675,000 | |
| 東邦亜鉛 | 10,200 | 757.00 | 7,721,400 | 貸付株式数 3,900株 |
| 三菱マテリアル | 81,100 | 3,312.00 | 268,603,200 | |
| 住友鉱山 | 166,500 | 5,799.00 | 965,533,500 | |
| DOWAホールディングス | 32,800 | 6,897.00 | 226,221,600 | |
| 古河機金 | 14,400 | 3,545.00 | 51,048,000 | 貸付株式数 5,600株 |
| 大阪チタニウム | 21,100 | 1,774.00 | 37,431,400 | 貸付株式数 8,200株 (400株) |
| 東邦チタニウム | 22,000 | 1,239.00 | 27,258,000 | 貸付株式数 8,400株 |
| UACJ | 73,500 | 1,973.00 | 145,015,500 | 貸付株式数 2,200株 |
| CKサンエツ | 2,900 | 3,920.00 | 11,368,000 | |
| 古河電工 | 40,500 | 9,060.00 | 366,930,000 | |
| 住友電工 | 419,600 | 6,080.00 | 2,551,168,000 | |
| フジクラ | 156,400 | 15,960.00 | 2,496,144,000 | |
| SWCC | 17,700 | 10,110.00 | 178,947,000 | |
| 平河ビューテック | 7,000 | 2,771.00 | 19,397,000 | 貸付株式数 2,100株 |
| いよぎんホールディング | 151,800 | 2,554.00 | 387,697,200 | 貸付株式数 21,400株 |
| しずおかフィナンシャル | 255,500 | 2,390.00 | 610,645,000 | |
| ちゅうぎんフィナンシャ | 97,700 | 2,426.50 | 237,069,050 | |
| 楽天銀行 | 61,500 | 6,850.00 | 421,275,000 | 貸付株式数 10,000株 |
| 京都フィナンシャルG | 159,300 | 3,375.00 | 537,637,500 | |
| リョービ | 14,400 | 2,704.00 | 38,937,600 | |
| AREホールディングス | 49,200 | 3,100.00 | 152,520,000 | |
| JAPAN EYEWEAR HO | 4,000 | 1,972.00 | 7,888,000 | 貸付株式数 1,500株 |
| 東洋製罐グループHD | 60,700 | 3,830.00 | 232,481,000 | 貸付株式数 20,400株 |
| ホッカンホールディングス | 6,500 | 2,249.00 | 14,618,500 | |
| コロナ | 6,800 | 987.00 | 6,711,600 | |
| 横河ブリッジHLDGS | 20,900 | 2,982.00 | 62,323,800 | |
| 三和ホールディングス | 116,800 | 4,142.00 | 483,785,600 | |
| 文化シャツタ - | 38,200 | 2,003.00 | 76,514,600 | |
| 三協立山 | 15,300 | 615.00 | 9,409,500 | 貸付株式数 5,800株 |
| アルインコ | 9,300 | 1,124.00 | 10,453,200 | 貸付株式数 1,100株 |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| L I X I L | 190,000 | 1,866.50 | 354,635,000 | |
| ノーリツ | 21,400 | 1,961.00 | 41,965,400 | 貸付株式数 6,600株 |
| 長府製作所 | 12,100 | 2,005.00 | 24,260,500 | |
| リンナイ | 63,400 | 3,999.00 | 253,536,600 | |
| ユニプレス | 21,800 | 1,208.00 | 26,334,400 | |
| 日東精工 | 15,800 | 692.00 | 10,933,600 | 貸付株式数 6,100株 |
| 岡 部 | 21,700 | 955.00 | 20,723,500 | 貸付株式数 8,200株 |
| ジーテクト | 15,500 | 1,888.00 | 29,264,000 | 貸付株式数 6,000株 |
| 東 プ レ | 21,400 | 2,380.00 | 50,932,000 | |
| 高周波熱錬 | 18,200 | 1,232.00 | 22,422,400 | 貸付株式数 2,600株 |
| 東京製綱 | 7,200 | 1,501.00 | 10,807,200 | |
| サンコール | 12,000 | 892.00 | 10,704,000 | 貸付株式数 5,200株 |
| パイオラックス | 13,100 | 1,683.00 | 22,047,300 | 貸付株式数 300株 |
| エイチワン | 12,500 | 1,300.00 | 16,250,000 | |
| 日本発条 | 91,600 | 2,481.50 | 227,305,400 | 貸付株式数 1,700株 |
| 中央発條 | 7,900 | 3,450.00 | 27,255,000 | 貸付株式数 2,900株 |
| 三浦工業 | 55,200 | 2,964.50 | 163,640,400 | |
| タ ク マ | 35,500 | 2,465.00 | 87,507,500 | |
| アイ・アールジャパンHD | 6,300 | 798.00 | 5,027,400 | 貸付株式数 500株 |
| K e e P e r 技研 | 7,500 | 3,515.00 | 26,362,500 | 貸付株式数 2,900株 |
| G u n o s y | 9,600 | 519.00 | 4,982,400 | 貸付株式数 3,700株 |
| イー・ガーディアン | 3,700 | 1,619.00 | 5,990,300 | |
| ジャパンマテリアル | 37,000 | 1,510.00 | 55,870,000 | |
| ベクトル | 16,500 | 1,146.00 | 18,909,000 | |
| チャームケアコーポレーション | 10,100 | 1,260.00 | 12,726,000 | 貸付株式数 3,900株 |
| キャリアリンク | 4,400 | 2,552.00 | 11,228,800 | 貸付株式数 1,700株 |
| I B J | 9,300 | 770.00 | 7,161,000 | 貸付株式数 3,400株 |
| アサンテ | 6,000 | 1,567.00 | 9,402,000 | 貸付株式数 2,200株 |
| パリュールHR | 10,900 | 1,683.00 | 18,344,700 | 貸付株式数 4,200株 (700株) |
| M&Aキャピタルパートナー | 9,800 | 3,370.00 | 33,026,000 | 貸付株式数 3,800株 |
| ライドオンエクスプレスHD | 4,800 | 1,002.00 | 4,809,600 | |
| シグマクシス・ホールディング | 35,300 | 820.00 | 28,946,000 | |
| ウィルグループ | 11,200 | 1,125.00 | 12,600,000 | 貸付株式数 2,500株 |
| リクルートホールディングス | 895,500 | 8,849.00 | 7,924,279,500 | |
| エラン | 10,700 | 728.00 | 7,789,600 | 貸付株式数 400株 |
| ツ ガ ミ | 25,400 | 2,859.00 | 72,618,600 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|-----------|---------------|------------------------|
| オークマ | 20,800 | 3,440.00 | 71,552,000 | |
| 芝浦機械 | 14,200 | 4,315.00 | 61,273,000 | |
| アマダ | 173,500 | 1,860.00 | 322,710,000 | |
| アイダエンジニア | 22,500 | 1,165.00 | 26,212,500 | |
| F U J I | 47,400 | 3,467.00 | 164,335,800 | |
| 牧野フライス | 12,100 | 10,870.00 | 131,527,000 | |
| オーエスジー | 42,300 | 2,268.50 | 95,957,550 | 貸付株式数 16,600株 |
| 旭ダイヤモンド | 28,600 | 802.00 | 22,937,200 | 貸付株式数 5,300株 |
| DMG森精機 | 81,500 | 2,565.00 | 209,047,500 | 貸付株式数 29,200株 |
| ソデイツク | 29,000 | 916.00 | 26,564,000 | |
| ディスコ | 57,300 | 44,180.00 | 2,531,514,000 | |
| 日東工器 | 4,200 | 1,718.00 | 7,215,600 | |
| 日進工具 | 9,900 | 888.00 | 8,791,200 | 貸付株式数 3,800株 |
| 富士ダイス | 8,800 | 848.00 | 7,462,400 | 貸付株式数 3,400株 |
| 日本郵政 | 1,090,300 | 1,607.50 | 1,752,657,250 | |
| ベルシステム24HLDGS | 16,400 | 1,417.00 | 23,238,800 | |
| 鎌倉新書 | 12,000 | 606.00 | 7,272,000 | |
| エアトリ | 9,900 | 740.00 | 7,326,000 | 貸付株式数 3,800株 |
| アトラエ | 9,000 | 652.00 | 5,868,000 | |
| ストライク | 5,900 | 4,045.00 | 23,865,500 | |
| ソラスト | 29,200 | 824.00 | 24,060,800 | |
| セラク | 3,600 | 1,531.00 | 5,511,600 | |
| インソース | 26,300 | 860.00 | 22,618,000 | 貸付株式数 10,000株 |
| 豊田自動織機 | 100,500 | 17,725.00 | 1,781,362,500 | |
| リケンN P R | 13,700 | 3,485.00 | 47,744,500 | |
| 島精機製作所 | 18,400 | 940.00 | 17,296,000 | 貸付株式数 7,200株 |
| オプトラン | 19,500 | 1,897.00 | 36,991,500 | |
| イワキポンプ | 7,900 | 2,576.00 | 20,350,400 | 貸付株式数 3,100株 |
| フリーー | 12,500 | 1,051.00 | 13,137,500 | |
| ヤマシンフィルタ | 24,600 | 572.00 | 14,071,200 | 貸付株式数 9,600株 |
| 日阪製作所 | 13,900 | 1,484.00 | 20,627,600 | |
| やまびこ | 19,400 | 2,797.00 | 54,261,800 | 貸付株式数 4,800株 |
| 野村マイクロ・サイエンス | 21,500 | 2,568.00 | 55,212,000 | 貸付株式数 8,400株 (100株) |
| 平田機工 | 17,100 | 2,290.00 | 39,159,000 | |
| P E G A S U S | 13,100 | 750.00 | 9,825,000 | 貸付株式数 400株 |
| マルマエ | 4,600 | 1,847.00 | 8,496,200 | 貸付株式数 1,800株 |
| タツモ | 7,800 | 1,891.00 | 14,749,800 | 貸付株式数 3,000株 |
| ナプテスコ | 69,300 | 3,619.00 | 250,796,700 | |
| 三井海洋開発 | 30,100 | 11,480.00 | 345,548,000 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| レオン自動機 | 13,800 | 1,424.00 | 19,651,200 | |
| S M C | 33,800 | 53,980.00 | 1,824,524,000 | |
| ホソカワミクロン | 9,000 | 5,420.00 | 48,780,000 | 貸付株式数 3,400株 |
| ユニオンツール | 5,200 | 8,160.00 | 42,432,000 | 貸付株式数 1,900株 |
| 瑞 光 | 10,200 | 991.00 | 10,108,200 | 貸付株式数 500株 |
| オイレス工業 | 14,700 | 2,273.00 | 33,413,100 | |
| 日精エーエスピー | 4,600 | 6,090.00 | 28,014,000 | |
| サトー | 16,300 | 2,408.00 | 39,250,400 | |
| 技研製作所 | 10,700 | 1,912.00 | 20,458,400 | 貸付株式数 4,200株 |
| 日本エアーテック | 5,600 | 1,207.00 | 6,759,200 | 貸付株式数 1,900株 |
| 日精樹脂工業 | 7,900 | 814.00 | 6,430,600 | 貸付株式数 2,700株 |
| ワイエイシイホールディングス | 10,300 | 1,000.00 | 10,300,000 | 貸付株式数 4,000株 |
| 小松製作所 | 586,400 | 4,987.00 | 2,924,376,800 | |
| 住友重機械 | 70,400 | 4,155.00 | 292,512,000 | |
| 日立建機 | 47,400 | 4,609.00 | 218,466,600 | |
| 日 工 | 22,900 | 785.00 | 17,976,500 | |
| 巴工業 | 13,200 | 1,709.00 | 22,558,800 | 貸付株式数 5,000株 |
| 井関農機 | 11,100 | 1,843.00 | 20,457,300 | 貸付株式数 4,300株 |
| T O W A | 43,000 | 1,911.00 | 82,173,000 | 貸付株式数 16,900株 |
| 北川鉄工所 | 4,700 | 1,723.00 | 8,098,100 | |
| ローツェ | 69,900 | 1,994.00 | 139,380,600 | |
| クボタ | 608,300 | 2,229.00 | 1,355,900,700 | |
| 荏原実業 | 6,300 | 4,230.00 | 26,649,000 | |
| 東洋エンジニア | 17,000 | 2,151.00 | 36,567,000 | 貸付株式数 6,600株 |
| 三菱化工機 | 12,500 | 3,175.00 | 39,687,500 | |
| 月島ホールディングス | 17,500 | 2,902.00 | 50,785,000 | |
| 帝国電機製作所 | 8,200 | 3,050.00 | 25,010,000 | 貸付株式数 1,600株 |
| 新東工業 | 24,000 | 1,049.00 | 25,176,000 | |
| 渋谷工業 | 11,200 | 3,400.00 | 38,080,000 | |
| アイチ コーポレーション | 19,700 | 1,334.00 | 26,279,800 | 貸付株式数 7,600株 |
| 小森コーポレーション | 28,300 | 1,540.00 | 43,582,000 | |
| 鶴見製作所 | 16,800 | 2,213.00 | 37,178,400 | 貸付株式数 6,200株 |
| 酒井重工業 | 4,700 | 2,031.00 | 9,545,700 | |
| 荏原製作所 | 244,300 | 3,566.00 | 871,173,800 | |
| 西島製作所 | 9,000 | 1,931.00 | 17,379,000 | |
| A I R M A N | 12,000 | 1,763.00 | 21,156,000 | 貸付株式数 4,600株 |
| ダイキン工業 | 154,900 | 19,635.00 | 3,041,461,500 | |
| オルガノ | 16,300 | 12,145.00 | 197,963,500 | 貸付株式数 3,200株 |
| ト - ヨ - カネツ | 4,900 | 4,660.00 | 22,834,000 | |

| | | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|-------|--------|
| 栗田工業 | 71,700 | 6,218.00 | 445,830,600 | 貸付株式数 | 800株 |
| 椿本チエイン | 51,500 | 2,217.00 | 114,175,500 | | |
| 日機装 | 27,400 | 1,582.00 | 43,346,800 | | |
| 木村化工機 | 9,100 | 1,205.00 | 10,965,500 | | |
| レイズネクスト | 16,700 | 2,344.00 | 39,144,800 | | |
| アネスト岩田 | 22,100 | 1,592.00 | 35,183,200 | | |
| ダイフク | 200,800 | 4,805.00 | 964,844,000 | | |
| サムコ | 3,200 | 3,830.00 | 12,256,000 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| タダノ | 62,700 | 1,067.00 | 66,900,900 | | |
| フジテック | 34,100 | 5,670.00 | 193,347,000 | | |
| C K D | 35,900 | 2,754.00 | 98,868,600 | | |
| 平和 | 35,200 | 1,958.00 | 68,921,600 | 貸付株式数 | 4,700株 |
| 理想科学工業 | 19,000 | 1,235.00 | 23,465,000 | 貸付株式数 | 7,400株 |
| S A N K Y O | 126,000 | 2,513.00 | 316,638,000 | | |
| 日本金銭機械 | 14,400 | 1,001.00 | 14,414,400 | 貸付株式数 | 5,600株 |
| マースグループHLDGS | 10,000 | 3,110.00 | 31,100,000 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| ガリレイ | 17,500 | 3,740.00 | 65,450,000 | | |
| ダイコク電機 | 5,900 | 2,885.00 | 17,021,500 | 貸付株式数 | 2,300株 |
| 竹内製作所 | 21,600 | 6,670.00 | 144,072,000 | | |
| アマノ | 31,300 | 4,213.00 | 131,866,900 | | |
| J U K I | 18,400 | 486.00 | 8,942,400 | | |
| ジャノメ | 8,800 | 1,145.00 | 10,076,000 | | |
| ブラザー工業 | 147,600 | 3,118.00 | 460,216,800 | | |
| マックス | 16,400 | 6,560.00 | 107,584,000 | | |
| モリタホールディングス | 18,600 | 2,714.00 | 50,480,400 | | |
| グローリー | 31,200 | 3,956.00 | 123,427,200 | | |
| 新晃工業 | 34,100 | 1,407.00 | 47,978,700 | | |
| 大和冷機工業 | 18,200 | 1,598.00 | 29,083,600 | 貸付株式数 | 5,000株 |
| セガサミーホールディングス | 97,400 | 2,497.00 | 243,207,800 | | |
| T P R | 27,200 | 1,286.00 | 34,979,200 | | |
| ツバキ・ナカシマ | 27,500 | 349.00 | 9,597,500 | | |
| ホシザキ | 76,600 | 5,262.00 | 403,069,200 | | |
| 大豊工業 | 9,000 | 801.00 | 7,209,000 | | |
| 日本精工 | 220,200 | 938.10 | 206,569,620 | | |
| N T N | 281,400 | 354.90 | 99,868,860 | | |
| ジェイテクト | 112,300 | 1,715.50 | 192,650,650 | | |
| 不二越 | 8,800 | 4,175.00 | 36,740,000 | | |
| ミネベアミツミ | 206,900 | 3,101.00 | 641,596,900 | | |
| 日本トムソン | 32,400 | 774.00 | 25,077,600 | 貸付株式数 | 5,500株 |

| | | | | |
|------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| T H K | 63,000 | 4,066.00 | 256,158,000 | |
| Y U S H I N | 9,400 | 721.00 | 6,777,400 | 貸付株式数 3,700株 |
| 前澤給装工業 | 8,500 | 1,550.00 | 13,175,000 | |
| イーグル工業 | 13,100 | 2,768.00 | 36,260,800 | |
| P I L L A R | 11,000 | 4,455.00 | 49,005,000 | 貸付株式数 4,300株 |
| キッツ | 42,400 | 1,673.00 | 70,935,200 | 貸付株式数 9,100株 |
| 日 立 | 3,027,000 | 4,812.00 | 14,565,924,000 | |
| 三菱電機 | 1,303,100 | 4,533.00 | 5,906,952,300 | |
| 富士電機 | 85,500 | 11,150.00 | 953,325,000 | |
| 安川電機 | 129,200 | 4,396.00 | 567,963,200 | |
| シンフォニア テクノロジー | 13,100 | 8,910.00 | 116,721,000 | 貸付株式数 700株 |
| 明 電 舎 | 22,100 | 5,450.00 | 120,445,000 | |
| 山洋電気 | 13,700 | 3,950.00 | 54,115,000 | |
| デンヨー | 8,700 | 3,295.00 | 28,666,500 | 貸付株式数 3,300株 |
| PHCホールディングス | 22,300 | 1,092.00 | 24,351,600 | 貸付株式数 8,600株 |
| KOKUSAI ELECTRIC | 136,300 | 4,514.00 | 615,258,200 | |
| ソシオネクスト | 103,000 | 2,132.00 | 219,596,000 | 貸付株式数 39,700株 |
| ベイカレント | 89,000 | 6,744.00 | 600,216,000 | |
| ORCHESTRA HLDGS | 2,700 | 1,209.00 | 3,264,300 | 貸付株式数 1,000株 |
| アイモバイル | 17,900 | 487.00 | 8,717,300 | |
| M S - J a p a n | 7,700 | 1,009.00 | 7,769,300 | 貸付株式数 3,000株 |
| ジャパンエレベーターSHD | 102,000 | 1,771.00 | 180,642,000 | |
| エル・ティー・エス | 1,700 | 2,191.00 | 3,724,700 | 貸付株式数 100株 |
| ミダックホールディングス | 6,100 | 1,903.00 | 11,608,300 | 貸付株式数 2,400株 |
| キュービーネットHLDGS | 7,000 | 1,361.00 | 9,527,000 | 貸付株式数 2,500株 |
| オープングループ | 16,500 | 323.00 | 5,329,500 | 貸付株式数 7,400株 |
| 三桜工業 | 18,000 | 812.00 | 14,616,000 | |
| マキタ | 148,000 | 4,725.00 | 699,300,000 | |
| 東芝テック | 15,200 | 2,785.00 | 42,332,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 7,400 | 16,570.00 | 122,618,000 | |
| マブチモーター | 57,400 | 2,771.50 | 159,084,100 | |
| ユーエムシーエレクトロニクス | 7,300 | 339.00 | 2,474,700 | 貸付株式数 2,900株 |
| トレックス・セミコンダクター | 4,600 | 1,399.00 | 6,435,400 | 貸付株式数 400株 |
| 東光高岳 | 6,500 | 3,615.00 | 23,497,500 | 貸付株式数 2,400株 |
| ダブル・スコープ | 38,900 | 149.00 | 5,796,100 | 貸付株式数 15,200株 |
| 宮越ホールディングス | 5,300 | 794.00 | 4,208,200 | 貸付株式数 2,000株 |
| ダイヘン | 11,100 | 9,290.00 | 103,119,000 | |

| | | | | |
|--------------------|-----------|----------|----------------|---------------------------|
| ヤーマン | 23,100 | 799.00 | 18,456,900 | 貸付株式数 9,000株 (200株) |
| JVCケンウッド | 93,900 | 1,166.50 | 109,534,350 | |
| ミマキエンジニアリング | 9,900 | 1,590.00 | 15,741,000 | 貸付株式数 3,800株 |
| 大崎電気 | 22,700 | 1,182.00 | 26,831,400 | |
| オムロン | 99,900 | 3,915.00 | 391,108,500 | |
| 日東工業 | 14,300 | 4,070.00 | 58,201,000 | |
| I D E C | 15,200 | 2,885.00 | 43,852,000 | |
| ジーエス・ユアサ コーポ | 48,700 | 3,697.00 | 180,043,900 | |
| B U F F A L O | 3,200 | 4,700.00 | 15,040,000 | 貸付株式数 1,200株 |
| テクノメディカ | 2,300 | 2,267.00 | 5,214,100 | |
| ダイヤモンドエレクトリク HD | 4,800 | 571.00 | 2,740,800 | 貸付株式数 1,800株 |
| 日本電気 | 781,200 | 5,314.00 | 4,151,296,800 | |
| 富 士 通 | 1,094,700 | 4,202.00 | 4,599,929,400 | |
| 沖 電 気 | 57,600 | 1,822.00 | 104,947,200 | |
| 電気興業 | 4,800 | 2,636.00 | 12,652,800 | |
| サンケン電気 | 12,200 | 5,455.00 | 66,551,000 | 貸付株式数 3,900株 |
| アイホン | 6,200 | 2,882.00 | 17,868,400 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 1,153,500 | 2,015.00 | 2,324,302,500 | |
| セイコーエプソン | 148,100 | 2,004.50 | 296,866,450 | |
| ワコム | 71,400 | 800.00 | 57,120,000 | |
| アルバック | 26,100 | 6,565.00 | 171,346,500 | |
| アクセル | 5,400 | 1,200.00 | 6,480,000 | |
| E I Z O | 17,400 | 2,210.00 | 38,454,000 | 貸付株式数 2,800株 |
| ジャパディスプレイ | 61,700 | 20.00 | 1,234,000 | |
| 日本信号 | 30,100 | 1,311.00 | 39,461,100 | |
| 京三製作所 | 27,700 | 611.00 | 16,924,700 | 貸付株式数 10,600株 |
| 能美防災 | 16,100 | 3,975.00 | 63,997,500 | |
| ホーチキ | 9,300 | 4,350.00 | 40,455,000 | 貸付株式数 1,100株 |
| エレコム | 28,400 | 1,771.00 | 50,296,400 | |
| パナソニック ホールディン ク | 1,405,500 | 1,971.00 | 2,770,240,500 | |
| シャープ | 143,200 | 772.10 | 110,564,720 | 貸付株式数 33,100株 |
| アンリツ | 77,800 | 2,183.50 | 169,876,300 | |
| ソニーグループ | 4,063,100 | 4,056.00 | 16,479,933,600 | |
| T D K | 1,027,400 | 2,218.50 | 2,279,286,900 | |
| 帝国通信工業 | 5,200 | 2,621.00 | 13,629,200 | 貸付株式数 2,000株 |
| タムラ製作所 | 47,400 | 560.00 | 26,544,000 | |
| アルプスアルパイン | 91,700 | 1,939.00 | 177,806,300 | |

| | | | | |
|-------------|-----------|-----------|---------------|--------------|
| 日本電波工業 | 14,300 | 944.00 | 13,499,200 | |
| 鈴木 | 6,300 | 2,328.00 | 14,666,400 | |
| メイコー | 10,600 | 10,790.00 | 114,374,000 | |
| 日本トリム | 2,700 | 5,000.00 | 13,500,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| フオスタ - 電機 | 11,000 | 2,700.00 | 29,700,000 | |
| S M K | 2,900 | 2,607.00 | 7,560,300 | |
| ヨコオ | 10,500 | 2,180.00 | 22,890,000 | |
| ホシデン | 23,900 | 2,401.00 | 57,383,900 | |
| ヒロセ電機 | 17,300 | 17,090.00 | 295,657,000 | |
| 日本航空電子 | 27,900 | 2,471.00 | 68,940,900 | |
| T O A | 12,000 | 1,571.00 | 18,852,000 | 貸付株式数 300株 |
| マクセル | 24,800 | 2,430.00 | 60,264,000 | |
| 古野電気 | 15,500 | 7,370.00 | 114,235,000 | |
| スミダコーポレーション | 20,400 | 1,153.00 | 23,521,200 | |
| アイコム | 4,600 | 2,818.00 | 12,962,800 | |
| リオン | 4,900 | 2,570.00 | 12,593,000 | |
| 横河電機 | 130,200 | 4,920.00 | 640,584,000 | |
| 新電元工業 | 5,000 | 3,200.00 | 16,000,000 | 貸付株式数 1,400株 |
| アズビル | 286,100 | 1,396.00 | 399,395,600 | |
| 日本光電工業 | 97,900 | 1,639.50 | 160,507,050 | |
| チノー | 9,800 | 1,356.00 | 13,288,800 | 貸付株式数 3,700株 |
| 日本電子材料 | 7,300 | 3,575.00 | 26,097,500 | 貸付株式数 2,800株 |
| 堀場製作所 | 22,300 | 15,420.00 | 343,866,000 | 貸付株式数 8,700株 |
| アドバンテスト | 371,200 | 18,805.00 | 6,980,416,000 | |
| エスペック | 11,500 | 3,285.00 | 37,777,500 | |
| キーエンス | 117,800 | 56,030.00 | 6,600,334,000 | |
| 日置電機 | 6,200 | 6,070.00 | 37,634,000 | 貸付株式数 2,300株 |
| シスメックス | 305,000 | 1,560.50 | 475,952,500 | |
| 日本マイクロニクス | 19,400 | 6,010.00 | 116,594,000 | 貸付株式数 7,600株 |
| メガチップス | 8,200 | 7,790.00 | 63,878,000 | |
| OBARA GROUP | 6,400 | 3,875.00 | 24,800,000 | 貸付株式数 2,400株 |
| デンソー | 1,154,000 | 2,126.50 | 2,453,981,000 | |
| コーセル | 14,500 | 1,153.00 | 16,718,500 | 貸付株式数 5,600株 |
| イリソ電子工業 | 9,700 | 3,225.00 | 31,282,500 | |
| オプテックスグループ | 19,900 | 2,718.00 | 54,088,200 | |
| 千代田インテグレ | 3,600 | 3,295.00 | 11,862,000 | |
| レーザーテック | 45,700 | 28,090.00 | 1,283,713,000 | |
| スタンレー電気 | 60,300 | 3,042.00 | 183,432,600 | |
| ウシオ電機 | 48,900 | 2,439.00 | 119,267,100 | 貸付株式数 9,900株 |
| 日本セラミック | 9,600 | 3,695.00 | 35,472,000 | |

| | | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|---------------|
| 山一電機 | 11,500 | 5,470.00 | 62,905,000 | |
| 図研 | 9,800 | 4,845.00 | 47,481,000 | |
| 日本電子 | 27,200 | 4,795.00 | 130,424,000 | |
| カシオ | 94,200 | 1,264.50 | 119,115,900 | 貸付株式数 36,400株 |
| ファナック | 562,500 | 5,673.00 | 3,191,062,500 | |
| 日本シイエムケイ | 37,700 | 492.00 | 18,548,400 | 貸付株式数 14,800株 |
| エンプラス | 3,400 | 8,730.00 | 29,682,000 | 貸付株式数 1,300株 |
| 大真空 | 17,000 | 550.00 | 9,350,000 | 貸付株式数 6,500株 |
| ローム | 231,200 | 2,102.50 | 486,098,000 | |
| 浜松ホトニクス | 196,800 | 1,645.00 | 323,736,000 | |
| 三井ハイテック | 60,800 | 726.00 | 44,140,800 | 貸付株式数 23,400株 |
| 京セラ | 731,800 | 2,196.50 | 1,607,398,700 | |
| 太陽誘電 | 63,100 | 3,363.00 | 212,205,300 | 貸付株式数 24,300株 |
| 村田製作所 | 1,124,000 | 3,159.00 | 3,550,716,000 | |
| 双葉電子工業 | 24,300 | 557.00 | 13,535,100 | 貸付株式数 9,500株 |
| 日東電工 | 358,700 | 3,679.00 | 1,319,657,300 | |
| 東海理化電機 | 31,400 | 3,085.00 | 96,869,000 | |
| ニチコン | 30,800 | 1,605.00 | 49,434,000 | 貸付株式数 12,100株 |
| 日本ケミコン | 15,200 | 1,317.00 | 20,018,400 | |
| K O A | 21,500 | 1,341.00 | 28,831,500 | |
| 三井E & S | 59,000 | 5,158.00 | 304,322,000 | |
| カナデビア | 97,500 | 933.00 | 90,967,500 | |
| 三菱重工業 | 2,228,900 | 3,811.00 | 8,494,337,900 | |
| 川崎重工業 | 88,800 | 11,030.00 | 979,464,000 | |
| I H I | 620,000 | 2,749.50 | 1,704,690,000 | |
| 名村造船所 | 36,700 | 3,545.00 | 130,101,500 | 貸付株式数 12,900株 |
| マネジメントソリューションズ | 6,700 | 1,297.00 | 8,689,900 | 貸付株式数 2,200株 |
| プロレド・パートナーズ | 2,900 | 617.00 | 1,789,300 | 貸付株式数 1,000株 |
| フロンティア・マネジメント | 4,700 | 663.00 | 3,116,100 | 貸付株式数 1,800株 |
| アンビスホールディングス | 25,900 | 445.00 | 11,525,500 | 貸付株式数 8,800株 |
| カーブスホールディングス | 33,100 | 788.00 | 26,082,800 | |
| フォーラムエンジニアリング | 13,600 | 1,707.00 | 23,215,200 | |
| FAST FITNESS JAP | 3,200 | 2,308.00 | 7,385,600 | |
| MACBEE PLANET | 4,500 | 1,539.00 | 6,925,500 | 貸付株式数 1,700株 |
| 日本車輛 | 4,500 | 3,755.00 | 16,897,500 | |
| 三菱ロジスネクスト | 18,500 | 1,539.00 | 28,471,500 | |
| フルサト・マルカHD | 11,100 | 2,262.00 | 25,108,200 | 貸付株式数 4,200株 |

| | | | | | |
|---------------|-----------|----------|----------------|-------|----------|
| ヤマエグループHD | 12,200 | 2,488.00 | 30,353,600 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| F P G | 36,900 | 2,178.00 | 80,368,200 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| ライフネット生命保険 | 18,600 | 1,910.00 | 35,526,000 | 貸付株式数 | 8,100株 |
| 全国保証 | 66,700 | 3,126.00 | 208,504,200 | | |
| めぶきフィナンシャルG | 542,300 | 1,053.50 | 571,313,050 | | |
| ジャパンインベストメントA | 18,800 | 2,202.00 | 41,397,600 | 貸付株式数 | 6,400株 |
| 東京きらぼしFG | 14,900 | 8,570.00 | 127,693,000 | | |
| 九州フィナンシャルG | 224,500 | 984.20 | 220,952,900 | | |
| かんぼ生命保険 | 131,000 | 4,468.00 | 585,308,000 | 貸付株式数 | 7,600株 |
| ゆうちょ銀行 | 1,260,000 | 2,024.50 | 2,550,870,000 | | |
| 富山第一銀行 | 36,800 | 1,755.00 | 64,584,000 | 貸付株式数 | 14,100株 |
| 横浜フィナンシャルグループ | 605,000 | 1,275.50 | 771,677,500 | | |
| ジェイリース | 8,700 | 1,420.00 | 12,354,000 | | |
| 西日本フィナンシャルHD | 70,900 | 3,040.00 | 215,536,000 | | |
| S B Iアルヒ | 11,800 | 884.00 | 10,431,200 | 貸付株式数 | 4,500株 |
| プレミアグループ | 19,700 | 1,886.00 | 37,154,200 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| 日産自動車 | 1,799,500 | 396.30 | 713,141,850 | 貸付株式数 | 706,900株 |
| いすゞ自動車 | 314,300 | 2,407.50 | 756,677,250 | | |
| トヨタ自動車 | 6,261,400 | 3,363.00 | 21,057,088,200 | | |
| 日野自動車 | 177,100 | 382.00 | 67,652,200 | | |
| 三菱自動車工業 | 450,300 | 370.60 | 166,881,180 | 貸付株式数 | 176,900株 |
| 武蔵精密工業 | 26,000 | 2,494.00 | 64,844,000 | | |
| 日産車体 | 17,900 | 1,000.00 | 17,900,000 | | |
| 新明和工業 | 33,900 | 1,837.00 | 62,274,300 | | |
| 極東開発工業 | 19,500 | 2,888.00 | 56,316,000 | | |
| トピー工業 | 8,500 | 3,015.00 | 25,627,500 | | |
| ティラド | 2,300 | 8,350.00 | 19,205,000 | | |
| タチエス | 21,700 | 2,042.00 | 44,311,400 | | |
| N O K | 45,800 | 2,737.00 | 125,354,600 | | |
| フタバ産業 | 31,600 | 1,046.00 | 33,053,600 | | |
| カヤバ | 20,000 | 4,540.00 | 90,800,000 | | |
| 市光工業 | 25,500 | 492.00 | 12,546,000 | | |
| 大同メタル工業 | 23,000 | 922.00 | 21,206,000 | | |
| プレス工業 | 48,500 | 807.00 | 39,139,500 | | |
| 太平洋工業 | 25,400 | 3,160.00 | 80,264,000 | | |
| アイシン | 300,900 | 2,954.00 | 888,858,600 | | |
| マ ッ ダ | 389,600 | 1,162.50 | 452,910,000 | | |
| 本田技研 | 2,558,200 | 1,543.00 | 3,947,302,600 | | |
| スズキ | 865,300 | 2,332.50 | 2,018,312,250 | | |

| | | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|----------------|
| SUBARU | 355,200 | 3,446.00 | 1,224,019,200 | |
| ヤマハ発動機 | 583,000 | 1,184.00 | 690,272,000 | 貸付株式数 223,700株 |
| 小糸製作所 | 122,000 | 2,318.00 | 282,796,000 | |
| エクセディ | 19,300 | 5,540.00 | 106,922,000 | |
| ミツバ | 22,400 | 972.00 | 21,772,800 | |
| 豊田合成 | 39,300 | 3,951.00 | 155,274,300 | |
| 愛三工業 | 19,500 | 2,240.00 | 43,680,000 | |
| ヨロズ | 11,000 | 940.00 | 10,340,000 | 貸付株式数 3,400株 |
| エフ・シー・シー | 22,900 | 3,705.00 | 84,844,500 | |
| シマノ | 50,200 | 16,550.00 | 830,810,000 | |
| テイ・エス テック | 43,700 | 1,806.00 | 78,922,200 | |
| 33FG | 11,200 | 4,165.00 | 46,648,000 | |
| 第四北越フィナンシャルG | 109,300 | 1,616.00 | 176,628,800 | |
| ひろぎんHLDGS | 161,400 | 1,581.50 | 255,254,100 | 貸付株式数 11,900株 |
| おきなわFG | 9,900 | 4,640.00 | 45,936,000 | |
| ダイレクトマーケティングミクス | 12,400 | 299.00 | 3,707,600 | |
| ポピンズ | 1,800 | 1,452.00 | 2,613,600 | |
| LITALICO | 11,000 | 1,298.00 | 14,278,000 | 貸付株式数 3,400株 |
| 十六FG | 16,300 | 6,620.00 | 107,906,000 | |
| CCIグループ | 121,100 | 704.00 | 85,254,400 | |
| ネットプロHD | 35,000 | 575.00 | 20,125,000 | 貸付株式数 14,400株 |
| プロクレアホールディングス | 14,200 | 1,796.00 | 25,503,200 | |
| FPパートナー | 5,100 | 2,036.00 | 10,383,600 | 貸付株式数 2,000株 |
| あいちフィナンシャルグル | 23,800 | 4,600.00 | 109,480,000 | 貸付株式数 900株 |
| 小野建 | 13,300 | 1,390.00 | 18,487,000 | 貸付株式数 2,100株 |
| ノジマ | 122,000 | 1,195.00 | 145,790,000 | |
| 佐島電機 | 7,900 | 1,819.00 | 14,370,100 | |
| カップ・クリエイト | 19,600 | 1,559.00 | 30,556,400 | 貸付株式数 7,400株 |
| 伯東 | 7,400 | 3,860.00 | 28,564,000 | 貸付株式数 2,800株 |
| コンドーテック | 10,400 | 1,511.00 | 15,714,400 | 貸付株式数 4,000株 |
| ナガイレーベン | 15,700 | 1,920.00 | 30,144,000 | 貸付株式数 3,500株 |
| 良品計画 | 272,100 | 2,973.50 | 809,089,350 | |
| 松田産業 | 9,500 | 5,040.00 | 47,880,000 | |
| 第一興商 | 41,200 | 1,670.00 | 68,804,000 | |
| メディパルHD | 135,200 | 2,793.00 | 377,613,600 | |
| アドヴァングループ | 8,000 | 904.00 | 7,232,000 | |
| SPK | 5,100 | 2,310.00 | 11,781,000 | |
| 萩原電気HLDGS | 5,400 | 3,535.00 | 19,089,000 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| アルビス | 4,100 | 2,647.00 | 10,852,700 | |
| アズワン | 39,800 | 2,455.00 | 97,709,000 | 貸付株式数 8,500株 |
| スズデン | 7,100 | 1,646.00 | 11,686,600 | |
| シモジマ | 9,400 | 1,350.00 | 12,690,000 | |
| ドウシシャ | 14,800 | 3,210.00 | 47,508,000 | |
| 高速 | 8,300 | 2,911.00 | 24,161,300 | 貸付株式数 3,200株 |
| G-7ホールディングス | 13,600 | 1,403.00 | 19,080,800 | |
| たけびし | 4,800 | 2,141.00 | 10,276,800 | |
| イオン北海道 | 36,800 | 904.00 | 33,267,200 | 貸付株式数 14,400株 |
| コジマ | 20,600 | 1,177.00 | 24,246,200 | 貸付株式数 8,000株 |
| コーナン商事 | 13,700 | 4,010.00 | 54,937,000 | |
| エコス | 4,600 | 3,085.00 | 14,191,000 | 貸付株式数 1,400株 |
| ワタミ | 15,000 | 970.00 | 14,550,000 | |
| リックス | 3,100 | 3,695.00 | 11,454,500 | 貸付株式数 200株 |
| システムソフト | 41,100 | 62.00 | 2,548,200 | 貸付株式数 15,500株 |
| パンパシフィックHD | 1,259,500 | 969.70 | 1,221,337,150 | |
| 丸文 | 11,100 | 1,200.00 | 13,320,000 | |
| 西松屋チェーン | 27,600 | 2,244.00 | 61,934,400 | 貸付株式数 10,600株 |
| ゼンショーホールディングス | 63,700 | 9,225.00 | 587,632,500 | |
| ハピネット | 8,500 | 5,770.00 | 49,045,000 | |
| 幸楽苑 | 11,900 | 1,115.00 | 13,268,500 | 貸付株式数 4,600株 |
| 橋本総業HLDGS | 4,200 | 1,266.00 | 5,317,200 | 貸付株式数 1,000株 |
| 日本ライフライン | 31,400 | 1,550.00 | 48,670,000 | |
| サイゼリヤ | 16,100 | 5,450.00 | 87,745,000 | |
| タカショー | 10,100 | 415.00 | 4,191,500 | 貸付株式数 3,900株 |
| V Tホールディングス | 48,600 | 523.00 | 25,417,800 | |
| アルゴグラフィックス | 42,300 | 1,646.00 | 69,625,800 | |
| 魚力 | 4,300 | 2,376.00 | 10,216,800 | |
| I D O M | 37,700 | 1,268.00 | 47,803,600 | |
| 日本エム・ディ・エム | 9,300 | 483.00 | 4,491,900 | |
| ユナイテッドアローズ | 13,300 | 2,424.00 | 32,239,200 | |
| 進和 | 7,300 | 3,020.00 | 22,046,000 | |
| ダイトロン | 5,200 | 4,765.00 | 24,778,000 | |
| ハイデイ日高 | 20,200 | 3,505.00 | 70,801,000 | 貸付株式数 7,900株 |
| シークス | 20,000 | 1,296.00 | 25,920,000 | 貸付株式数 7,800株 |
| コロワイド | 70,300 | 1,733.00 | 121,829,900 | 貸付株式数 27,600株 (1,100株) |
| オーハシテクニカ | 5,800 | 2,339.00 | 13,566,200 | |
| 壱番屋 | 49,200 | 941.00 | 46,297,200 | 貸付株式数 19,000株 |

| | | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|-------|---------|
| 白銅 | 3,500 | 2,209.00 | 7,731,500 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| スギホールディングス | 66,900 | 3,651.00 | 244,251,900 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 薬王堂ホールディングス | 7,000 | 2,138.00 | 14,966,000 | | |
| ダブルエー | 5,000 | 1,350.00 | 6,750,000 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| 島津製作所 | 156,500 | 4,261.00 | 666,846,500 | | |
| J M S | 10,900 | 438.00 | 4,774,200 | | |
| 長野計器 | 7,700 | 2,365.00 | 18,210,500 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| ブイ・テクノロジー | 5,800 | 2,832.00 | 16,425,600 | | |
| スター精密 | 18,900 | 2,207.00 | 41,712,300 | | |
| 東京計器 | 9,800 | 5,100.00 | 49,980,000 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| 愛知時計 | 5,600 | 2,612.00 | 14,627,200 | | |
| インターアクション | 7,100 | 1,351.00 | 9,592,100 | 貸付株式数 | 900株 |
| 東京精密 | 22,300 | 10,305.00 | 229,801,500 | | |
| マニー | 47,100 | 1,473.00 | 69,378,300 | 貸付株式数 | 15,900株 |
| ニコン | 146,900 | 1,693.00 | 248,701,700 | 貸付株式数 | 8,300株 |
| オリンパス | 652,300 | 1,991.00 | 1,298,729,300 | | |
| 理研計器 | 16,700 | 3,145.00 | 52,521,500 | | |
| SCREENホールディングス | 42,000 | 12,790.00 | 537,180,000 | | |
| キヤノン電子 | 12,800 | 3,640.00 | 46,592,000 | | |
| タムロン | 60,200 | 1,033.00 | 62,186,600 | 貸付株式数 | 23,200株 |
| HOYA | 226,700 | 23,635.00 | 5,358,054,500 | | |
| ノーリツ鋼機 | 33,100 | 1,887.00 | 62,459,700 | | |
| A&Dホロンホールディングス | 15,900 | 1,841.00 | 29,271,900 | | |
| 朝日インテック | 143,600 | 3,019.00 | 433,528,400 | 貸付株式数 | 21,800株 |
| キヤノン | 528,700 | 4,665.00 | 2,466,385,500 | | |
| リコー | 276,000 | 1,356.00 | 374,256,000 | | |
| シチズン時計 | 97,500 | 1,270.00 | 123,825,000 | | |
| メニコン | 43,900 | 1,559.00 | 68,440,100 | 貸付株式数 | 3,100株 |
| パラマウントベッドHD | 10,000 | 3,505.00 | 35,050,000 | | |
| トランザクション | 12,700 | 1,069.00 | 13,576,300 | 貸付株式数 | 4,800株 |
| ニホンフラッシュ | 11,000 | 825.00 | 9,075,000 | | |
| 前田工織 | 24,000 | 1,964.00 | 47,136,000 | | |
| アートネイチャー | 10,600 | 814.00 | 8,628,400 | | |
| フルヤ金属 | 10,100 | 3,140.00 | 31,714,000 | 貸付株式数 | 100株 |
| パンダイナムコHLDGS | 314,900 | 4,221.00 | 1,329,192,900 | | |
| SHOEI | 30,800 | 1,776.00 | 54,700,800 | | |
| フランスベッドHLDGS | 16,800 | 1,328.00 | 22,310,400 | 貸付株式数 | 6,600株 |
| マーベラス | 21,900 | 506.00 | 11,081,400 | | |
| パイロットコーポレーション | 18,000 | 4,782.00 | 86,076,000 | | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| 萩原工業 | 7,900 | 1,642.00 | 12,971,800 | |
| エイベックス | 20,200 | 1,171.00 | 23,654,200 | |
| フジシールインターナショナル | 23,800 | 3,065.00 | 72,947,000 | |
| タカラトミー | 57,700 | 2,725.50 | 157,261,350 | |
| 広済堂ホールディングス | 38,200 | 449.00 | 17,151,800 | 貸付株式数 16,800株 |
| レック | 11,800 | 1,060.00 | 12,508,000 | 貸付株式数 5,800株 |
| 三光合成 | 14,900 | 827.00 | 12,322,300 | |
| プロネクサス | 12,200 | 1,151.00 | 14,042,200 | 貸付株式数 4,300株 |
| TOPPANホールディングス | 142,800 | 4,705.00 | 671,874,000 | |
| 大日本印刷 | 254,100 | 2,704.50 | 687,213,450 | |
| 共同印刷 | 13,300 | 1,538.00 | 20,455,400 | 貸付株式数 5,100株 |
| N I S S H A | 22,400 | 1,221.00 | 27,350,400 | |
| Z A C R O S | 37,300 | 1,153.00 | 43,006,900 | 貸付株式数 9,600株 |
| TAKARA & COMPANY | 6,400 | 4,590.00 | 29,376,000 | |
| 前澤化成工業 | 7,600 | 2,117.00 | 16,089,200 | 貸付株式数 3,000株 |
| 未来工業 | 5,600 | 3,340.00 | 18,704,000 | 貸付株式数 2,100株 |
| アシックス | 452,900 | 3,830.00 | 1,734,607,000 | |
| ツ ツ ミ | 2,800 | 2,681.00 | 7,506,800 | |
| ジェイ エス ピー | 8,300 | 2,351.00 | 19,513,300 | 貸付株式数 3,400株 |
| ニ チ ハ | 14,800 | 3,195.00 | 47,286,000 | 貸付株式数 4,300株 |
| ローランド | 9,400 | 3,535.00 | 33,229,000 | |
| エフピコ | 22,300 | 2,643.00 | 58,938,900 | |
| 小松ウオール工業 | 8,700 | 2,632.00 | 22,898,400 | |
| ヤマハ | 199,400 | 1,076.50 | 214,654,100 | |
| 河合楽器 | 3,200 | 2,429.00 | 7,772,800 | |
| クリナップ | 13,200 | 880.00 | 11,616,000 | |
| ビジョン | 69,700 | 1,613.50 | 112,460,950 | |
| キングジム | 10,400 | 830.00 | 8,632,000 | 貸付株式数 4,000株 (200株) |
| 象印マホービン | 32,000 | 1,598.00 | 51,136,000 | 貸付株式数 12,000株 |
| リンテック | 25,500 | 4,275.00 | 109,012,500 | |
| 信越ポリマー | 25,500 | 1,945.00 | 49,597,500 | |
| イトーキ | 25,900 | 2,507.00 | 64,931,300 | |
| 任天堂 | 743,600 | 10,985.00 | 8,168,446,000 | |
| 三菱鉛筆 | 15,900 | 2,144.00 | 34,089,600 | 貸付株式数 6,100株 |
| 松風 | 10,600 | 1,836.00 | 19,461,600 | |
| タカラスタンダ - ド | 26,700 | 2,902.00 | 77,483,400 | |
| コクヨ | 244,700 | 928.10 | 227,106,070 | |
| ナカバヤシ | 12,700 | 561.00 | 7,124,700 | |

| | | | | |
|----------------|-----------|-----------|---------------|---------------|
| ニフコ | 44,200 | 4,922.00 | 217,552,400 | |
| 立川ブラインド | 6,200 | 1,954.00 | 12,114,800 | 貸付株式数 2,300株 |
| グローブライド | 11,600 | 2,108.00 | 24,452,800 | 貸付株式数 4,300株 |
| オカムラ | 35,500 | 2,279.00 | 80,904,500 | |
| バルカー | 9,900 | 3,970.00 | 39,303,000 | 貸付株式数 3,500株 |
| 伊藤忠 | 837,700 | 9,303.00 | 7,793,123,100 | |
| 丸紅 | 951,000 | 4,240.00 | 4,032,240,000 | |
| スクロール | 21,300 | 1,318.00 | 28,073,400 | |
| ヨンドシーホールディングス | 11,800 | 1,757.00 | 20,732,600 | 貸付株式数 4,600株 |
| 三陽商会 | 5,600 | 3,745.00 | 20,972,000 | |
| 長瀬産業 | 53,300 | 3,772.00 | 201,047,600 | |
| 蝶理 | 6,700 | 4,045.00 | 27,101,500 | 貸付株式数 1,300株 |
| 豊田通商 | 374,300 | 5,116.00 | 1,914,918,800 | |
| オンワードホールディングス | 68,800 | 719.00 | 49,467,200 | |
| 三共生興 | 16,200 | 687.00 | 11,129,400 | |
| 兼松 | 52,100 | 3,456.00 | 180,057,600 | |
| 美津濃 | 31,600 | 2,998.00 | 94,736,800 | |
| ルックホールディングス | 3,800 | 2,658.00 | 10,100,400 | 貸付株式数 1,400株 |
| 三井物産 | 1,791,800 | 4,471.00 | 8,011,137,800 | |
| 日本紙パルプ | 66,200 | 826.00 | 54,681,200 | |
| 東京エレクトロン | 249,300 | 30,310.00 | 7,556,283,000 | |
| カメイ | 11,600 | 2,923.00 | 33,906,800 | |
| スターゼン | 28,400 | 1,269.00 | 36,039,600 | |
| セイコーグループ | 16,400 | 7,150.00 | 117,260,000 | 貸付株式数 800株 |
| 山善 | 37,800 | 1,464.00 | 55,339,200 | 貸付株式数 16,100株 |
| 椿本興業 | 8,600 | 2,771.00 | 23,830,600 | 貸付株式数 1,300株 |
| 住友商事 | 747,000 | 5,311.00 | 3,967,317,000 | |
| BIPROGY | 39,900 | 5,511.00 | 219,888,900 | |
| 内田洋行 | 4,600 | 10,100.00 | 46,460,000 | |
| 三菱商事 | 2,484,400 | 3,628.00 | 9,013,403,200 | |
| 第一実業 | 11,500 | 2,910.00 | 33,465,000 | |
| キャノンマーケティングJPN | 29,400 | 6,794.00 | 199,743,600 | |
| 西華産業 | 17,900 | 2,318.00 | 41,492,200 | |
| 佐藤商事 | 8,600 | 2,175.00 | 18,705,000 | 貸付株式数 2,600株 |
| 東京産業 | 12,600 | 999.00 | 12,587,400 | |
| ユアサ商事 | 10,700 | 5,290.00 | 56,603,000 | |
| 神鋼商事 | 9,400 | 2,448.00 | 23,011,200 | |
| 阪和興業 | 20,500 | 6,990.00 | 143,295,000 | |

| | | | | |
|--------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| 正栄食品 | 8,300 | 4,070.00 | 33,781,000 | 貸付株式数 3,200株 (1,100株) |
| カナデン | 9,900 | 2,139.00 | 21,176,100 | |
| R Y O D E N | 9,500 | 3,475.00 | 33,012,500 | |
| ニプロ | 98,200 | 1,481.00 | 145,434,200 | |
| 岩谷産業 | 123,800 | 1,629.00 | 201,670,200 | |
| 極東貿易 | 7,000 | 1,780.00 | 12,460,000 | |
| アステナホールディングス | 23,500 | 470.00 | 11,045,000 | 貸付株式数 9,000株 |
| 三愛オブリ | 29,100 | 2,050.00 | 59,655,000 | |
| 稲畑産業 | 28,400 | 3,690.00 | 104,796,000 | |
| G S I クレオス | 7,200 | 2,347.00 | 16,898,400 | 貸付株式数 2,800株 |
| 明和産業 | 17,800 | 887.00 | 15,788,600 | |
| ゴ - ルドウイン | 69,000 | 2,754.00 | 190,026,000 | |
| ユニ・チャ - ム | 738,300 | 906.90 | 669,564,270 | |
| ワ キ タ | 20,600 | 1,863.00 | 38,377,800 | 貸付株式数 7,900株 |
| 東邦ホールディングス | 35,400 | 4,727.00 | 167,335,800 | 貸付株式数 900株 |
| サンゲツ | 31,300 | 3,115.00 | 97,499,500 | |
| ミツウロコグループ | 15,100 | 2,158.00 | 32,585,800 | 貸付株式数 5,300株 |
| シナネンホールディングス | 2,400 | 6,500.00 | 15,600,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 30,900 | 1,869.00 | 57,752,100 | |
| サンリオ | 123,700 | 4,977.00 | 615,654,900 | 貸付株式数 48,600株 |
| サンワ テクノス | 7,100 | 2,861.00 | 20,313,100 | 貸付株式数 2,700株 |
| 新光商事 | 15,000 | 1,025.00 | 15,375,000 | 貸付株式数 3,100株 |
| トーホー | 4,900 | 3,810.00 | 18,669,000 | 貸付株式数 2,000株 |
| 三信電気 | 7,200 | 3,045.00 | 21,924,000 | 貸付株式数 1,900株 |
| 東陽テクニカ | 11,500 | 1,712.00 | 19,688,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| モスフード サービス | 18,300 | 4,305.00 | 78,781,500 | 貸付株式数 2,600株 |
| 加賀電子 | 23,100 | 3,820.00 | 88,242,000 | |
| 都築電気 | 7,500 | 3,215.00 | 24,112,500 | |
| ソーダニツカ | 12,100 | 1,047.00 | 12,668,700 | 貸付株式数 4,600株 |
| 立花エレテック | 7,400 | 3,045.00 | 22,533,000 | |
| 木曽路 | 18,900 | 2,519.00 | 47,609,100 | 貸付株式数 7,200株 (200株) |
| SRSホールディングス | 20,500 | 1,214.00 | 24,887,000 | 貸付株式数 7,900株 |
| 千 趣 会 | 25,200 | 222.00 | 5,594,400 | 貸付株式数 9,900株 (400株) |
| リテールパートナーズ | 18,500 | 1,310.00 | 24,235,000 | 貸付株式数 7,100株 |
| 上新電機 | 13,600 | 2,669.00 | 36,298,400 | 貸付株式数 4,700株 |
| 日本瓦斯 | 59,600 | 3,008.00 | 179,276,800 | |
| ロイヤルホールディングス | 24,200 | 2,721.00 | 65,848,200 | 貸付株式数 9,200株 |

| | | | | |
|-----------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| チヨダ | 12,100 | 1,060.00 | 12,826,000 | |
| ライフコーポレーション | 23,900 | 2,547.00 | 60,873,300 | |
| リンガーハット | 17,200 | 2,300.00 | 39,560,000 | 貸付株式数 6,100株 |
| MrMaxHD | 10,500 | 788.00 | 8,274,000 | 貸付株式数 6,000株 |
| AOKIホールディングス | 26,700 | 1,760.00 | 46,992,000 | 貸付株式数 10,300株 |
| オークワ | 16,600 | 839.00 | 13,927,400 | 貸付株式数 6,400株 |
| コメリ | 16,800 | 3,485.00 | 58,548,000 | |
| 青山商事 | 26,600 | 2,468.00 | 65,648,800 | |
| しまむら | 29,300 | 10,990.00 | 322,007,000 | |
| 高島屋 | 180,700 | 1,638.50 | 296,076,950 | |
| 松屋 | 23,500 | 1,756.00 | 41,266,000 | |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 60,700 | 2,097.50 | 127,318,250 | |
| 近鉄百貨店 | 7,100 | 1,850.00 | 13,135,000 | 貸付株式数 2,700株 |
| 丸井グループ | 72,800 | 3,245.00 | 236,236,000 | |
| クレディセゾン | 65,300 | 4,196.00 | 273,998,800 | |
| アクシアルリテイリング | 34,000 | 1,139.00 | 38,726,000 | |
| イオン | 1,471,200 | 2,418.00 | 3,557,361,600 | |
| イズミ | 22,100 | 3,000.00 | 66,300,000 | |
| フォーバル | 4,900 | 1,196.00 | 5,860,400 | 貸付株式数 100株 |
| 平和堂 | 20,400 | 2,985.00 | 60,894,000 | 貸付株式数 8,000株 |
| フジ | 19,100 | 2,098.00 | 40,071,800 | 貸付株式数 8,000株 |
| ゼビオホールディングス | 14,800 | 1,055.00 | 15,614,000 | |
| ケースホールディングス | 84,800 | 1,591.00 | 134,916,800 | |
| PALTAC | 19,100 | 4,857.00 | 92,768,700 | |
| 三谷産業 | 21,800 | 554.00 | 12,077,200 | |
| あおぞら銀行 | 73,900 | 2,483.50 | 183,530,650 | 貸付株式数 29,700株 |
| 三菱UFJフィナンシャルG | 7,441,500 | 2,429.00 | 18,075,403,500 | |
| りそなホールディングス | 1,422,700 | 1,525.00 | 2,169,617,500 | |
| 三井住友トラストグループ | 403,900 | 4,652.00 | 1,878,942,800 | |
| 三井住友フィナンシャルG | 2,548,600 | 4,912.00 | 12,518,723,200 | |
| 千葉銀行 | 354,800 | 1,715.50 | 608,659,400 | |
| 群馬銀行 | 209,200 | 1,737.00 | 363,380,400 | |
| 武蔵野銀行 | 16,200 | 4,710.00 | 76,302,000 | |
| 千葉興業銀行 | 21,900 | 1,720.00 | 37,668,000 | 貸付株式数 8,400株 |
| 筑波銀行 | 50,900 | 403.00 | 20,512,700 | |
| 七十七銀行 | 37,100 | 7,451.00 | 276,432,100 | |
| 秋田銀行 | 7,800 | 3,875.00 | 30,225,000 | |
| 山形銀行 | 14,900 | 1,856.00 | 27,654,400 | 貸付株式数 4,900株 |
| 岩手銀行 | 7,300 | 4,955.00 | 36,171,500 | |

| | | | | |
|--------------------|-----------|----------|---------------|---------------|
| 東邦銀行 | 133,500 | 536.00 | 71,556,000 | |
| ふくおかフィナンシャルG | 92,600 | 4,984.00 | 461,518,400 | |
| スルガ銀行 | 63,000 | 1,704.00 | 107,352,000 | |
| 八十二銀行 | 239,200 | 1,649.00 | 394,440,800 | |
| 山梨中央銀行 | 14,100 | 3,930.00 | 55,413,000 | |
| 大垣共立銀行 | 24,000 | 4,570.00 | 109,680,000 | |
| 福井銀行 | 11,200 | 2,385.00 | 26,712,000 | 貸付株式数 3,800株 |
| 清水銀行 | 4,600 | 2,199.00 | 10,115,400 | |
| 滋賀銀行 | 17,500 | 7,330.00 | 128,275,000 | |
| 南都銀行 | 17,500 | 5,770.00 | 100,975,000 | |
| 百五銀行 | 109,100 | 1,102.00 | 120,228,200 | |
| 紀陽銀行 | 38,500 | 3,190.00 | 122,815,000 | |
| ほくほくフィナンシャルG | 70,700 | 4,475.00 | 316,382,500 | |
| 山陰合同銀行 | 72,600 | 1,450.00 | 105,270,000 | |
| 百十四銀行 | 11,300 | 6,370.00 | 71,981,000 | |
| 四国銀行 | 18,200 | 1,694.00 | 30,830,800 | 貸付株式数 7,000株 |
| 阿波銀行 | 17,200 | 4,250.00 | 73,100,000 | |
| 大分銀行 | 7,300 | 6,170.00 | 45,041,000 | |
| 宮崎銀行 | 6,800 | 6,070.00 | 41,276,000 | |
| 佐賀銀行 | 7,300 | 3,800.00 | 27,740,000 | 貸付株式数 2,600株 |
| 琉球銀行 | 24,700 | 1,787.00 | 44,138,900 | |
| セブン銀行 | 363,600 | 298.80 | 108,643,680 | |
| みずほフィナンシャルG | 1,645,000 | 5,600.00 | 9,212,000,000 | |
| 山口フィナンシャルG | 113,800 | 2,099.50 | 238,923,100 | |
| 芙蓉総合リース | 32,000 | 4,234.00 | 135,488,000 | |
| みずほリース | 87,200 | 1,397.00 | 121,818,400 | |
| 東京センチュリー | 86,700 | 2,024.50 | 175,524,150 | |
| SBIホールディングス | 407,400 | 3,282.00 | 1,337,086,800 | |
| 日本証券金融 | 42,600 | 1,994.00 | 84,944,400 | |
| アイフル | 192,100 | 538.00 | 103,349,800 | |
| 名古屋銀行 | 21,700 | 4,430.00 | 96,131,000 | |
| 北洋銀行 | 149,900 | 827.00 | 123,967,300 | |
| 愛媛銀行 | 16,900 | 1,393.00 | 23,541,700 | 貸付株式数 6,500株 |
| 京葉銀行 | 52,100 | 1,604.00 | 83,568,400 | |
| 栃木銀行 | 62,800 | 700.00 | 43,960,000 | 貸付株式数 24,200株 |
| 北日本銀行 | 3,700 | 4,230.00 | 15,651,000 | |
| 東和銀行 | 22,900 | 1,016.00 | 23,266,400 | |
| リコーリース | 11,000 | 5,780.00 | 63,580,000 | |
| イオンフィナンシャルサー ビス | 66,600 | 1,583.00 | 105,427,800 | |

| | | | | |
|-----------------|-----------|----------|---------------|---------------|
| アコム | 207,000 | 483.60 | 100,105,200 | |
| ジャックス | 13,900 | 4,200.00 | 58,380,000 | |
| オリコ | 45,400 | 1,051.00 | 47,715,400 | |
| オリックス | 717,100 | 4,468.00 | 3,204,002,800 | |
| 三菱HCキャピタル | 581,500 | 1,282.50 | 745,773,750 | |
| ジャフコグループ | 32,100 | 2,375.50 | 76,253,550 | 貸付株式数 1,900株 |
| トモニホールディングス | 110,800 | 757.00 | 83,875,600 | |
| 大和証券G本社 | 829,500 | 1,342.00 | 1,113,189,000 | |
| 野村ホールディングス | 1,950,800 | 1,271.00 | 2,479,466,800 | |
| 岡三証券グループ | 91,700 | 726.00 | 66,574,200 | 貸付株式数 10,000株 |
| 丸三証券 | 38,600 | 988.00 | 38,136,800 | 貸付株式数 8,300株 |
| 東洋証券 | 35,800 | 597.00 | 21,372,600 | 貸付株式数 13,800株 |
| 東海東京HD | 137,700 | 667.00 | 91,845,900 | |
| 水戸証券 | 31,800 | 542.00 | 17,235,600 | 貸付株式数 12,200株 |
| いちよし証券 | 21,700 | 1,030.00 | 22,351,000 | 貸付株式数 4,800株 |
| 松井証券 | 79,900 | 811.00 | 64,798,900 | 貸付株式数 16,000株 |
| SOMPOホールディングス | 576,100 | 5,271.00 | 3,036,623,100 | |
| 日本取引所グループ | 644,100 | 1,672.00 | 1,076,935,200 | |
| マネックスG | 122,900 | 698.00 | 85,784,200 | 貸付株式数 9,800株 |
| 極東証券 | 15,900 | 1,648.00 | 26,203,200 | 貸付株式数 6,200株 |
| 岩井コスモホールディング | 12,100 | 3,130.00 | 37,873,000 | |
| アイザワ証券グループ | 12,200 | 1,365.00 | 16,653,000 | 貸付株式数 5,300株 |
| フィデアホール | 12,000 | 1,796.00 | 21,552,000 | |
| 池田泉州HD | 160,900 | 771.00 | 124,053,900 | |
| アニコムホールディングス | 36,300 | 952.00 | 34,557,600 | |
| MS&AD | 779,300 | 3,737.00 | 2,912,244,100 | |
| ソニーフィナンシャルグループ | 4,062,900 | 161.30 | 655,345,770 | |
| スパークス・グループ | 12,800 | 1,496.00 | 19,148,800 | |
| 第一生命HLDGS | 2,281,900 | 1,295.00 | 2,955,060,500 | |
| 東京海上HD | 1,192,600 | 5,899.00 | 7,035,147,400 | |
| イー・ギャランティ | 19,000 | 1,844.00 | 35,036,000 | 貸付株式数 7,300株 |
| NECキャピタルソリューション | 5,700 | 3,960.00 | 22,572,000 | |
| T&Dホールディングス | 287,500 | 3,538.00 | 1,017,175,000 | |
| アドバンスクリエイト | 10,300 | 159.00 | 1,637,700 | 貸付株式数 4,100株 |
| 三井不動産 | 1,715,600 | 1,779.50 | 3,052,910,200 | |
| 三菱地所 | 716,200 | 3,778.00 | 2,705,803,600 | |
| 平和不動産 | 24,000 | 2,211.00 | 53,064,000 | |
| 東京建物 | 110,600 | 3,534.00 | 390,860,400 | |

| | | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|-------|----------|
| 京阪神ビルディング | 17,200 | 1,900.00 | 32,680,000 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| 住友不動産 | 164,900 | 7,864.00 | 1,296,773,600 | | |
| テーオーシー | 20,700 | 863.00 | 17,864,100 | | |
| スターツコーポレーション | 21,400 | 4,850.00 | 103,790,000 | | |
| フジ住宅 | 14,600 | 794.00 | 11,592,400 | | |
| 空港施設 | 16,300 | 1,003.00 | 16,348,900 | | |
| 明和地所 | 9,300 | 1,123.00 | 10,443,900 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ゴールドクレスト | 6,300 | 3,320.00 | 20,916,000 | | |
| リログループ | 53,900 | 1,725.00 | 92,977,500 | | |
| エスリード | 5,500 | 6,520.00 | 35,860,000 | | |
| 日神グループHLDGS | 18,600 | 738.00 | 13,726,800 | 貸付株式数 | 6,800株 |
| エスコン | 26,100 | 1,078.00 | 28,135,800 | 貸付株式数 | 8,900株 |
| MIRARTHホールディング | 74,100 | 377.00 | 27,935,700 | 貸付株式数 | 28,600株 |
| ランド | 748,700 | 9.00 | 6,738,300 | 貸付株式数 | 119,600株 |
| カチタス | 31,200 | 3,145.00 | 98,124,000 | 貸付株式数 | 7,800株 |
| 東祥 | 10,100 | 763.00 | 7,706,300 | | |
| トーセイ | 34,300 | 1,685.00 | 57,795,500 | | |
| サンフロンティア不動産 | 17,200 | 2,388.00 | 41,073,600 | | |
| グランディハウス | 10,900 | 601.00 | 6,550,900 | | |
| 東武鉄道 | 124,100 | 2,618.00 | 324,893,800 | | |
| 相鉄ホールディングス | 45,400 | 2,806.00 | 127,392,400 | | |
| 東急 | 302,700 | 1,825.50 | 552,578,850 | | |
| 京浜急行 | 133,600 | 1,524.50 | 203,673,200 | | |
| 小田急電鉄 | 178,500 | 1,707.00 | 304,699,500 | | |
| 京王電鉄 | 52,700 | 4,033.00 | 212,539,100 | | |
| 京成電鉄 | 205,000 | 1,291.50 | 264,757,500 | | |
| 富士急行 | 14,500 | 2,032.00 | 29,464,000 | 貸付株式数 | 5,600株 |
| 東日本旅客鉄道 | 649,600 | 4,100.00 | 2,663,360,000 | | |
| 西日本旅客鉄道 | 280,900 | 3,092.00 | 868,542,800 | | |
| 東海旅客鉄道 | 499,000 | 4,453.00 | 2,222,047,000 | | |
| 東京地下鉄 | 187,600 | 1,564.00 | 293,406,400 | 貸付株式数 | 97,400株 |
| 西武ホールディングス | 128,200 | 4,544.00 | 582,540,800 | | |
| 鴻池運輸 | 20,100 | 3,110.00 | 62,511,000 | | |
| 西日本鉄道 | 34,100 | 2,772.50 | 94,542,250 | | |
| ハマキョウレックス | 36,900 | 1,798.00 | 66,346,200 | | |
| サカイ引越センター | 14,900 | 2,879.00 | 42,897,100 | | |
| 近鉄グループHLDGS | 126,000 | 2,961.00 | 373,086,000 | | |
| 阪急阪神HLDGS | 155,100 | 3,955.00 | 613,420,500 | | |
| 南海電鉄 | 56,200 | 2,907.00 | 163,373,400 | | |
| 京阪ホールディングス | 61,200 | 3,335.00 | 204,102,000 | | |

| | | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|-------|---------|
| 神戸電鉄 | 3,200 | 2,453.00 | 7,849,600 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| 名古屋鉄道 | 130,000 | 1,629.50 | 211,835,000 | 貸付株式数 | 51,000株 |
| 山陽電鉄 | 8,900 | 2,084.00 | 18,547,600 | 貸付株式数 | 3,100株 |
| ヤマトホールディングス | 142,900 | 2,170.50 | 310,164,450 | | |
| 山九 | 26,900 | 8,498.00 | 228,596,200 | 貸付株式数 | 10,300株 |
| 丸全昭和運輸 | 7,300 | 7,950.00 | 58,035,000 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| センコーグループHLDGS | 85,100 | 1,922.00 | 163,562,200 | | |
| ニッコンホールディングス | 50,100 | 3,465.00 | 173,596,500 | 貸付株式数 | 25,600株 |
| 福山通運 | 12,600 | 4,275.00 | 53,865,000 | | |
| セイノーホールディングス | 57,900 | 2,362.50 | 136,788,750 | 貸付株式数 | 10,700株 |
| 神奈川中央交通 | 3,300 | 3,740.00 | 12,342,000 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| AZ-COM丸和ホールディ | 36,500 | 1,005.00 | 36,682,500 | 貸付株式数 | 9,800株 |
| 日本郵船 | 248,600 | 4,926.00 | 1,224,603,600 | | |
| 商船三井 | 223,800 | 4,523.00 | 1,012,247,400 | 貸付株式数 | 70,800株 |
| 川崎汽船 | 253,400 | 2,144.50 | 543,416,300 | | |
| NSユニテッド海運 | 7,400 | 6,020.00 | 44,548,000 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| 飯野海運 | 43,200 | 1,381.00 | 59,659,200 | | |
| 九州旅客鉄道 | 88,600 | 4,101.00 | 363,348,600 | | |
| SGホールディングス | 197,500 | 1,487.00 | 293,682,500 | | |
| NIPPON EXPRESS | 126,500 | 3,330.00 | 421,245,000 | | |
| 日本航空 | 269,600 | 2,961.50 | 798,420,400 | | |
| ANAホールディングス | 320,000 | 3,022.00 | 967,040,000 | | |
| ビーウィズ | 3,100 | 1,567.00 | 4,857,700 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| サンウェルズ | 9,300 | 341.00 | 3,171,300 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| TREホールディングス | 27,800 | 1,600.00 | 44,480,000 | 貸付株式数 | 9,800株 |
| 人・夢・技術グループ | 5,000 | 1,601.00 | 8,005,000 | | |
| シルバーライフ | 3,300 | 791.00 | 2,610,300 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| GENKY DRUGSTORES | 10,900 | 5,120.00 | 55,808,000 | | |
| コア商事HLDGS | 11,100 | 814.00 | 9,035,400 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| KPPグループホールディン | 32,600 | 776.00 | 25,297,600 | 貸付株式数 | 12,800株 |
| ブックオフGHD | 9,100 | 1,405.00 | 12,785,500 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| ギフトホールディングス | 7,100 | 3,265.00 | 23,181,500 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| 三菱倉庫 | 133,500 | 1,182.00 | 157,797,000 | | |
| 三井倉庫HOLD | 36,300 | 3,825.00 | 138,847,500 | | |
| 住友倉庫 | 34,200 | 3,510.00 | 120,042,000 | | |
| 渋沢倉庫 | 18,800 | 1,249.00 | 23,481,200 | 貸付株式数 | 7,600株 |
| ヤマタネ | 10,000 | 2,338.00 | 23,380,000 | 貸付株式数 | 3,900株 |
| 乾汽船 | 14,900 | 1,346.00 | 20,055,400 | 貸付株式数 | 5,700株 |
| 日本トランスシティ | 29,600 | 1,141.00 | 33,773,600 | 貸付株式数 | 5,500株 |

| | | | | |
|-----------------|------------|-----------|---------------|----------------|
| 中央倉庫 | 6,300 | 1,398.00 | 8,807,400 | |
| 安田倉庫 | 8,000 | 2,235.00 | 17,880,000 | 貸付株式数 2,100株 |
| N I S S O H D | 10,500 | 696.00 | 7,308,000 | 貸付株式数 4,100株 |
| 大栄環境 | 26,400 | 3,915.00 | 103,356,000 | 貸付株式数 1,900株 |
| GENOVA | 7,100 | 562.00 | 3,990,200 | 貸付株式数 1,800株 |
| 日本管財ホールディング | 12,700 | 2,763.00 | 35,090,100 | |
| 上組 | 51,600 | 5,056.00 | 260,889,600 | 貸付株式数 700株 |
| キューソー流通システム | 6,700 | 2,755.00 | 18,458,500 | 貸付株式数 600株 |
| エーアイテイナー | 7,400 | 2,111.00 | 15,621,400 | |
| TBSホールディングス | 58,400 | 5,781.00 | 337,610,400 | |
| 日本テレビHLDS | 104,600 | 3,870.00 | 404,802,000 | 貸付株式数 40,300株 |
| 朝日放送グループHD | 14,700 | 846.00 | 12,436,200 | 貸付株式数 5,600株 |
| テレビ朝日HD | 28,700 | 3,330.00 | 95,571,000 | |
| スカパーJSATHD | 78,700 | 2,062.00 | 162,279,400 | |
| テレビ東京HD | 7,300 | 4,710.00 | 34,383,000 | 貸付株式数 2,200株 |
| ビジョン | 24,700 | 1,300.00 | 32,110,000 | 貸付株式数 9,500株 |
| U-NEXT HOLDINGS | 39,700 | 1,937.00 | 76,898,900 | 貸付株式数 1,500株 |
| 日本通信 | 95,500 | 141.00 | 13,465,500 | 貸付株式数 36,800株 |
| N T T | 32,435,500 | 156.70 | 5,082,642,850 | |
| K D D I | 1,660,100 | 2,712.00 | 4,502,191,200 | |
| ソフトバンク | 18,994,100 | 216.70 | 4,116,021,470 | |
| 光通信 | 11,700 | 43,600.00 | 510,120,000 | |
| エムティーアイ | 8,000 | 721.00 | 5,768,000 | 貸付株式数 2,000株 |
| GMOインターネットグループ | 38,200 | 3,829.00 | 146,267,800 | |
| ファイバーゲート | 4,500 | 659.00 | 2,965,500 | |
| K A D O K A W A | 65,600 | 3,121.00 | 204,737,600 | |
| 学研ホールディングス | 21,600 | 1,142.00 | 24,667,200 | |
| ゼンリン | 17,700 | 1,038.00 | 18,372,600 | |
| 東京電力HD | 1,061,700 | 642.10 | 681,717,570 | 貸付株式数 255,600株 |
| 中部電力 | 434,000 | 2,341.50 | 1,016,211,000 | |
| 関西電力 | 638,400 | 2,474.00 | 1,579,401,600 | |
| 中国電力 | 204,600 | 982.10 | 200,937,660 | |
| 北陸電力 | 120,400 | 958.60 | 115,415,440 | 貸付株式数 21,900株 |
| 東北電力 | 310,100 | 1,129.00 | 350,102,900 | |
| 四国電力 | 109,700 | 1,492.50 | 163,727,250 | |
| 九州電力 | 271,500 | 1,658.50 | 450,282,750 | |
| 北海道電力 | 132,800 | 1,037.00 | 137,713,600 | 貸付株式数 50,300株 |
| 沖縄電力 | 30,100 | 1,059.00 | 31,875,900 | |
| 電源開発 | 88,700 | 3,083.00 | 273,462,100 | |

| | | | | |
|--------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| エフオン | 8,600 | 346.00 | 2,975,600 | |
| イーレックス | 24,100 | 618.00 | 14,893,800 | 貸付株式数 9,300株 |
| レノバ | 32,200 | 642.00 | 20,672,400 | 貸付株式数 12,300株 |
| 東京瓦斯 | 212,500 | 6,356.00 | 1,350,650,000 | |
| 大阪瓦斯 | 210,300 | 5,441.00 | 1,144,242,300 | |
| 東邦瓦斯 | 43,300 | 4,755.00 | 205,891,500 | |
| 北海道瓦斯 | 35,100 | 741.00 | 26,009,100 | 貸付株式数 5,000株 |
| 広島ガス | 25,000 | 368.00 | 9,200,000 | 貸付株式数 9,600株 |
| 西部ガスHLDGS | 13,500 | 1,938.00 | 26,163,000 | |
| 静岡ガス | 26,800 | 1,204.00 | 32,267,200 | 貸付株式数 10,500株 |
| メタウォーター | 15,600 | 3,250.00 | 50,700,000 | |
| M&A総研ホールディング | 14,300 | 1,102.00 | 15,758,600 | 貸付株式数 6,000株 |
| アイネット | 2,000 | 2,516.00 | 5,032,000 | |
| 松竹 | 6,800 | 11,690.00 | 79,492,000 | 貸付株式数 2,600株 |
| 東宝 | 62,000 | 8,331.00 | 516,522,000 | |
| エイチ・アイ・エス | 35,200 | 1,318.00 | 46,393,600 | 貸付株式数 14,200株 |
| 東映 | 19,500 | 5,510.00 | 107,445,000 | |
| ラックランド | 5,500 | 1,695.00 | 9,322,500 | 貸付株式数 2,100株 |
| 共立メンテナンス | 45,900 | 2,856.00 | 131,090,400 | 貸付株式数 18,000株 (4,100株) |
| イチネンホールディングス | 11,500 | 2,096.00 | 24,104,000 | |
| 建設技術研究所 | 12,500 | 3,010.00 | 37,625,000 | |
| スペース | 8,800 | 1,568.00 | 13,798,400 | |
| アインホールディングス | 12,500 | 6,524.00 | 81,550,000 | |
| 燦ホールディングス | 10,100 | 1,391.00 | 14,049,100 | |
| ピー・シー・エー | 7,800 | 1,863.00 | 14,531,400 | |
| スバル興業 | 4,100 | 3,110.00 | 12,751,000 | 貸付株式数 1,500株 |
| タナベコンサルティンググ ル | 10,100 | 715.00 | 7,221,500 | 貸付株式数 3,000株 |
| ビジネスB太田昭和 | 4,200 | 3,590.00 | 15,078,000 | |
| ナガワ | 3,200 | 6,090.00 | 19,488,000 | 貸付株式数 1,200株 |
| 東京都競馬 | 8,900 | 5,840.00 | 51,976,000 | 貸付株式数 3,400株 |
| カナモト | 17,100 | 3,865.00 | 66,091,500 | |
| D T S | 93,900 | 1,228.00 | 115,309,200 | |
| スクウェア・エニックス・ HD | 194,300 | 2,873.00 | 558,223,900 | |
| シーイーシー | 14,300 | 2,397.00 | 34,277,100 | |
| カプコン | 234,800 | 3,519.00 | 826,261,200 | |
| ニシオホールディングス | 10,000 | 4,490.00 | 44,900,000 | |
| アイ・エス・ビー | 5,600 | 1,705.00 | 9,548,000 | 貸付株式数 1,200株 |

| | | | | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 日本空港ビルデング | 41,000 | 4,389.00 | 179,949,000 | |
| トランス・コスモス | 15,500 | 3,810.00 | 59,055,000 | 貸付株式数 1,300株 |
| 乃村工藝社 | 52,800 | 1,292.00 | 68,217,600 | |
| S C S K | 93,200 | 5,657.00 | 527,232,400 | |
| 藤田観光 | 4,800 | 12,410.00 | 59,568,000 | 貸付株式数 2,000株 |
| KNT-CTホールディングス | 6,000 | 1,584.00 | 9,504,000 | 貸付株式数 2,300株 |
| トーカイ | 9,500 | 2,490.00 | 23,655,000 | |
| セコム | 226,100 | 5,667.00 | 1,281,308,700 | |
| N S W | 5,300 | 2,493.00 | 13,212,900 | |
| セントラル警備保障 | 5,900 | 2,990.00 | 17,641,000 | 貸付株式数 2,300株 |
| アイネス | 9,200 | 1,952.00 | 17,958,400 | |
| 丹青社 | 25,600 | 1,556.00 | 39,833,600 | |
| メイテックグループホール デ | 44,700 | 3,536.00 | 158,059,200 | |
| T K C | 18,400 | 4,145.00 | 76,268,000 | |
| 応用地質 | 11,000 | 2,728.00 | 30,008,000 | |
| 船井総研ホールディン | 24,200 | 2,297.00 | 55,587,400 | |
| N S D | 41,700 | 3,505.00 | 146,158,500 | |
| コナミグループ | 50,600 | 21,780.00 | 1,102,068,000 | |
| 学 究 社 | 4,800 | 2,377.00 | 11,409,600 | 貸付株式数 1,800株 |
| ナック | 12,300 | 522.00 | 6,420,600 | 貸付株式数 4,500株 |
| 福井コンピュータHLDS | 6,400 | 3,085.00 | 19,744,000 | 貸付株式数 3,000株 |
| ダイセキ | 23,300 | 3,410.00 | 79,453,000 | |
| ステップ | 4,400 | 2,391.00 | 10,520,400 | |
| 泉州電業 | 7,900 | 5,390.00 | 42,581,000 | |
| GENKI GLOBAL DIN | 7,000 | 3,085.00 | 21,595,000 | 貸付株式数 2,700株 |
| トラスコ中山 | 26,200 | 2,397.00 | 62,801,400 | |
| ヤマダホールディングス | 383,300 | 497.20 | 190,576,760 | |
| オートバックスセブン | 43,400 | 1,643.00 | 71,306,200 | |
| モリト | 9,900 | 1,658.00 | 16,414,200 | |
| アーケランズ | 37,100 | 1,922.00 | 71,306,200 | 貸付株式数 14,300株 |
| ニトリホールディングス | 201,600 | 2,888.00 | 582,220,800 | |
| グルメ杵屋 | 10,100 | 953.00 | 9,625,300 | 貸付株式数 3,700株 |
| ケーユーホールディングス | 8,700 | 1,218.00 | 10,596,600 | |
| 吉野家ホールディングス | 45,900 | 3,068.00 | 140,821,200 | 貸付株式数 18,000株 (4,400株) |
| 加藤産業 | 15,400 | 6,540.00 | 100,716,000 | |
| イノテック | 7,800 | 2,010.00 | 15,678,000 | |
| イエローハット | 31,400 | 1,659.00 | 52,092,600 | |
| 松屋フーズHLDGS | 5,900 | 6,350.00 | 37,465,000 | 貸付株式数 2,300株 |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|-----------------|--------------------------|
| JBCCホールディングス | 31,300 | 1,639.00 | 51,300,700 | |
| JKホールディングス | 8,200 | 1,261.00 | 10,340,200 | |
| サガミホールディングス | 20,000 | 1,884.00 | 37,680,000 | 貸付株式数 7,600株 |
| 日伝 | 6,900 | 2,503.00 | 17,270,700 | 貸付株式数 2,700株 |
| ミロク情報サービス | 10,000 | 1,882.00 | 18,820,000 | 貸付株式数 3,700株 |
| 杉本商事 | 10,000 | 1,370.00 | 13,700,000 | 貸付株式数 4,200株 |
| 因幡電機産業 | 65,100 | 2,485.00 | 161,773,500 | |
| 王将フードサービス | 25,700 | 3,230.00 | 83,011,000 | 貸付株式数 9,900株 |
| ミニストップ | 9,100 | 2,100.00 | 19,110,000 | 貸付株式数 3,500株 (1,200株) |
| アークス | 21,000 | 3,440.00 | 72,240,000 | |
| パローホールディングス | 23,800 | 3,435.00 | 81,753,000 | |
| 東テク | 13,900 | 3,615.00 | 50,248,500 | |
| ミスミグループ本社 | 175,800 | 2,448.50 | 430,446,300 | |
| ベルク | 5,500 | 7,480.00 | 41,140,000 | |
| 大庄 | 8,400 | 1,159.00 | 9,735,600 | 貸付株式数 3,200株 (300株) |
| ファーストリテイリング | 84,100 | 56,390.00 | 4,742,399,000 | |
| ソフトバンクグループ | 566,100 | 16,125.00 | 9,128,362,500 | |
| スズケン | 41,300 | 6,200.00 | 256,060,000 | |
| サンドラッグ | 36,800 | 4,322.00 | 159,049,600 | |
| サクスペーパーホールディング | 10,500 | 746.00 | 7,833,000 | 貸付株式数 4,500株 |
| ジェコス | 8,900 | 1,413.00 | 12,575,700 | |
| ベルーナ | 30,000 | 988.00 | 29,640,000 | |
| 合計 | | | 561,088,476,920 | |

(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12月18日現在 金額（円） | 2025年12月18日現在 金額（円） |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,666,500,509 | 2,793,512,730 |
| コール・ローン | 16,316,826,115 | 22,551,019,792 |
| 株式 | 656,595,315,530 | 836,211,564,442 |
| 投資証券 | 12,506,235,965 | 13,666,321,110 |
| 派生商品評価勘定 | 336,584,772 | 96,273,805 |
| 未収入金 | 4,596,994 | 5,734,980 |
| 未収配当金 | 523,072,149 | 636,323,607 |
| 差入委託証拠金 | 9,094,372,389 | 14,076,445,624 |
| 流動資産合計 | 697,043,504,423 | 890,037,196,090 |
| 資産合計 | 697,043,504,423 | 890,037,196,090 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 91,801,958 | 471,286,031 |
| 未払解約金 | 345,686,100 | 975,579,000 |
| 流動負債合計 | 437,488,058 | 1,446,865,031 |
| 負債合計 | 437,488,058 | 1,446,865,031 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 97,471,314,337 | 106,454,857,152 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 599,134,702,028 | 782,135,473,907 |
| 元本等合計 | 696,606,016,365 | 888,590,331,059 |
| 純資産合計 | 696,606,016,365 | 888,590,331,059 |
| 負債純資産合計 | 697,043,504,423 | 890,037,196,090 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> |

| | |
|----------------------------|---|
| | <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|----------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 2023年12月19日 | 2024年12月19日 |
| 期首元本額 | 79,048,744,098円 | 97,471,314,337円 |
| 期中追加設定元本額 | 26,368,558,518円 | 20,270,253,876円 |
| 期中一部解約元本額 | 7,945,988,279円 | 11,286,711,061円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ外国株式インデックスV | 216,835,107円 | 182,974,748円 |
| A | | |
| ダイワ国内重視バランスファン | 1,350,771円 | 932,937円 |
| ド30VA(一般投資家私募) | | |
| ダイワ国内重視バランスファン | 15,640,386円 | 10,541,563円 |
| ド50VA(一般投資家私募) | | |
| ダイワ国際分散バランスファン | 3,401,571円 | 2,494,612円 |
| ド30VA(一般投資家私募) | | |

| | | |
|---|-----------------|-----------------|
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 85,662,411円 | 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) | 114,845,246円 | 129,546,343円 |
| ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用) | 77,052,001円 | -円 |
| 外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 8,670,747,397円 | 10,013,254,143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) | 763,141,440円 | 813,719,731円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) | 6,049,980,216円 | 7,917,157,677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) | 570,811,387円 | 606,592,478円 |
| D-I's 外国株式インデックス | 15,964,093円 | 15,387,205円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2050 | 45,602,828円 | 44,912,318円 |
| iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) | 9,804,220,171円 | 11,890,719,277円 |
| iFree 8資産バランス | 1,523,216,776円 | 1,651,161,722円 |
| iFree 年金バランス | 347,680,301円 | 374,685,403円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2060 | 18,710,984円 | 31,611,079円 |
| DCダイワ外国株式インデックス | 51,367,234,653円 | 50,786,746,140円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30 | 433,707,038円 | 396,086,901円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50 | 1,018,865,470円 | 1,028,521,487円 |
| ダイワ・ライフ・バランス70 | 997,600,353円 | 1,026,479,439円 |
| 大和DC海外株式インデックスファンド | 1,098,357,050円 | 986,445,757円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030 | 9,588,199円 | 7,992,598円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040 | 11,192,828円 | 12,502,210円 |
| ダイワつみたてインデックス外国株式 | 2,863,091,211円 | 3,443,295,255円 |

| | | |
|---|--------------|----------------|
| ダイワつみたてインデックスバ ランス30 | 1,774,665円 | 1,743,294円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス50 | 2,615,264円 | 3,116,189円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス70 | 13,195,933円 | 49,244,389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) | 16,128,054円 | 1,214,413,934円 |
| ダイワ世界バランスファンド4 0VA | 40,010,033円 | 33,216,199円 |
| ダイワ世界バランスファンド6 0VA | 28,225,334円 | 23,760,596円 |
| ダイワ・バランスファンド35 VA | 629,488,881円 | 491,938,959円 |
| ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用) | 33,701,276円 | 26,206,283円 |
| ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用) | 122,278,441円 | 100,431,384円 |
| スタイル9(4資産分散・保守 型) | 330,995円 | 637,673円 |
| スタイル9(4資産分散・ balan ス型) | 2,357,489円 | 4,529,983円 |
| スタイル9(4資産分散・積極 型) | 3,464,255円 | 7,373,476円 |
| スタイル9(6資産分散・保守 型) | 136,863円 | 252,497円 |
| スタイル9(6資産分散・ balan ス型) | 4,334,111円 | 8,230,509円 |
| スタイル9(6資産分散・積極 型) | 5,039,343円 | 10,075,144円 |
| スタイル9(8資産分散・保守 型) | 192,325円 | 347,811円 |
| スタイル9(8資産分散・ balan ス型) | 3,078,619円 | 6,629,482円 |
| スタイル9(8資産分散・積極 型) | 9,781,176円 | 19,239,582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 | 1,542,801,634円 |
| i F r e e 全世界株式インデッ クス(オール・カントリー) | -円 | 19,608,763円 |

| | | |
|--|-----------------|------------------|
| ダイワ・インデックスセレクト 外国株式 | 1,191,855,722円 | 1,014,633,367円 |
| ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド | 426,013,289円 | 395,621,599円 |
| ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワS MA専用） | 5,254,796,860円 | 6,466,386,278円 |
| ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス | 3,267,571,895円 | 3,398,570,201円 |
| ダイワライフスタイル2 5 | 6,633,135円 | 5,421,479円 |
| ダイワライフスタイル5 0 | 31,382,448円 | 27,229,906円 |
| ダイワライフスタイル7 5 | 27,178,582円 | 25,211,840円 |
| ダイワバランスファンド2023-08 （適格機関投資家専用） | 76,831,150円 | -円 |
| ダイワバランスファンド2024-01 （適格機関投資家専用） | 74,807,979円 | 61,223,038円 |
| ダイワバランスファンド2024-05 （適格機関投資家専用） | 73,610,332円 | 60,582,419円 |
| 計 | 97,471,314,337円 | 106,454,857,152円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 97,471,314,337口 | 106,454,857,152口 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p> |

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

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 2,626,177,855 | 11,732,341,308 |
| 投資証券 | 738,328,149 | 372,280,593 |
| 合計 | 1,887,849,706 | 12,104,621,901 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|--------------|----------------|-----------|----------------|-------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | (円) | うち 1年超 | | | (円) | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 株価指数 先物取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 27,573,598,772 | - | 27,491,378,576 | 82,220,196 | 39,903,437,739 | - | 39,438,075,533 | 465,362,206 |
| 合計 | 27,573,598,772 | - | 27,491,378,576 | 82,220,196 | 39,903,437,739 | - | 39,438,075,533 | 465,362,206 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|----------------|----------------|-----------|----------------|-------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | (円) | うち 1年超 | | | (円) | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の 取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 15,762,598,220 | - | 16,089,601,230 | 327,003,010 | 22,200,120,930 | - | 22,290,470,910 | 90,349,980 |
| アメリカ・ドル | 9,734,075,170 | - | 9,978,085,320 | 244,010,150 | 14,751,534,320 | - | 14,766,814,170 | 15,279,850 |
| イギリス・ ポンド | 1,175,821,140 | - | 1,207,703,580 | 31,882,440 | 1,171,879,970 | - | 1,183,605,000 | 11,725,030 |
| オーストラリ ア・ドル | 659,684,120 | - | 659,957,680 | 273,560 | 742,307,500 | - | 748,298,910 | 5,991,410 |

| | | | | | | | | |
|---------|----------------|---|----------------|-------------|----------------|---|----------------|------------|
| カナダ・ドル | 1,716,631,230 | - | 1,725,598,000 | 8,966,770 | 2,138,022,160 | - | 2,164,800,000 | 26,777,840 |
| スイス・フラン | 1,308,759,250 | - | 1,326,447,430 | 17,688,180 | 1,281,153,570 | - | 1,291,664,220 | 10,510,650 |
| ユーロ | 1,167,627,310 | - | 1,191,809,220 | 24,181,910 | 2,115,223,410 | - | 2,135,288,610 | 20,065,200 |
| 合計 | 15,762,598,220 | - | 16,089,601,230 | 327,003,010 | 22,200,120,930 | - | 22,290,470,910 | 90,349,980 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 7.1468円 | 8.3471円 |
| (1万口当たり純資産額) | (71,468円) | (83,471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 SOLUTIONS INC | 8,400 | 228.770 | 1,921,668.000 | |
| | PALO ALTO NETWORKS INC | 48,500 | 183.440 | 8,896,840.000 | |
| | FIRST SOLAR INC | 7,300 | 254.030 | 1,854,419.000 | |
| | KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 12,300 | 198.530 | 2,441,919.000 | |
| | | | | | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP C | 8,800 | 86.550 | 761,640.000 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 26,600 | 83.230 | 2,213,918.000 | |
| ABBOTT LABORATORIES | 124,566 | 126.710 | 15,783,757.860 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 27,383 | 191.190 | 5,235,355.770 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 10,020 | 219.170 | 2,196,083.400 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 22,000 | 66.490 | 1,462,780.000 | |
| AMPHENOL CORP CLASS A | 87,500 | 126.510 | 11,069,625.000 | |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 3,440 | 912.250 | 3,138,140.000 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERV | 37,400 | 66.300 | 2,479,620.000 | |
| AFLAC INC | 36,300 | 110.500 | 4,011,150.000 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 8,300 | 189.530 | 1,573,099.000 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | 11,600 | 136.410 | 1,582,356.000 | |
| ADOBE INC | 29,960 | 354.660 | 10,625,613.600 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 11,600 | 79.010 | 916,516.000 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 7,700 | 207.870 | 1,600,599.000 | |
| GARMIN LTD | 11,700 | 201.470 | 2,357,199.000 | |
| AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | 15,940 | 246.380 | 3,927,297.200 | |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 45,400 | 199.890 | 9,075,006.000 | |
| WR BERKLEY CORP | 21,713 | 69.110 | 1,500,585.430 | |
| AUTOZONE INC | 1,200 | 3,393.350 | 4,072,020.000 | |
| DOLLAR TREE INC | 13,971 | 128.350 | 1,793,177.850 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES ADR | 85,100 | 30.060 | 2,558,106.000 | |
| D R HORTON INC | 19,216 | 152.000 | 2,920,832.000 | |
| AUTODESK INC | 15,260 | 292.970 | 4,470,722.200 | |
| MOODYS CORP | 11,580 | 499.020 | 5,778,651.600 | |
| DEVON ENERGY CORP | 43,200 | 36.950 | 1,596,240.000 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 11,500 | 169.170 | 1,945,455.000 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 18,400 | 65.480 | 1,204,832.000 | |
| CITIGROUP INC | 131,773 | 111.460 | 14,687,418.580 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | 29,020 | 265.470 | 7,703,939.400 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER INC | 38,300 | 114.710 | 4,393,393.000 | |
| DOMINOS PIZZA INC | 2,290 | 438.420 | 1,003,981.800 | |
| DANAHER CORP | 46,150 | 222.630 | 10,274,374.500 | |
| FORTIVE CORP | 24,000 | 55.240 | 1,325,760.000 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 41,000 | 160.860 | 6,595,260.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|-----------|-----------|-----------------|--|
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 34,400 | 58.560 | 2,014,464.000 | |
| APPLE INC | 1,062,400 | 271.840 | 288,802,816.000 | |
| BOEING | 54,200 | 206.330 | 11,183,086.000 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 11,215 | 167.110 | 1,874,138.650 | |
| BECTON DICKINSON | 20,499 | 195.360 | 4,004,684.640 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 8,700 | 181.360 | 1,577,832.000 | |
| NISOURCE INC | 33,700 | 41.250 | 1,390,125.000 | |
| CH ROBINSON WORLDWIDE INC | 8,500 | 160.100 | 1,360,850.000 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 50,471 | 113.560 | 5,731,486.760 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 301,904 | 40.880 | 12,341,835.520 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B | 98,770 | 504.270 | 49,806,747.900 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 92,417 | 50.150 | 4,634,712.550 | |
| BLACKSTONE INC | 52,800 | 153.190 | 8,088,432.000 | |
| BRISTOL MYERS SQUIBB | 145,800 | 53.550 | 7,807,590.000 | |
| JPMORGAN CHASE | 196,830 | 314.980 | 61,997,513.400 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 15,600 | 103.900 | 1,620,840.000 | |
| BROWN FORMAN CORP CLASS B | 12,912 | 28.840 | 372,382.080 | |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | 19,540 | 313.020 | 6,116,410.800 | |
| AMERIPRISE FINANCE INC | 6,760 | 487.500 | 3,295,500.000 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 15,800 | 136.970 | 2,164,126.000 | |
| SERVICENOW INC | 14,900 | 782.390 | 11,657,611.000 | |
| CATERPILLAR INC | 33,560 | 561.890 | 18,857,028.400 | |
| BROWN & BROWN INC | 20,700 | 80.620 | 1,668,834.000 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 19,900 | 39.010 | 776,299.000 | |
| CMS ENERGY CORP | 21,400 | 70.260 | 1,503,564.000 | |
| DELTA AIR LINES INC | 11,600 | 69.720 | 808,752.000 | |
| CORNING INC | 58,300 | 85.420 | 4,979,986.000 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 283,050 | 76.000 | 21,511,800.000 | |
| MORGAN STANLEY | 85,652 | 174.800 | 14,971,969.600 | |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 10,600 | 102.390 | 1,085,334.000 | |
| MSCI INC | 5,540 | 560.970 | 3,107,773.800 | |
| FAIR ISAAC CORP | 1,710 | 1,755.020 | 3,001,084.200 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,260 | 487.470 | 1,101,682.200 | |
| SS AND C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 15,700 | 86.760 | 1,362,132.000 | |
| BROADCOM INC | 321,300 | 326.020 | 104,750,226.000 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 3,060 | 510.940 | 1,563,476.400 | |
| CNH INDUSTRIAL N.V. NV | 61,700 | 9.580 | 591,086.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|--------|---------|----------------|--|
| DICKS SPORTING INC | 4,800 | 207.960 | 998,208.000 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 9,400 | 392.100 | 3,685,740.000 | |
| DTE ENERGY | 14,900 | 128.890 | 1,920,461.000 | |
| CENTENE CORP | 35,107 | 38.870 | 1,364,609.090 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 7,500 | 252.260 | 1,891,950.000 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 30,900 | 58.610 | 1,811,049.000 | |
| ARTHUR J GALLAGHER | 18,380 | 250.900 | 4,611,542.000 | |
| GARTNER INC | 5,450 | 251.290 | 1,369,530.500 | |
| DOMINION ENERGY INC | 61,141 | 60.110 | 3,675,185.510 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 52,400 | 74.335 | 3,895,154.000 | |
| DEERE | 18,400 | 481.000 | 8,850,400.000 | |
| QUANTA SERVICES INC | 10,700 | 414.250 | 4,432,475.000 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 17,284 | 82.220 | 1,421,090.480 | |
| BURLINGTON STORES INC | 4,500 | 268.180 | 1,206,810.000 | |
| NASDAQ INC | 32,900 | 93.710 | 3,083,059.000 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 15,400 | 182.370 | 2,808,498.000 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 4,800 | 137.970 | 662,256.000 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 25,800 | 100.210 | 2,585,418.000 | |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 5,500 | 194.100 | 1,067,550.000 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC | 5,180 | 269.130 | 1,394,093.400 | |
| VEEVA SYSTEMS INC CLASS A | 11,160 | 215.460 | 2,404,533.600 | |
| CARLISLE COMPANIES INC | 3,020 | 330.390 | 997,777.800 | |
| IDEX CORP | 5,400 | 176.330 | 952,182.000 | |
| COLGATE-PALMOLIVE | 55,000 | 79.730 | 4,385,150.000 | |
| ROLLINS INC | 20,607 | 60.240 | 1,241,365.680 | |
| AECOM | 9,400 | 96.690 | 908,886.000 | |
| WATSCO INC | 2,460 | 346.230 | 851,725.800 | |
| GRACO INC | 11,900 | 83.160 | 989,604.000 | |
| AMETEK INC | 16,500 | 199.900 | 3,298,350.000 | |
| CHURCH AND DWIGHT INC | 17,400 | 86.520 | 1,505,448.000 | |
| HEICO CORP | 3,200 | 306.890 | 982,048.000 | |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV CLASS | 18,200 | 43.760 | 796,432.000 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 3,060 | 451.260 | 1,380,855.600 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 31,720 | 862.650 | 27,363,258.000 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 9,100 | 108.120 | 983,892.000 | |
| RELIANCE INC | 3,800 | 297.710 | 1,131,298.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 96,000 | 37.000 | 3,552,000.000 | |
| COMFORT SYSTEMS USA INC | 2,600 | 883.790 | 2,297,854.000 | |
| CUMMINS INC | 9,880 | 497.440 | 4,914,707.200 | |
| CDW CORP | 9,400 | 143.690 | 1,350,686.000 | |
| COSTAR GROUP INC | 30,300 | 64.830 | 1,964,349.000 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE INC | 13,500 | 155.730 | 2,102,355.000 | |
| INTERACTIVE BROKERS GROUP INC CLAS | 31,900 | 62.450 | 1,992,155.000 | |
| MERCADOLIBRE INC | 3,260 | 1,916.280 | 6,247,072.800 | |
| JACK HENRY AND ASSOCIATES INC | 5,200 | 188.090 | 978,068.000 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 16,816 | 293.000 | 4,927,088.000 | |
| DEXCOM INC | 28,100 | 65.750 | 1,847,575.000 | |
| NORDSON CORP | 3,790 | 238.070 | 902,285.300 | |
| COPART INC | 65,800 | 39.110 | 2,573,438.000 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 13,500 | 154.070 | 2,079,945.000 | |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 5,740 | 355.720 | 2,041,832.800 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,020 | 1,261.640 | 5,071,792.800 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 7,100 | 141.700 | 1,006,070.000 | |
| KINDER MORGAN INC | 143,181 | 26.650 | 3,815,773.650 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 11,680 | 471.850 | 5,511,208.000 | |
| COTERRA ENERGY INC | 54,600 | 25.920 | 1,415,232.000 | |
| T MOBILE US INC | 36,227 | 199.380 | 7,222,939.260 | |
| ZILLOW GROUP INC CLASS C | 12,050 | 68.770 | 828,678.500 | |
| EMCOR GROUP INC | 3,200 | 596.470 | 1,908,704.000 | |
| COCA-COLA | 292,850 | 70.670 | 20,695,709.500 | |
| COCA COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | 15,400 | 92.170 | 1,419,418.000 | |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHIN | 9,650 | 149.750 | 1,445,087.500 | |
| CSX CORP | 133,500 | 36.500 | 4,872,750.000 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 8,525 | 282.820 | 2,411,040.500 | |
| AMAZON COM INC | 687,400 | 221.270 | 152,100,998.000 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 42,000 | 84.840 | 3,563,280.000 | |
| EXXON MOBIL CORP | 305,209 | 117.410 | 35,834,588.690 | |
| EVEREST GROUP LTD | 3,000 | 328.630 | 985,890.000 | |
| EOG RESOURCES INC | 39,100 | 104.740 | 4,095,334.000 | |
| EQT CORP | 44,800 | 54.360 | 2,435,328.000 | |
| FIRST CITIZENS BANCSHARES INC CLAS | 640 | 2,111.590 | 1,351,417.600 | |

| | | | | |
|----------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| CENCORA INC | 13,200 | 342.960 | 4,527,072.000 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 20,300 | 136.660 | 2,774,198.000 | |
| FORD MOTOR | 279,923 | 13.310 | 3,725,775.130 | |
| ENTEGRIS INC | 10,900 | 85.030 | 926,827.000 | |
| STRATEGY INC CLASS A | 18,700 | 160.380 | 2,999,106.000 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 13,100 | 140.950 | 1,846,445.000 | |
| FORTINET INC | 46,600 | 79.380 | 3,699,108.000 | |
| MARKEL GROUP INC | 910 | 2,151.090 | 1,957,491.900 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 147,480 | 80.290 | 11,841,169.200 | |
| FREEPORT MCMORAN INC | 102,808 | 47.820 | 4,916,278.560 | |
| INSULET CORP | 5,040 | 289.570 | 1,459,432.800 | |
| US BANCORP | 111,400 | 53.740 | 5,986,636.000 | |
| UNITED RENTALS INC | 4,600 | 792.540 | 3,645,684.000 | |
| F5 INC | 4,100 | 256.070 | 1,049,887.000 | |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | 38,400 | 29.840 | 1,145,856.000 | |
| FASTENAL | 82,200 | 41.870 | 3,441,714.000 | |
| FISERV INC | 39,133 | 68.330 | 2,673,957.890 | |
| GE AEROSPACE | 75,906 | 292.180 | 22,178,215.080 | |
| AXON ENTERPRISE INC | 5,340 | 550.000 | 2,937,000.000 | |
| INSMED INC | 15,700 | 198.460 | 3,115,822.000 | |
| GENERAL MOTORS | 68,100 | 80.510 | 5,482,731.000 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 16,380 | 336.410 | 5,510,395.800 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 21,690 | 872.330 | 18,920,837.700 | |
| ALPHABET INC CLASS A | 416,500 | 296.720 | 123,583,880.000 | |
| ALPHABET INC CLASS C | 349,940 | 298.060 | 104,303,116.400 | |
| GENERAL MILLS INC | 38,300 | 48.610 | 1,861,763.000 | |
| FIRSTENERGY CORP | 39,318 | 44.500 | 1,749,651.000 | |
| GENUINE PARTS | 10,050 | 128.060 | 1,287,003.000 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 47,100 | 47.750 | 2,249,025.000 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 13,410 | 278.720 | 3,737,635.200 | |
| HALLIBURTON | 60,700 | 27.740 | 1,683,818.000 | |
| HOME DEPOT INC | 71,290 | 356.750 | 25,432,707.500 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 112,800 | 17.750 | 2,002,200.000 | |
| HERSHEY FOODS | 10,600 | 188.940 | 2,002,764.000 | |
| HUMANA INC | 8,600 | 260.280 | 2,238,408.000 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 18,000 | 223.230 | 4,018,140.000 | |
| HP INC | 66,900 | 24.430 | 1,634,367.000 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 94,500 | 24.020 | 2,269,890.000 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 26,700 | 95.890 | 2,560,263.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| KRAFT HEINZ | 63,603 | 24.750 | 1,574,174.250 | |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CO | 66,720 | 303.320 | 20,237,510.400 | |
| HUBBELL INC | 3,800 | 429.680 | 1,632,784.000 | |
| INTERNATIONAL PAPER | 35,900 | 38.690 | 1,388,971.000 | |
| ZOETIS INC CLASS A | 31,700 | 122.250 | 3,875,325.000 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 15,919 | 382.300 | 6,085,833.700 | |
| CHENIERE ENERGY INC | 15,700 | 190.350 | 2,988,495.000 | |
| HYATT HOTELS CORP CLASS A | 3,000 | 164.280 | 492,840.000 | |
| ALLEGION PLC | 6,050 | 160.710 | 972,295.500 | |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 7,900 | 103.510 | 817,729.000 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 18,437 | 176.000 | 3,244,912.000 | |
| JM SMUCKER | 7,600 | 100.390 | 762,964.000 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 172,500 | 210.330 | 36,281,925.000 | |
| NEBIUS NV CLASS A | 15,700 | 75.450 | 1,184,565.000 | |
| ABBVIE INC | 126,472 | 224.310 | 28,368,934.320 | |
| HOLOGIC INC | 15,800 | 74.930 | 1,183,894.000 | |
| KIMBERLY CLARK CORP | 23,800 | 102.940 | 2,449,972.000 | |
| KROGER | 45,100 | 63.810 | 2,877,831.000 | |
| KLA CORP | 9,440 | 1,172.020 | 11,063,868.800 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 15,060 | 474.790 | 7,150,337.400 | |
| CORPAY INC | 4,800 | 308.580 | 1,481,184.000 | |
| LOWES COMPANIES INC | 40,160 | 247.960 | 9,958,073.600 | |
| ELI LILLY | 57,605 | 1,041.790 | 60,012,312.950 | |
| LAM RESEARCH CORP | 90,200 | 154.980 | 13,979,196.000 | |
| LOEWS CORP | 12,600 | 106.040 | 1,336,104.000 | |
| MCDONALDS CORP | 51,090 | 318.690 | 16,281,872.100 | |
| 3M | 38,090 | 162.170 | 6,177,055.300 | |
| META PLATFORMS INC CLASS A | 155,360 | 649.500 | 100,906,320.000 | |
| S&P GLOBAL INC | 22,359 | 510.590 | 11,416,281.810 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 4,340 | 619.010 | 2,686,503.400 | |
| PHILLIPS | 28,900 | 131.990 | 3,814,511.000 | |
| ATLISSIAN CORP CLASS A | 11,900 | 161.980 | 1,927,562.000 | |
| MCCORMICK & CO NON-VOTING INC | 18,100 | 68.650 | 1,242,565.000 | |
| METLIFE INC | 40,500 | 82.530 | 3,342,465.000 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 61,700 | 81.700 | 5,040,890.000 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 76,500 | 122.360 | 9,360,540.000 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 11,918 | 374.490 | 4,463,171.820 | |
| METTLER TOLEDO INC | 1,470 | 1,384.680 | 2,035,479.600 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| BAKER HUGHES CLASS A | 70,623 | 45.290 | 3,198,515.670 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 8,040 | 389.540 | 3,131,901.600 | |
| MERCK & CO INC | 178,821 | 99.180 | 17,735,466.780 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 29,951 | 40.600 | 1,216,010.600 | |
| MASCO CORP | 14,900 | 65.110 | 970,139.000 | |
| M&T BANK CORP | 11,199 | 206.120 | 2,308,337.880 | |
| MARSH & MCLENNAN INC | 35,170 | 186.360 | 6,554,281.200 | |
| HEICO CORP CLASS A | 5,420 | 240.290 | 1,302,371.800 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC CLASS A | 16,502 | 310.070 | 5,116,775.140 | |
| WORKDAY INC CLASS A | 15,500 | 216.000 | 3,348,000.000 | |
| BLOCK INC CLASS A | 39,212 | 63.770 | 2,500,549.240 | |
| TRANSUNION | 13,800 | 84.750 | 1,169,550.000 | |
| VISTRA CORP | 24,300 | 159.970 | 3,887,271.000 | |
| NETAPP INC | 14,300 | 110.960 | 1,586,728.000 | |
| NIKE INC CLASS B | 85,200 | 65.690 | 5,596,788.000 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 16,100 | 294.430 | 4,740,323.000 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 38,600 | 63.990 | 2,470,014.000 | |
| RAYMOND JAMES INC | 13,605 | 161.010 | 2,190,541.050 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 9,740 | 564.190 | 5,495,210.600 | |
| NEWMONT | 78,711 | 99.450 | 7,827,808.950 | |
| MCKESSON CORP | 8,940 | 806.520 | 7,210,288.800 | |
| XYLEM INC | 17,400 | 136.880 | 2,381,712.000 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | 111,500 | 158.610 | 17,685,015.000 | |
| NUCOR CORP | 16,400 | 160.690 | 2,635,316.000 | |
| SPOTIFY TECHNOLOGY SA | 11,600 | 566.230 | 6,568,268.000 | |
| GODADDY INC CLASS A | 9,900 | 125.600 | 1,243,440.000 | |
| EVERGY INC | 16,550 | 73.590 | 1,217,914.500 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 52,924 | 40.630 | 2,150,302.120 | |
| ERIE INDEMNITY CLASS A | 1,850 | 288.810 | 534,298.500 | |
| OKTA INC CLASS A | 12,100 | 88.420 | 1,069,882.000 | |
| WIX.COM LTD | 4,110 | 104.040 | 427,604.400 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 21,300 | 48.160 | 1,025,808.000 | |
| KKR AND CO INC | 44,700 | 132.150 | 5,907,105.000 | |
| PAYCHEX INC | 23,200 | 116.700 | 2,707,440.000 | |
| O REILLY AUTOMOTIVE INC | 60,700 | 92.850 | 5,635,995.000 | |
| ALTRIA GROUP INC | 120,300 | 59.180 | 7,119,354.000 | |
| PG&E CORP | 157,400 | 15.680 | 2,468,032.000 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| PFIZER INC | 407,113 | 25.040 | 10,194,109.520 | |
| CIGNA | 19,140 | 273.840 | 5,241,297.600 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC CLASS C | 23,201 | 127.890 | 2,967,175.890 | |
| XCEL ENERGY INC | 42,400 | 73.140 | 3,101,136.000 | |
| STERIS | 7,100 | 251.670 | 1,786,857.000 | |
| SEA ADS REPRESENTING LTD CLASS A | 28,400 | 118.950 | 3,378,180.000 | |
| FOX CORP CLASS B | 11,033 | 63.120 | 696,402.960 | |
| FOX CORP CLASS A | 15,099 | 71.170 | 1,074,595.830 | |
| STRYKER CORP | 24,640 | 352.580 | 8,687,571.200 | |
| DOW INC | 50,818 | 23.070 | 1,172,371.260 | |
| TRADEWEB MARKETS INC CLASS A | 8,300 | 104.650 | 868,595.000 | |
| ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A | 18,200 | 88.750 | 1,615,250.000 | |
| PARKER-HANNIFIN CORP | 9,020 | 863.190 | 7,785,973.800 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 141,800 | 79.140 | 11,222,052.000 | |
| PROCTER & GAMBLE | 167,567 | 147.810 | 24,768,078.270 | |
| EXELON CORP | 72,322 | 44.220 | 3,198,078.840 | |
| INGERSOLL RAND INC | 28,508 | 78.120 | 2,227,044.960 | |
| NVR INC | 190 | 7,472.550 | 1,419,784.500 | |
| CONOCOPHILLIPS | 89,403 | 94.960 | 8,489,708.880 | |
| TWILIO INC CLASS A | 11,000 | 139.220 | 1,531,420.000 | |
| DOCUSIGN INC | 14,300 | 67.790 | 969,397.000 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 3,600 | 166.970 | 601,092.000 | |
| PURE STORAGE INC CLASS A | 22,400 | 66.320 | 1,485,568.000 | |
| PEPSICO INC | 97,900 | 150.080 | 14,692,832.000 | |
| CYBER ARK SOFTWARE LTD | 3,760 | 443.110 | 1,666,093.600 | |
| MONGODB INC CLASS A | 5,840 | 412.350 | 2,408,124.000 | |
| SNAP INC CLASS A | 77,100 | 7.500 | 578,250.000 | |
| CORTEVA INC | 48,568 | 66.430 | 3,226,372.240 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 25,200 | 115.680 | 2,915,136.000 | |
| AMCOR PLC | 165,300 | 8.370 | 1,383,561.000 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC CLASS A | 17,960 | 470.020 | 8,441,559.200 | |
| AMERICAN WATER WORKS INC | 14,000 | 134.010 | 1,876,140.000 | |
| ACCENTURE PLC CLASS A | 44,400 | 273.740 | 12,154,056.000 | |
| PENTAIR PLC | 11,675 | 103.660 | 1,210,230.500 | |
| QUALCOMM INC | 76,800 | 172.340 | 13,235,712.000 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC | 15,900 | 89.370 | 1,420,983.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| DATADOG INC CLASS A | 22,000 | 136.710 | 3,007,620.000 | |
| PINTEREST INC CLASS A | 43,000 | 25.880 | 1,112,840.000 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS INC | 7,420 | 749.790 | 5,563,441.800 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 15,600 | 214.730 | 3,349,788.000 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 2,320 | 5,340.980 | 12,391,073.600 | |
| ROSS STORES INC | 23,300 | 182.740 | 4,257,842.000 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 6,430 | 202.330 | 1,300,981.900 | |
| RESMED INC | 10,400 | 245.940 | 2,557,776.000 | |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 8,030 | 179.100 | 1,438,173.000 | |
| HUBSPOT INC | 3,620 | 387.580 | 1,403,039.600 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 54,787 | 52.400 | 2,870,838.800 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 28,138 | 89.000 | 2,504,282.000 | |
| CARLYLE GROUP INC | 16,600 | 58.020 | 963,132.000 | |
| DYNATRACE INC | 21,600 | 43.910 | 948,456.000 | |
| TRADE DESK INC CLASS A | 31,900 | 37.170 | 1,185,723.000 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 63,485 | 27.570 | 1,750,281.450 | |
| ROYALTY PHARMA PLC CLASS A | 29,500 | 38.310 | 1,130,145.000 | |
| CHEVRON CORP | 138,018 | 149.520 | 20,636,451.360 | |
| ZSCALER INC | 7,360 | 226.430 | 1,666,524.800 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 27,600 | 59.540 | 1,643,304.000 | |
| TESLA INC | 202,190 | 467.260 | 94,475,299.400 | |
| BLOOM ENERGY CLASS A CORP | 16,500 | 76.970 | 1,270,005.000 | |
| SNOWFLAKE INC | 23,100 | 216.290 | 4,996,299.000 | |
| GEN DIGITAL INC | 37,200 | 27.895 | 1,037,694.000 | |
| SYNOPSIS INC | 13,299 | 453.070 | 6,025,377.930 | |
| CARVANA CLASS A | 9,400 | 446.230 | 4,194,562.000 | |
| CLOUDFLARE INC CLASS A | 22,400 | 191.430 | 4,288,032.000 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC CLASS A | 6,305 | 209.660 | 1,321,906.300 | |
| DOORDASH INC CLASS A | 27,430 | 221.300 | 6,070,259.000 | |
| ROBLOX CORP CLASS A | 41,700 | 85.910 | 3,582,447.000 | |
| AIRBNB INC CLASS A | 30,700 | 133.780 | 4,107,046.000 | |
| CBRE GROUP INC CLASS A | 21,300 | 160.010 | 3,408,213.000 | |
| SOUTHERN | 78,800 | 87.030 | 6,857,964.000 | |
| SYSCO CORP | 34,200 | 75.750 | 2,590,650.000 | |
| TRAVELERS COMPANIES INC | 16,123 | 291.270 | 4,696,146.210 | |
| FUTU HOLDINGS ADR LTD | 4,200 | 160.330 | 673,386.000 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 10,050 | 172.740 | 1,736,037.000 | |
| SLB NV | 106,852 | 38.530 | 4,117,007.560 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| AFFIRM HOLDINGS INC CLASS A | 19,400 | 72.040 | 1,397,576.000 | |
| AT&T INC | 511,891 | 24.360 | 12,469,664.760 | |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 29,300 | 53.330 | 1,562,569.000 | |
| SHERWIN WILLIAMS | 16,960 | 327.950 | 5,562,032.000 | |
| SEMPRA | 46,700 | 86.780 | 4,052,626.000 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC CLASS B | 11,400 | 40.080 | 456,912.000 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A | 163,000 | 177.290 | 28,898,270.000 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC | 15,250 | 277.650 | 4,234,162.500 | |
| COINBASE GLOBAL INC CLASS A | 14,680 | 244.190 | 3,584,709.200 | |
| TEXAS INSTRUMENT INC | 65,100 | 174.490 | 11,359,299.000 | |
| SALESFORCE INC | 68,166 | 258.140 | 17,596,371.240 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 31,309 | 146.400 | 4,583,637.600 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 46,834 | 116.380 | 5,450,540.920 | |
| TERADYNE INC | 11,400 | 185.210 | 2,111,394.000 | |
| UNION PACIFIC CORP | 42,480 | 236.740 | 10,056,715.200 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 21,788 | 174.500 | 3,802,006.000 | |
| RTX CORP | 95,879 | 177.200 | 16,989,758.800 | |
| UNITED PARCEL SERVICE INC CLASS B | 52,700 | 100.960 | 5,320,592.000 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 12,204 | 221.430 | 2,702,331.720 | |
| AMEREN CORP | 19,300 | 98.530 | 1,901,629.000 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 64,826 | 331.630 | 21,498,246.380 | |
| APPROVIN CORP CLASS A | 16,540 | 657.130 | 10,868,930.200 | |
| TOAST INC CLASS A | 32,900 | 35.500 | 1,167,950.000 | |
| VERISIGN INC | 6,000 | 243.120 | 1,458,720.000 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A | 56,300 | 17.630 | 992,569.000 | |
| ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A | 52,700 | 115.800 | 6,102,660.000 | |
| VALERO ENERGY CORP | 22,242 | 162.910 | 3,623,444.220 | |
| SOFI TECHNOLOGIES INC | 85,900 | 25.270 | 2,170,693.000 | |
| ULTA BEAUTY INC | 3,200 | 585.980 | 1,875,136.000 | |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC | 18,488 | 55.900 | 1,033,479.200 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC CLAS | 4,030 | 224.900 | 906,347.000 | |
| ELEVANCE HEALTH INC | 16,120 | 345.960 | 5,576,875.200 | |
| WALT DISNEY | 128,662 | 110.630 | 14,233,877.060 | |
| WELLS FARGO | 229,322 | 92.590 | 21,232,923.980 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|-----------|---------|-----------------|--|
| WASTE MANAGEMENT INC | 28,800 | 219.770 | 6,329,376.000 | |
| WILLIAMS INC | 87,400 | 58.840 | 5,142,616.000 | |
| TRACTOR SUPPLY | 37,900 | 53.490 | 2,027,271.000 | |
| WALMART INC | 314,000 | 115.660 | 36,317,240.000 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 14,200 | 91.560 | 1,300,152.000 | |
| GRAB HOLDINGS LTD CLASS A | 176,000 | 4.870 | 857,120.000 | |
| WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIE | 12,211 | 212.080 | 2,589,708.880 | |
| TJX INC | 79,700 | 155.660 | 12,406,102.000 | |
| WATERS CORP | 4,280 | 377.120 | 1,614,073.600 | |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 5,700 | 110.270 | 628,539.000 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CLASS A | 3,600 | 254.270 | 915,372.000 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 6,943 | 329.840 | 2,290,079.120 | |
| WILLIAMS SONOMA INC | 8,700 | 185.690 | 1,615,503.000 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 24,800 | 166.260 | 4,123,248.000 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 23,100 | 104.760 | 2,419,956.000 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP IN | 35,700 | 79.910 | 2,852,787.000 | |
| VISA INC CLASS A | 121,590 | 344.410 | 41,876,811.900 | |
| PPL CORP | 53,000 | 34.340 | 1,820,020.000 | |
| CONSTELLATION ENERGY CORP | 22,364 | 340.970 | 7,625,453.080 | |
| PULTEGROUP INC | 14,150 | 122.800 | 1,737,620.000 | |
| WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES | 168,353 | 28.210 | 4,749,238.130 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 16,100 | 103.720 | 1,669,892.000 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 13,800 | 137.780 | 1,901,364.000 | |
| NVIDIA CORP | 1,739,700 | 170.940 | 297,384,318.000 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 28,213 | 210.300 | 5,933,193.900 | |
| DRAFTKINGS INC CLASS A | 32,000 | 34.050 | 1,089,600.000 | |
| TYSON FOODS INC CLASS A | 20,500 | 58.500 | 1,199,250.000 | |
| NETFLIX INC | 304,710 | 94.790 | 28,883,460.900 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 27,060 | 562.560 | 15,222,873.600 | |
| NRG ENERGY INC | 13,750 | 149.480 | 2,055,350.000 | |
| TEXTRON INC | 12,800 | 87.440 | 1,119,232.000 | |
| NEWS CORP CLASS A | 26,887 | 26.030 | 699,868.610 | |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1,410 | 883.000 | 1,245,030.000 | |
| OMNICOM GROUP INC | 23,100 | 82.700 | 1,910,370.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| JACOBS SOLUTIONS INC | 8,620 | 132.380 | 1,141,115.600 | |
| ORACLE CORP | 122,533 | 178.460 | 21,867,239.180 | |
| MASTERCARD INC CLASS A | 61,060 | 565.470 | 34,527,598.200 | |
| ONEOK INC | 45,100 | 73.050 | 3,294,555.000 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 7,720 | 452.240 | 3,491,292.800 | |
| ARES MANAGEMENT CORP CLASS A | 15,500 | 168.510 | 2,611,905.000 | |
| EXPAND ENERGY CORP | 17,100 | 109.540 | 1,873,134.000 | |
| F&G ANNUITIES AND LIFE INC | 1,109 | 32.830 | 36,408.470 | |
| YUM BRANDS INC | 19,900 | 153.140 | 3,047,486.000 | |
| TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 13,200 | 240.550 | 3,175,260.000 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 503,601 | 54.550 | 27,471,434.550 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 3,360 | 502.820 | 1,689,475.200 | |
| AMERICAN EXPRESS | 39,840 | 375.610 | 14,964,302.400 | |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 32,735 | 82.380 | 2,696,709.300 | |
| LINDE PLC | 33,566 | 422.340 | 14,176,264.440 | |
| ANALOG DEVICES INC | 35,191 | 271.040 | 9,538,168.640 | |
| MONDAYCOM LTD | 3,200 | 144.670 | 462,944.000 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 116,227 | 198.110 | 23,025,730.970 | |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC | 20,500 | 30.520 | 625,660.000 | |
| NATERA INC | 9,300 | 225.490 | 2,097,057.000 | |
| LIBERTY MEDIA FORMULA ONE SERIES C | 15,200 | 96.890 | 1,472,728.000 | |
| KENVUE INC | 137,400 | 17.280 | 2,374,272.000 | |
| VERALTO CORP | 17,816 | 100.050 | 1,782,490.800 | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC | 39,572 | 86.140 | 3,408,732.080 | |
| BUNGE GLOBAL SA | 9,900 | 92.910 | 919,809.000 | |
| VERTIV HOLDINGS CLASS A | 26,000 | 149.830 | 3,895,580.000 | |
| NUTANIX INC CLASS A | 18,300 | 50.200 | 918,660.000 | |
| ROYAL CARIBBEAN GROUP LTD | 18,500 | 284.880 | 5,270,280.000 | |
| AVERY DENNISON CORP | 5,630 | 183.860 | 1,035,131.800 | |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS COR | 35,000 | 83.630 | 2,927,050.000 | |
| EMERSON ELECTRIC | 40,300 | 131.640 | 5,305,092.000 | |
| AON PLC | 14,700 | 352.030 | 5,174,841.000 | |
| AMGEN INC | 38,560 | 326.010 | 12,570,945.600 | |
| SAMSARA INC CLASS A | 25,100 | 38.230 | 959,573.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| TAPESTRY INC | 15,000 | 122.190 | 1,832,850.000 | |
| EATON PLC | 27,876 | 315.820 | 8,803,798.320 | |
| COOPER INC | 14,100 | 82.480 | 1,162,968.000 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC CLASS A | 10,600 | 139.720 | 1,481,032.000 | |
| APPLIED MATERIAL INC | 57,000 | 248.270 | 14,151,390.000 | |
| CME GROUP INC CLASS A | 25,820 | 273.740 | 7,067,966.800 | |
| ECOLAB INC | 18,280 | 261.890 | 4,787,349.200 | |
| EQUIFAX INC | 8,880 | 218.140 | 1,937,083.200 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 88,800 | 121.360 | 10,776,768.000 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 92,400 | 28.050 | 2,591,820.000 | |
| HORMEL FOODS CORP | 21,700 | 23.990 | 520,583.000 | |
| STATE STREET CORP | 20,313 | 127.360 | 2,587,063.680 | |
| ECHOSTAR CORP CLASS A | 10,400 | 100.890 | 1,049,256.000 | |
| SOLVENTUM CORP | 11,072 | 79.950 | 885,206.400 | |
| GE VERNOVA INC | 19,486 | 614.190 | 11,968,106.340 | |
| CHARLES SCHWAB CORP | 123,540 | 96.610 | 11,935,199.400 | |
| CRH PUBLIC LIMITED PLC | 48,200 | 123.050 | 5,931,010.000 | |
| LABCORP HOLDINGS INC | 6,000 | 255.810 | 1,534,860.000 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 36,200 | 19.290 | 698,298.000 | |
| SMURFIT WESTROCK PLC | 37,400 | 38.020 | 1,421,948.000 | |
| FERGUSON ENTERPRISES INC | 14,000 | 225.000 | 3,150,000.000 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 11,900 | 217.720 | 2,590,868.000 | |
| REDDIT INC CLASS A | 7,200 | 227.340 | 1,636,848.000 | |
| TE CONNECTIVITY PLC | 21,195 | 222.730 | 4,720,762.350 | |
| BLACKROCK INC | 10,540 | 1,065.000 | 11,225,100.000 | |
| ASTERA LABS INC | 9,900 | 140.240 | 1,388,376.000 | |
| ROCKET COMPANIES INC CLASS A | 65,705 | 18.160 | 1,193,202.800 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 17,000 | 198.440 | 3,373,480.000 | |
| APTIV PLC | 15,600 | 76.750 | 1,197,300.000 | |
| FEDEX CORP | 16,000 | 282.210 | 4,515,360.000 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 45,774 | 239.500 | 10,962,873.000 | |
| FLEX LTD | 27,800 | 62.850 | 1,747,230.000 | |
| ROCKET LAB CORP | 31,500 | 53.960 | 1,699,740.000 | |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | 18,413 | 65.620 | 1,208,261.060 | |
| CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD | 11,600 | 134.130 | 1,555,908.000 | |
| INTEL CORPORATION CORP | 324,000 | 36.050 | 11,680,200.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| COREWEAVE INC CLASS A | 12,800 | 64.550 | 826,240.000 | |
| QNITY ELECTRONICS INC | 14,975 | 76.260 | 1,141,993.500 | |
| OKLO INC CLASS A | 8,200 | 75.940 | 622,708.000 | |
| IONQ INC | 21,900 | 45.850 | 1,004,115.000 | |
| AMRIZE AG | 36,900 | 53.540 | 1,975,626.000 | |
| HARTFORD INSURANCE GROUP INC | 20,150 | 138.360 | 2,787,954.000 | |
| ILLINOIS TOOL INC | 19,860 | 252.400 | 5,012,664.000 | |
| ILLUMINA INC | 11,000 | 129.560 | 1,425,160.000 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 25,700 | 556.860 | 14,311,302.000 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 6,450 | 187.340 | 1,208,343.000 | |
| SNAP ON INC | 3,740 | 346.050 | 1,294,227.000 | |
| CIENA CORP | 10,500 | 203.900 | 2,140,950.000 | |
| DUKE ENERGY CORP | 55,728 | 117.430 | 6,544,139.040 | |
| TARGET CORP | 32,500 | 98.600 | 3,204,500.000 | |
| DOVER CORP | 9,800 | 196.150 | 1,922,270.000 | |
| VW GRAINGER INC | 3,220 | 1,020.050 | 3,284,561.000 | |
| JABIL INC | 7,700 | 216.300 | 1,665,510.000 | |
| CINTAS CORP | 25,900 | 187.370 | 4,852,883.000 | |
| CLOROX | 8,600 | 101.520 | 873,072.000 | |
| ENTERGY CORP | 32,000 | 91.830 | 2,938,560.000 | |
| MICROSOFT CORP | 505,660 | 476.120 | 240,754,839.200 | |
| INCYTE CORP | 11,900 | 97.630 | 1,161,797.000 | |
| CVS HEALTH CORP | 90,769 | 77.880 | 7,069,089.720 | |
| MEDTRONIC PLC | 91,898 | 98.300 | 9,033,573.400 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 80,400 | 225.520 | 18,131,808.000 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 46,700 | 38.310 | 1,789,077.000 | |
| KEYCORP | 66,700 | 20.800 | 1,387,360.000 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC CLASS A | 92,711 | 53.820 | 4,989,706.020 | |
| CHUBB LTD | 27,139 | 312.960 | 8,493,421.440 | |
| ALLSTATE CORP | 18,900 | 209.080 | 3,951,612.000 | |
| EBAY INC | 32,600 | 82.710 | 2,696,346.000 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 65,050 | 60.180 | 3,914,709.000 | |
| ESTEE LAUDER INC CLASS A | 16,800 | 105.300 | 1,769,040.000 | |
| TRIMBLE INC | 16,900 | 78.890 | 1,333,241.000 | |
| LENNAR A CORP CLASS A | 16,100 | 112.230 | 1,806,903.000 | |
| PROGRESSIVE CORP | 42,000 | 227.270 | 9,545,340.000 | |
| PACCAR INC | 37,555 | 111.630 | 4,192,264.650 | |

| | | | | | |
|------------|-------------------------------|-----------|---------|--|--|
| | BIOGEN INC | 10,500 | 172.100 | 1,807,050.000 | |
| | IDEXX LABORATORIES INC | 5,740 | 695.600 | 3,992,744.000 | |
| | STARBUCKS CORP | 81,400 | 85.210 | 6,936,094.000 | |
| | PTC INC | 8,600 | 175.310 | 1,507,666.000 | |
| | EVERSOURCE ENERGY | 26,600 | 67.280 | 1,789,648.000 | |
| | INTUIT INC | 19,960 | 660.780 | 13,189,168.800 | |
| | BEST BUY INC | 14,250 | 71.450 | 1,018,162.500 | |
| | BALL CORP | 18,604 | 52.070 | 968,710.280 | |
| | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 106,097 | 94.480 | 10,024,044.560 | |
| | ELECTRONIC ARTS INC | 17,000 | 203.630 | 3,461,710.000 | |
| | VULCAN MATERIALS | 9,400 | 285.410 | 2,682,854.000 | |
| | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 18,360 | 449.520 | 8,253,187.200 | |
| | CARNIVAL CORP | 75,200 | 28.030 | 2,107,856.000 | |
| | COMCAST CORP CLASS A | 263,590 | 30.320 | 7,992,048.800 | |
| | JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 11,900 | 68.010 | 809,319.000 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 79,800 | 7.030 | 560,994.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | | 4,139,076,705.940 (644,081,726,212) | |
| イギリス・ポンド | SHELL PLC | 402,861 | 26.575 | 10,706,031.070 | |
| | HALEON PLC | 617,607 | 3.693 | 2,280,822.650 | |
| | WISE PLC CLASS A | 46,438 | 8.840 | 410,511.920 | |
| | MAGNUM ICE CREAM COMPANY NPV | 34,146 | 11.965 | 408,556.890 | |
| | BP PLC | 1,094,922 | 4.255 | 4,659,440.570 | |
| | UNILEVER PLC | 151,763 | 48.815 | 7,408,310.840 | |
| | BARCLAYS PLC | 971,758 | 4.581 | 4,452,109.270 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 585,870 | 11.020 | 6,456,287.400 | |
| | MARKS AND SPENCER GROUP PLC | 141,556 | 3.278 | 464,020.560 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 178,394 | 11.200 | 1,998,012.800 | |
| | NATWEST GROUP PLC | 559,164 | 6.378 | 3,566,347.990 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 209,192 | 16.810 | 3,516,517.520 | |
| | AVIVA PLC | 212,860 | 6.680 | 1,421,904.800 | |
| | GLAXOSMITHKLINE | 282,935 | 18.335 | 5,187,613.220 | |
| | INFORMA PLC | 89,236 | 8.682 | 774,746.950 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 86,323 | 5.506 | 475,294.430 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 59,528 | 6.132 | 365,025.690 | |
| | DCC PLC | 6,761 | 49.240 | 332,911.640 | |
| | SPIRAX GROUP PLC | 5,007 | 66.550 | 333,215.850 | |
| | HALMA PLC | 26,434 | 35.020 | 925,718.680 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
| ENTAIN PLC | 41,144 | 7.482 | 307,839.400 | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 172,738 | 0.846 | 146,205.440 | |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 47,535 | 7.190 | 341,776.650 | |
| M&G PLC | 159,248 | 2.782 | 443,027.930 | |
| ENDEAVOUR MINING | 14,343 | 37.160 | 532,985.880 | |
| RELX PLC | 127,037 | 30.430 | 3,865,735.910 | |
| DIAGEO PLC | 155,023 | 16.795 | 2,603,611.280 | |
| RIO TINTO PLC | 78,592 | 57.530 | 4,521,397.760 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 135,683 | 17.630 | 2,392,091.290 | |
| TESCO PLC | 450,719 | 4.389 | 1,978,205.690 | |
| FRESNILLO PLC | 15,329 | 29.520 | 452,512.080 | |
| SMITH AND NEPHEW PLC | 56,010 | 12.230 | 685,002.300 | |
| GLENCORE PLC | 699,723 | 3.789 | 2,651,600.300 | |
| SMITHS GROUP PLC | 22,378 | 23.320 | 521,854.960 | |
| PEARSON PLC | 40,375 | 10.490 | 423,533.750 | |
| SAINSBURY(J) PLC | 116,988 | 3.238 | 378,807.140 | |
| NEXT PLC | 8,027 | 134.200 | 1,077,223.400 | |
| WHITBREAD PLC | 11,775 | 24.450 | 287,898.750 | |
| BUNZL | 22,170 | 21.760 | 482,419.200 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 1,336,897 | 0.956 | 1,278,875.670 | |
| KINGFISHER PLC | 118,387 | 3.105 | 367,591.630 | |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 47,528 | 12.030 | 571,761.840 | |
| SEVERN TRENT PLC | 18,885 | 27.690 | 522,925.650 | |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 173,687 | 4.327 | 751,543.640 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 46,989 | 60.000 | 2,819,340.000 | |
| SCHRODERS PLC | 50,139 | 3.920 | 196,544.880 | |
| SSE PLC | 77,150 | 21.560 | 1,663,354.000 | |
| BARRATT REDROW PLC | 92,981 | 3.750 | 348,678.750 | |
| ASTRAZENECA PLC | 107,972 | 135.540 | 14,634,524.880 | |
| LEGAL AND GENERAL GROUP PLC | 397,269 | 2.533 | 1,006,282.370 | |
| 3I GROUP PLC | 69,256 | 32.130 | 2,225,195.280 | |
| ASHTAD GROUP PLC | 29,268 | 52.920 | 1,548,862.560 | |
| THE SAGE GROUP PLC | 66,433 | 10.860 | 721,462.380 | |
| NATIONAL GRID PLC | 345,729 | 11.445 | 3,956,868.400 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,117,646 | 0.959 | 3,950,469.570 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 53,266 | 31.810 | 1,694,391.460 | |
| CENTRICA PLC | 333,159 | 1.661 | 553,543.670 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO | 152,653 | 42.820 | 6,536,601.460 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 22,010 | 21.190 | 466,391.900 | |

| | | | | | |
|----------------|---------------------------------------|-----------|-----------|-------------------------------------|--|
| | HSBC HOLDINGS PLC | 1,198,375 | 11.418 | 13,683,045.750 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 77,924 | 28.900 | 2,252,003.600 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 118,188 | 23.650 | 2,795,146.200 | |
| | BT GROUP PLC | 411,207 | 1.851 | 761,144.150 | |
| | COCA COLA HBC AG | 15,200 | 37.800 | 574,560.000 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 10,046 | 105.050 | 1,055,332.300 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 10,850 | 45.660 | 495,411.000 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 32,494 | 87.740 | 2,851,023.560 | |
| | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 11,467 | 15.140 | 173,610.380 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 17,902 | 31.260 | 559,616.520 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 27,488 | 30.880 | 848,829.440 | |
| | EXPERIAN PLC | 63,881 | 33.720 | 2,154,067.320 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | | 154,256,130.060 (32,102,243,227) | |
| イスラエル・ シュケル | ISRAEL DISCOUNT BANK LTD | 91,112 | 35.980 | 3,278,209.760 | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 3,098 | 323.500 | 1,002,203.000 | |
| | PHOENIX FINANCIAL LTD | 17,039 | 145.000 | 2,470,655.000 | |
| | NOVA LTD | 2,194 | 1,024.200 | 2,247,094.800 | |
| | ICL GROUP LTD | 56,522 | 15.800 | 893,047.600 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2,072 | 1,767.200 | 3,661,638.400 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 93,148 | 75.350 | 7,018,701.800 | |
| | BANK LEUMI LE ISRAEL | 110,915 | 72.570 | 8,049,101.550 | |
| | NICE LTD | 4,617 | 352.800 | 1,628,877.600 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 11,617 | 237.100 | 2,754,390.700 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | | | 33,003,920.210 (1,584,640,324) | |
| オーストラリ ア・ドル | THE LOTTERY CORPORATION LTD | 149,524 | 5.170 | 773,039.080 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 266,528 | 4.810 | 1,281,999.680 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 199,977 | 36.100 | 7,219,169.700 | |
| | SGH LTD | 13,549 | 46.270 | 626,912.230 | |
| | WASHINGTON H SOUL PATTINSON & COMP | 23,633 | 35.170 | 831,172.610 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 185,018 | 4.780 | 884,386.040 | |
| | BHP GROUP LTD | 340,459 | 44.410 | 15,119,784.190 | |
| | SOUTH32 LTD | 302,191 | 3.410 | 1,030,471.310 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 127,447 | 23.420 | 2,984,808.740 | |

| | | | | | |
|--------|---------------------------------------|---------|---------|-------------------------------------|--|
| | FORTESCUE LTD | 113,511 | 22.450 | 2,548,321.950 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 205,315 | 42.020 | 8,627,336.300 | |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION CORP | 229,255 | 38.450 | 8,814,854.750 | |
| | SANTOS LTD | 215,611 | 6.040 | 1,302,290.440 | |
| | RIO TINTO LTD | 24,883 | 141.400 | 3,518,456.200 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 114,371 | 11.330 | 1,295,823.430 | |
| | XERO LTD | 11,097 | 110.260 | 1,223,555.220 | |
| | PRO MEDICUS LTD | 3,817 | 219.600 | 838,213.200 | |
| | COLES GROUP LTD | 89,969 | 21.610 | 1,944,230.090 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 13,328 | 67.000 | 892,976.000 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 91,119 | 27.120 | 2,471,147.280 | |
| | EVOLUTION MINING LTD | 136,411 | 12.660 | 1,726,963.260 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 112,173 | 153.860 | 17,258,937.780 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 100,261 | 19.590 | 1,964,112.990 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 81,883 | 29.190 | 2,390,164.770 | |
| | QANTAS AIRWAYS LTD | 49,383 | 10.100 | 498,768.300 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD DEF | 24,271 | 199.520 | 4,842,549.920 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 37,261 | 56.830 | 2,117,542.630 | |
| | CSL LTD | 32,526 | 173.390 | 5,639,683.140 | |
| | WESFARMERS LTD | 76,064 | 80.360 | 6,112,503.040 | |
| | COCHLEAR LTD | 4,346 | 258.790 | 1,124,701.340 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 71,893 | 17.480 | 1,256,689.640 | |
| | ASX LTD | 13,057 | 52.150 | 680,922.550 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 34,929 | 33.900 | 1,184,093.100 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 157,027 | 7.860 | 1,234,232.220 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 31,257 | 22.520 | 703,907.640 | |
| | BRAMBLES LTD | 90,721 | 22.860 | 2,073,882.060 | |
| | LYNAS RARE EARTHS LTD | 67,050 | 12.400 | 831,420.000 | |
| | CAR GROUP LTD | 25,090 | 30.290 | 759,976.100 | |
| | SIGMA HEALTHCARE LTD | 352,482 | 2.940 | 1,036,297.080 | |
| | REA GROUP LTD | 3,510 | 183.450 | 643,909.500 | |
| | オーストラリア・ドル 小計 | | | 118,310,205.500 (12,152,824,310) | |
| カナダ・ドル | ALIMENTATION COUCHE TARD INC | 49,100 | 72.490 | 3,559,259.000 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING | 26,881 | 71.280 | 1,916,077.680 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V | 8,900 | 51.280 | 456,392.000 | |
| CELESTICA INC | 7,600 | 380.070 | 2,888,532.000 | |
| BOMBARDIER INC CLASS B | 5,700 | 220.090 | 1,254,513.000 | |
| ATKINSREALIS GROUP INC | 10,700 | 85.140 | 910,998.000 | |
| IMPERIAL OIL LTD | 11,400 | 117.200 | 1,336,080.000 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,300 | 3,315.000 | 4,309,500.000 | |
| RESTAURANTS BRANDS INTERNATIONAL I | 20,387 | 96.740 | 1,972,238.380 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 29,900 | 158.490 | 4,738,851.000 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 11,650 | 281.490 | 3,279,358.500 | |
| BCE INC | 4,830 | 31.920 | 154,173.600 | |
| FRANCO NEVADA CORP | 12,700 | 287.220 | 3,647,694.000 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 79,530 | 58.980 | 4,690,679.400 | |
| METRO INC | 13,500 | 99.530 | 1,343,655.000 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 25,700 | 172.320 | 4,428,624.000 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 81,500 | 98.510 | 8,028,565.000 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 61,200 | 126.230 | 7,725,276.000 | |
| TORONTO DOMINION | 111,800 | 125.780 | 14,062,204.000 | |
| GREAT WEST LIFECO INC | 18,100 | 66.570 | 1,204,917.000 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 92,550 | 227.860 | 21,088,443.000 | |
| TOURMALINE OIL CORP | 24,200 | 60.470 | 1,463,374.000 | |
| TC ENERGY CORP | 68,550 | 74.460 | 5,104,233.000 | |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 38,029 | 51.470 | 1,957,352.630 | |
| BARRICK MINING CORP | 112,100 | 60.000 | 6,726,000.000 | |
| CAE INC | 20,100 | 39.440 | 792,744.000 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 10,341 | 182.110 | 1,883,199.510 | |
| EMPIRE LTD CLASS A | 8,100 | 47.510 | 384,831.000 | |
| CCL INDUSTRIES INC CLASS B | 9,550 | 85.720 | 818,626.000 | |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 26,100 | 35.780 | 933,858.000 | |
| HYDRO ONE LTD | 21,800 | 53.220 | 1,160,196.000 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 39,340 | 61.760 | 2,429,638.400 | |
| STANTEC INC | 7,400 | 126.910 | 939,134.000 | |
| WSP GLOBAL INC | 8,600 | 243.670 | 2,095,562.000 | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 5,400 | 158.470 | 855,738.000 | |
| EMERA INC | 19,500 | 66.870 | 1,303,965.000 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 5,200 | 145.580 | 757,016.000 | |

| | | | | |
|--|---------|-----------|----------------|--|
| CANADIAN UTILITIES LTD CLASS A | 8,800 | 42.620 | 375,056.000 | |
| WHITECAP RESOURCES INC | 79,700 | 11.300 | 900,610.000 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS NON- VOTING I | 23,900 | 51.300 | 1,226,070.000 | |
| IVANHOE MINES LTD CLASS A | 51,800 | 13.460 | 697,228.000 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 33,117 | 230.980 | 7,649,364.660 | |
| ALAMOS GOLD INC CLASS A | 27,700 | 51.880 | 1,437,076.000 | |
| KINROSS GOLD CORP | 79,700 | 38.550 | 3,072,435.000 | |
| BANK OF MONTREAL | 47,000 | 177.030 | 8,320,410.000 | |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 36,500 | 72.110 | 2,632,015.000 | |
| LUNDIN GOLD INC | 7,100 | 113.340 | 804,714.000 | |
| SHOPIFY SUBORDINATE VOTING INC CLA | 80,500 | 223.020 | 17,953,110.000 | |
| NUTRIEN LTD | 31,919 | 87.240 | 2,784,613.560 | |
| CAMECO CORP | 28,700 | 117.030 | 3,358,761.000 | |
| FIRSTSERVICE SUBORDINATE VOTING CO | 2,700 | 212.050 | 572,535.000 | |
| GFL ENVIRONMENTAL SUBORDINATE VOTI | 16,000 | 60.830 | 973,280.000 | |
| TELUS CORP | 10,800 | 17.440 | 188,352.000 | |
| TECK RESOURCES SUBORDINATE VOTING | 30,000 | 61.000 | 1,830,000.000 | |
| CANADIAN TIRE LTD CLASS A | 3,400 | 170.140 | 578,476.000 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 137,500 | 43.950 | 6,043,125.000 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS SUB VOT | 1,400 | 2,485.830 | 3,480,162.000 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 17,700 | 73.820 | 1,306,614.000 | |
| GEORGE WESTON LTD | 11,511 | 95.710 | 1,101,717.810 | |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 28,300 | 68.900 | 1,949,870.000 | |
| DESCARTES SYSTEMS GROUP INC | 5,600 | 122.630 | 686,728.000 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 37,000 | 84.380 | 3,122,060.000 | |
| ENBRIDGE INC | 143,600 | 64.660 | 9,285,176.000 | |
| BROOKFIELD CORP CLASS A | 135,687 | 61.350 | 8,324,397.450 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 111,700 | 49.100 | 5,484,470.000 | |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD | 59,620 | 101.400 | 6,045,468.000 | |
| IA FINANCIAL INC | 6,100 | 176.160 | 1,074,576.000 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 9,200 | 86.990 | 800,308.000 | |

| | | | | | |
|--------------|------------------------------------|---------|---------|------------------|--|
| | CANADIAN NATIONAL RAILWAY | 34,550 | 134.320 | 4,640,756.000 | |
| | CGI INC CLASS A | 13,000 | 127.330 | 1,655,290.000 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 5,200 | 62.040 | 322,608.000 | |
| | TMX GROUP LTD | 18,000 | 51.260 | 922,680.000 | |
| | OPEN TEXT CORP | 16,800 | 46.000 | 772,800.000 | |
| | SAPUTO INC | 15,900 | 41.340 | 657,306.000 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 46,800 | 33.850 | 1,584,180.000 | |
| | FORTIS INC | 33,200 | 71.180 | 2,363,176.000 | |
| | RB GLOBAL INC | 12,200 | 143.290 | 1,748,138.000 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 44,700 | 27.970 | 1,250,259.000 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 93,900 | 23.410 | 2,198,199.000 | |
| | DOLLARAMA INC | 18,000 | 200.080 | 3,601,440.000 | |
| | ALTAGAS LTD | 19,300 | 41.210 | 795,353.000 | |
| | KEYERA CORP | 14,800 | 43.370 | 641,876.000 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 37,900 | 25.430 | 963,797.000 | |
| カナダ・ドル 小計 | | | | 250,778,134.580 | |
| | | | | (28,305,328,049) | |
| シンガポール・ドル | CAPITALAND INVESTMENT LTD | 170,900 | 2.650 | 452,885.000 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 92,900 | 34.660 | 3,219,914.000 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 157,740 | 55.240 | 8,713,557.600 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 115,975 | 6.280 | 728,323.000 | |
| | KEPPEL LTD | 106,400 | 10.100 | 1,074,640.000 | |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING (HOLDINGS | 188,600 | 3.520 | 663,872.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING LTD | 250,900 | 19.440 | 4,877,496.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD | 550,750 | 4.550 | 2,505,912.500 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 114,000 | 8.220 | 937,080.000 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 65,300 | 5.910 | 385,923.000 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 62,600 | 16.710 | 1,046,046.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 140,300 | 3.030 | 425,109.000 | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | | 25,030,758.100 | |
| | | | | (3,016,706,967) | |
| スイス・フラン | SANDOZ GROUP AG | 28,226 | 57.440 | 1,621,301.440 | |
| | BELIMO N AG | 658 | 779.000 | 512,582.000 | |
| | GALDERMA GROUP N AG | 10,602 | 162.300 | 1,720,704.600 | |
| | AVOLTA AG | 5,957 | 47.100 | 280,574.700 | |
| | UBS GROUP AG | 214,441 | 35.810 | 7,679,132.210 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-------------|----------------|--|
| ROCHE HOLDING AG | 2,164 | 327.200 | 708,060.800 | |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG | 469 | 548.500 | 257,246.500 | |
| ROCHE HOLDING PAR AG | 47,442 | 317.100 | 15,043,858.200 | |
| SIKA AG | 10,295 | 161.350 | 1,661,098.250 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGL | 7 | 117,600.000 | 823,200.000 | |
| ABB LTD | 105,844 | 57.300 | 6,064,861.200 | |
| SWISS RE AG | 20,176 | 129.250 | 2,607,748.000 | |
| NESTLE SA | 174,013 | 79.360 | 13,809,671.680 | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,533 | 948.600 | 1,454,203.800 | |
| SCHINDLER HOLDING PAR AG | 2,749 | 293.000 | 805,457.000 | |
| JULIUS BAER GRUPPE AG | 13,910 | 60.400 | 840,164.000 | |
| SGS SA | 11,177 | 88.940 | 994,082.380 | |
| SCHINDLER HOLDING AG | 1,571 | 277.000 | 435,167.000 | |
| HELVETIA BALOISE HOLDING N AG | 5,329 | 207.000 | 1,103,103.000 | |
| VAT GROUP AG | 1,798 | 373.800 | 672,092.400 | |
| BKW N AG | 1,374 | 167.200 | 229,732.800 | |
| ALCON AG | 33,743 | 63.360 | 2,137,956.480 | |
| THE SWATCH GROUP AG | 1,920 | 168.050 | 322,656.000 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 9,883 | 592.600 | 5,856,665.800 | |
| NOVARTIS AG | 128,380 | 107.960 | 13,859,904.800 | |
| BARRY CALLEBAUT AG | 240 | 1,251.000 | 300,240.000 | |
| COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA | 36,301 | 168.150 | 6,104,013.150 | |
| SWISSCOM AG | 1,749 | 564.000 | 986,436.000 | |
| BC VAUD N | 2,045 | 98.400 | 201,228.000 | |
| GEBERIT AG | 2,290 | 615.200 | 1,408,808.000 | |
| GIVAUDAN SA | 623 | 3,117.000 | 1,941,891.000 | |
| STRAUMANN HOLDING AG | 7,537 | 94.800 | 714,507.600 | |
| SONOVA HOLDING AG | 3,374 | 205.900 | 694,706.600 | |
| LOGITECH INTERNATIONAL SA | 10,319 | 84.620 | 873,193.780 | |
| LONZA GROUP AG | 4,744 | 523.800 | 2,484,907.200 | |
| HOLCIM LTD AG | 34,451 | 75.160 | 2,589,337.160 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 1,926 | 900.800 | 1,734,940.800 | |
| KUEHNE UND NAGEL INTERNATIONAL AG | 3,215 | 173.450 | 557,641.750 | |
| SWISS PRIME SITE AG | 5,427 | 119.300 | 647,441.100 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGL | 63 | 11,730.000 | 738,990.000 | |

| | | | | | |
|-----------------|---------------------------------------|---------|----------------|-------------------------------------|--|
| スイス・フラン 小計 | | | | 103,479,507.180 (20,244,730,784) | |
| スウェーデン・ クローナ | SAGAX CLASS B | 16,042 | 200.800 | 3,221,233.600 | |
| | ERICSSON CLASS B | 207,720 | 89.600 | 18,611,712.000 | |
| | VOLVO CLASS B | 117,935 | 290.800 | 34,295,498.000 | |
| | SKF CLASS B | 24,823 | 237.400 | 5,892,980.200 | |
| | TELE2 CLASS B | 39,841 | 152.200 | 6,063,800.200 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN CLAS | 112,365 | 189.250 | 21,265,076.250 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN CLASS A | 108,259 | 130.250 | 14,100,734.750 | |
| | SWEDBANK CLASS A | 63,015 | 310.300 | 19,553,554.500 | |
| | HENNES & MAURITZ CLASS B | 36,631 | 181.150 | 6,635,705.650 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AKTIEBOLAGET SCA | 45,090 | 120.250 | 5,422,072.500 | |
| | SKANSKA CLASS B | 24,765 | 248.700 | 6,159,055.500 | |
| | SANDVIK | 79,137 | 284.300 | 22,498,649.100 | |
| | INVESTOR CLASS B | 135,227 | 319.050 | 43,144,174.350 | |
| | ATLAS COPCO CLASS A | 199,364 | 160.100 | 31,918,176.400 | |
| | HOLMEN CLASS B | 5,564 | 347.600 | 1,934,046.400 | |
| | SECURITAS CLASS B | 35,897 | 144.150 | 5,174,552.550 | |
| | TELIA COMPANY | 172,199 | 38.480 | 6,626,217.520 | |
| | ALFA LAVAL | 21,474 | 448.800 | 9,637,531.200 | |
| | ATLAS COPCO CLASS B | 115,851 | 143.950 | 16,676,751.450 | |
| | ASSA ABLOY CLASS B | 74,392 | 350.900 | 26,104,152.800 | |
| | TRELLEBORG CLASS B | 14,805 | 379.200 | 5,614,056.000 | |
| | SAAB CLASS B | 23,774 | 491.200 | 11,677,788.800 | |
| | INDUSTRIVARDEN CLASS A | 8,651 | 401.800 | 3,475,971.800 | |
| | FASTIGHETS BALDER CLASS B | 52,407 | 65.500 | 3,432,658.500 | |
| | INDUTRADE | 19,944 | 233.800 | 4,662,907.200 | |
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM | 14,292 | 326.200 | 4,662,050.400 | |
| | LUNDBERGFÖRETAGEN CLASS B | 5,548 | 499.000 | 2,768,452.000 | |
| | LATOUR INVESTMENT CLASS B | 10,807 | 220.700 | 2,385,104.900 | |
| | LIFCO CLASS B | 17,015 | 345.000 | 5,870,175.000 | |
| | NIBE INDUSTRIER CLASS B | 110,614 | 34.800 | 3,849,367.200 | |
| | BEIJER REF CLASS B | 30,354 | 145.450 | 4,414,989.300 | |
| | ESSITY CLASS B | 44,745 | 267.400 | 11,964,813.000 | |
| BOLIDEN | 21,096 | 491.900 | 10,377,122.400 | | |
| EPIROC CLASS A | 48,913 | 205.200 | 10,036,947.600 | | |
| EPIROC CLASS B | 28,464 | 182.700 | 5,200,372.800 | | |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------------|---------|---------------|------------------------------------|--------------------------------|
| | EQT | 36,654 | 333.300 | 12,216,778.200 | |
| | EVOLUTION | 9,864 | 635.000 | 6,263,640.000 | |
| | HEXAGON CLASS B | 154,098 | 105.500 | 16,257,339.000 | |
| | ADDTECH CLASS B | 18,972 | 324.200 | 6,150,722.400 | |
| | INDUSTRIVARDEN CLASS C | 11,378 | 402.000 | 4,573,956.000 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | | | 440,790,887.420 (7,374,431,547) | |
| デンマーク・クローネ | NOVO NORDISK CLASS B | 239,134 | 308.150 | 73,689,142.100 | |
| | DANSKE BANK | 49,599 | 309.200 | 15,336,010.800 | |
| | A P MOLLER MAERSK CLASS A | 214 | 14,410.000 | 3,083,740.000 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS | 74,983 | 170.050 | 12,750,859.150 | |
| | CARLSBERG CLASS B | 6,980 | 833.800 | 5,819,924.000 | |
| | NOVOZYMES CLASS B | 26,164 | 393.000 | 10,282,452.000 | |
| | COLOPLAST CLASS B | 9,365 | 549.000 | 5,141,385.000 | |
| | DSV | 15,175 | 1,556.000 | 23,612,300.000 | |
| | ROCKWOOL CLASS B | 7,038 | 223.000 | 1,569,474.000 | |
| | DEMANT | 7,143 | 211.000 | 1,507,173.000 | |
| | A P MOLLER MAERSK CLASS B | 289 | 14,410.000 | 4,164,490.000 | |
| | TRYG | 24,543 | 159.300 | 3,909,699.900 | |
| | PANDORA | 5,767 | 694.200 | 4,003,451.400 | |
| | GENMAB | 4,529 | 2,019.000 | 9,144,051.000 | |
| OERSTED | 39,240 | 135.450 | 5,315,058.000 | | |
| デンマーク・クローネ 小計 | | | | 179,329,210.350 (4,384,599,193) | |
| ニュージーランド・ドル | MERIDIAN ENERGY LTD | 95,450 | 5.430 | 518,293.500 | |
| | INFRATIL LTD | 67,924 | 10.900 | 740,371.600 | |
| | AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD | 123,213 | 8.130 | 1,001,721.690 | |
| | CONTACT ENERGY LTD | 61,127 | 9.220 | 563,590.940 | |
| | FISHER AND PAYKEL HEALTHCARE CORPO | 43,631 | 37.250 | 1,625,254.750 | |
| | ニュージーランド・ドル 小計 | | | | 4,449,232.480 (399,363,107) |
| ノルウェー・クローネ | DNB BANK | 65,840 | 275.100 | 18,112,584.000 | |
| | NORSK HYDRO | 101,085 | 77.680 | 7,852,282.800 | |
| | ORKLA | 51,165 | 111.600 | 5,710,014.000 | |
| | TELENOR | 44,944 | 145.400 | 6,534,857.600 | |

| | | | | | |
|-----|-------------------------------|---------|-----------|-----------------------------------|--|
| | EQUINOR | 56,964 | 232.100 | 13,221,344.400 | |
| | YARA INTERNATIONAL | 12,085 | 405.300 | 4,898,050.500 | |
| | MOWI | 33,969 | 240.400 | 8,166,147.600 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING | 14,598 | 291.600 | 4,256,776.800 | |
| | AKER BP | 23,066 | 245.500 | 5,662,703.000 | |
| | KONGSBERG GRUPPEN | 32,662 | 252.500 | 8,247,155.000 | |
| | SALMAR | 4,882 | 615.000 | 3,002,430.000 | |
| | ノルウェー・クローネ 小計 | | | 85,664,345.700 (1,306,381,272) | |
| ユーロ | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 76,817 | 21.670 | 1,664,624.390 | |
| | DAIMLER TRUCK HOLDING E AG | 33,164 | 37.640 | 1,248,292.960 | |
| | EXOR NV | 6,497 | 71.750 | 466,159.750 | |
| | DR ING HC F PORSCHE PRF AG | 7,728 | 45.850 | 354,328.800 | |
| | DSM FIRMENICH AG | 11,995 | 69.040 | 828,134.800 | |
| | FERROVIAL | 35,851 | 56.780 | 2,035,619.780 | |
| | LOTUS BAKERIES NV | 29 | 7,650.000 | 221,850.000 | |
| | SYENSQO NV | 5,019 | 67.080 | 336,674.520 | |
| | CVC CAPITAL PARTNERS PLC | 14,682 | 14.140 | 207,603.480 | |
| | HENSOLDT AG | 4,417 | 71.750 | 316,919.750 | |
| | FINANCIERE DE TUBIZE SA | 1,487 | 209.500 | 311,526.500 | |
| | BAYER AG | 68,575 | 35.105 | 2,407,325.370 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 17,696 | 13.310 | 235,533.760 | |
| | DEUTSCHE BANK AG | 129,192 | 31.650 | 4,088,926.800 | |
| | COMMERZBANK AG | 51,022 | 35.050 | 1,788,321.100 | |
| | VOLKSWAGEN NON-VOTING PREF AG | 14,393 | 104.750 | 1,507,666.750 | |
| | SIEMENS N AG | 53,049 | 232.650 | 12,341,849.850 | |
| | E.ON N | 156,713 | 15.680 | 2,457,259.840 | |
| | BMW AG | 19,586 | 93.480 | 1,830,899.280 | |
| | GEA GROUP AG | 10,095 | 56.500 | 570,367.500 | |
| | CONTINENTAL AG | 7,685 | 65.720 | 505,058.200 | |
| | BASF N | 62,300 | 44.320 | 2,761,136.000 | |
| | ALLIANZ | 26,955 | 385.600 | 10,393,848.000 | |
| | HENKEL & KGAA PREF AG | 11,195 | 70.440 | 788,575.800 | |
| | RHEINMETALL AG | 3,211 | 1,527.000 | 4,903,197.000 | |
| | RWE AG | 44,133 | 43.860 | 1,935,673.380 | |
| | DEUTSCHE LUFTHANSA AG | 41,388 | 8.552 | 353,950.170 | |
| | BRENTAG | 8,367 | 49.770 | 416,425.590 | |
| | FRESENIUS SE AND CO KGAA | 29,486 | 47.780 | 1,408,841.080 | |
| | HOCHTIEF AG | 1,154 | 320.000 | 369,280.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| SAP | 72,889 | 207.050 | 15,091,667.450 | |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESE | 9,120 | 549.400 | 5,010,528.000 | |
| ZALANDO | 15,225 | 25.380 | 386,410.500 | |
| HEIDELBERG MATERIALS AG | 9,341 | 216.200 | 2,019,524.200 | |
| RATIONAL AG | 358 | 629.500 | 225,361.000 | |
| CTS EVENTIM AG | 4,270 | 76.800 | 327,936.000 | |
| SARTORIUS PREF AG | 1,807 | 236.500 | 427,355.500 | |
| TALANX AG | 4,411 | 111.600 | 492,267.600 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING PREF | 10,397 | 40.250 | 418,479.250 | |
| DELIVERY HERO | 12,982 | 21.660 | 281,190.120 | |
| NEMETSCHKE | 3,964 | 91.750 | 363,697.000 | |
| SCOUT24 N | 5,240 | 86.550 | 453,522.000 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 23,620 | 44.640 | 1,054,396.800 | |
| KNORR BREMSE AG | 5,068 | 92.500 | 468,790.000 | |
| SIEMENS ENERGY N AG | 54,520 | 115.550 | 6,299,786.000 | |
| BEIERSDORF AG | 6,764 | 94.820 | 641,362.480 | |
| MERCK | 9,021 | 119.350 | 1,076,656.350 | |
| ADIDAS N AG | 11,936 | 165.000 | 1,969,440.000 | |
| HENKEL AG | 7,259 | 65.750 | 477,279.250 | |
| DEUTSCHE TELEKOM N AG | 257,630 | 27.120 | 6,986,925.600 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG | 15,174 | 40.300 | 611,512.200 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP N AG | 50,409 | 60.080 | 3,028,572.720 | |
| QIAGEN NV | 15,133 | 38.480 | 582,317.840 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 91,155 | 35.095 | 3,199,084.720 | |
| HANNOVER RUECK | 4,210 | 259.600 | 1,092,916.000 | |
| DEUTSCHE POST AG | 67,009 | 46.200 | 3,095,815.800 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 13,144 | 217.100 | 2,853,562.400 | |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 3,757 | 350.200 | 1,315,701.400 | |
| SYMRISE AG | 9,150 | 68.720 | 628,788.000 | |
| BMW PREF AG | 3,862 | 92.150 | 355,883.300 | |
| VONOVIA | 52,834 | 24.050 | 1,270,657.700 | |
| LEG IMMOBILIEN N | 5,285 | 60.850 | 321,592.250 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 53,787 | 22.360 | 1,202,677.320 | |
| NN GROUP NV | 18,777 | 64.240 | 1,206,234.480 | |
| ARCELORMITTAL SA | 32,740 | 38.210 | 1,250,995.400 | |
| HEINEKEN NV | 20,103 | 69.780 | 1,402,787.340 | |
| AEGON LTD | 91,201 | 6.392 | 582,956.790 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 62,520 | 34.670 | 2,167,568.400 | |
| AKZO NOBEL NV | 11,768 | 57.660 | 678,542.880 | |
| WOLTERS KLUWER NV | 16,203 | 90.560 | 1,467,343.680 | |
| ING GROEP NV | 210,942 | 23.430 | 4,942,371.060 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 271,454 | 3.964 | 1,076,043.650 | |
| ASML HOLDING NV | 27,068 | 874.000 | 23,657,432.000 | |
| ABN AMRO BANK NV | 40,684 | 29.310 | 1,192,448.040 | |
| IMCD NV | 4,081 | 77.000 | 314,237.000 | |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV | 5,100 | 129.300 | 659,430.000 | |
| ASR NEDERLAND NV | 10,997 | 59.580 | 655,201.260 | |
| ADYEN NV | 1,760 | 1,329.600 | 2,340,096.000 | |
| PROSUS NV CLASS N | 91,330 | 51.480 | 4,701,668.400 | |
| JDE PEETS NV | 11,789 | 31.720 | 373,947.080 | |
| INPOST SA | 17,322 | 10.240 | 177,377.280 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | 3,271 | 508.200 | 1,662,322.200 | |
| RANDSTAD NV | 7,589 | 32.150 | 243,986.350 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 9,059 | 62.150 | 563,016.850 | |
| TOTALENERGIES | 138,320 | 55.130 | 7,625,581.600 | |
| MICHELIN | 46,799 | 28.280 | 1,323,475.720 | |
| LAIR LIQUIDE SOCIETE ANONYME POUR | 40,383 | 159.340 | 6,434,627.220 | |
| KERING SA | 5,196 | 313.000 | 1,626,348.000 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC | 38,270 | 231.000 | 8,840,370.000 | |
| BOUYGUES SA | 13,194 | 43.970 | 580,140.180 | |
| BNP PARIBAS SA | 70,114 | 80.080 | 5,614,729.120 | |
| THALES SA | 6,469 | 227.500 | 1,471,697.500 | |
| DANONE SA | 45,184 | 77.460 | 3,499,952.640 | |
| CARREFOUR SA | 40,771 | 14.350 | 585,063.850 | |
| LOREAL SA | 16,764 | 375.700 | 6,298,234.800 | |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN SA | 31,352 | 86.720 | 2,718,845.440 | |
| LEGRAND SA | 18,305 | 123.650 | 2,263,413.250 | |
| PERNOD RICARD SA | 14,087 | 76.700 | 1,080,472.900 | |
| REXEL SA | 15,472 | 32.350 | 500,519.200 | |
| SOCIETE GENERALE SA | 49,266 | 66.900 | 3,295,895.400 | |
| LVMH | 17,462 | 631.700 | 11,030,745.400 | |
| ACCOR SA | 13,692 | 47.620 | 652,013.040 | |
| CAPGEMINI | 10,726 | 147.850 | 1,585,839.100 | |
| PUBLICIS GROUPE SA | 15,976 | 88.820 | 1,418,988.320 | |

| | | | | |
|-----------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| BUREAU VERITAS SA | 23,886 | 26.520 | 633,456.720 | |
| EIFFAGE SA | 4,793 | 122.100 | 585,225.300 | |
| SODEXO SA | 6,187 | 46.460 | 287,448.020 | |
| IPSEN SA | 2,605 | 120.100 | 312,860.500 | |
| AMUNDI SA | 4,253 | 68.400 | 290,905.200 | |
| EURONEXT NV | 5,386 | 124.200 | 668,941.200 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 8,274 | 59.260 | 490,317.240 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH SA | 2,010 | 203.900 | 409,839.000 | |
| ESSILORLUXOTTICA SA | 21,013 | 273.700 | 5,751,258.100 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 1,353 | 269.200 | 364,227.600 | |
| FDJ UNITED | 7,358 | 23.380 | 172,030.040 | |
| AXA SA | 120,910 | 40.990 | 4,956,100.900 | |
| EDENRED | 16,373 | 18.900 | 309,449.700 | |
| RENAULT SA | 13,431 | 36.400 | 488,888.400 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 2,211 | 2,116.000 | 4,678,476.000 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 47,108 | 21.810 | 1,027,425.480 | |
| DASSAULT SYSTEMES | 46,811 | 23.640 | 1,106,612.040 | |
| ORANGE SA | 129,974 | 13.830 | 1,797,540.420 | |
| ALSTOM SA | 24,214 | 24.080 | 583,073.120 | |
| SANOFI SA | 77,112 | 82.120 | 6,332,437.440 | |
| VINCI SA | 34,843 | 119.750 | 4,172,449.250 | |
| AIRBUS | 41,477 | 190.400 | 7,897,220.800 | |
| VEOLIA ENVIRON. SA | 44,011 | 29.470 | 1,297,004.170 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 74,519 | 17.395 | 1,296,258.000 | |
| BIOMERIEUX SA | 2,802 | 108.500 | 304,017.000 | |
| ENGIE SA | 127,490 | 21.790 | 2,778,007.100 | |
| SAFRAN SA | 25,135 | 293.700 | 7,382,149.500 | |
| AEROPORTS DE PARIS SA | 2,392 | 128.800 | 308,089.600 | |
| GETLINK | 20,861 | 15.310 | 319,381.910 | |
| BOLLORE | 49,139 | 4.598 | 225,941.120 | |
| UCB SA | 8,825 | 235.100 | 2,074,757.500 | |
| KBC GROEP NV | 16,030 | 111.900 | 1,793,757.000 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV | 5,611 | 74.400 | 417,458.400 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA | 68,996 | 55.580 | 3,834,797.680 | |
| AGEAS SA | 10,282 | 59.050 | 607,152.100 | |
| DIETEREN GROUP SA | 1,502 | 146.300 | 219,742.600 | |
| ELIA GROUP SA | 2,979 | 106.300 | 316,667.700 | |
| SOFINA SA | 1,157 | 241.000 | 278,837.000 | |
| ARGENX | 4,299 | 744.800 | 3,201,895.200 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
| BUZZI | 5,720 | 51.350 | 293,722.000 | |
| PRYSMIAN | 19,652 | 81.920 | 1,609,891.840 | |
| GENERALI | 59,512 | 35.260 | 2,098,393.120 | |
| TENARIS SA | 25,755 | 16.915 | 435,645.820 | |
| UNICREDIT | 97,856 | 70.500 | 6,898,848.000 | |
| UNIPOL ASSICURAZIONI SPA | 25,062 | 20.100 | 503,746.200 | |
| TELECOM ITALIA | 795,819 | 0.496 | 394,885.380 | |
| INTESA SANPAOLO | 994,417 | 5.830 | 5,797,451.110 | |
| POSTE ITALIANE | 31,939 | 20.980 | 670,080.220 | |
| MONCLER | 16,305 | 56.500 | 921,232.500 | |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARM | 7,934 | 48.460 | 384,481.640 | |
| ENI | 142,814 | 15.638 | 2,233,325.330 | |
| BPER BANCA | 102,653 | 11.205 | 1,150,226.860 | |
| DAVIDE CAMPARI MILANO NV | 41,820 | 5.766 | 241,134.120 | |
| BANCO BPM | 78,957 | 12.745 | 1,006,306.960 | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE | 18,401 | 7.720 | 142,055.720 | |
| NEXI | 38,461 | 4.010 | 154,228.610 | |
| BANCA MEDIOLANUM | 15,600 | 18.940 | 295,464.000 | |
| LEONARDO | 28,249 | 46.400 | 1,310,753.600 | |
| BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SP | 137,331 | 8.535 | 1,172,120.080 | |
| ENEL | 567,721 | 8.621 | 4,894,322.740 | |
| SNAM | 140,897 | 5.588 | 787,332.430 | |
| TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE | 98,211 | 8.894 | 873,488.630 | |
| FINECOBANK BANCA FINECO | 42,689 | 21.590 | 921,655.510 | |
| STELLANTIS NV | 140,745 | 10.026 | 1,411,109.370 | |
| FERRARI NV | 8,798 | 311.400 | 2,739,697.200 | |
| TELEFONICA SA | 257,262 | 3.490 | 897,844.380 | |
| ENDESA SA | 22,194 | 30.480 | 676,473.120 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | 402,287 | 19.190 | 7,719,887.530 | |
| IBERDROLA SA | 442,939 | 17.945 | 7,948,540.350 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 350,758 | 3.355 | 1,176,793.090 | |
| BANKINTER SA | 47,200 | 14.115 | 666,228.000 | |
| REPSOL SA | 78,633 | 15.455 | 1,215,273.010 | |
| GRIFOLS SA CLASS A | 20,213 | 10.675 | 215,773.770 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,039,092 | 9.871 | 10,256,877.130 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| AMADEUS IT GROUP SA | 31,446 | 61.940 | 1,947,765.240 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 14,397 | 24.740 | 356,181.780 | |
| MAPFRE SA | 68,590 | 4.232 | 290,272.880 | |
| CAIXABANK SA | 272,093 | 10.315 | 2,806,639.290 | |
| INTERNATIONAL AIRLINES GROUP SA | 82,132 | 4.786 | 393,083.750 | |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y | 12,317 | 83.300 | 1,026,006.100 | |
| AENA SME SA | 52,351 | 23.470 | 1,228,677.970 | |
| CELLNEX TELECOM SA | 34,519 | 26.110 | 901,291.090 | |
| ACCIONA SA | 1,712 | 181.700 | 311,070.400 | |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | 76,142 | 54.800 | 4,172,581.600 | |
| REDEIA CORPORACION SA | 28,357 | 15.120 | 428,757.840 | |
| UPM-KYMMENE | 36,848 | 23.870 | 879,561.760 | |
| NOKIA | 370,288 | 5.314 | 1,967,710.430 | |
| WARTSILA | 35,108 | 29.290 | 1,028,313.320 | |
| STORA ENSO CLASS R | 40,694 | 10.165 | 413,654.510 | |
| ELISA | 9,684 | 37.360 | 361,794.240 | |
| SAMPO CLASS A | 169,005 | 10.135 | 1,712,865.670 | |
| FORTUM | 31,349 | 17.655 | 553,466.590 | |
| KESKO CLASS B | 18,838 | 18.810 | 354,342.780 | |
| KONE CLASS B | 23,725 | 59.160 | 1,403,571.000 | |
| NESTE | 29,558 | 18.355 | 542,537.090 | |
| ORION CLASS B | 7,636 | 60.700 | 463,505.200 | |
| METSO CORPORATION | 45,854 | 14.295 | 655,482.930 | |
| NORDEA BANK | 216,699 | 15.500 | 3,358,834.500 | |
| VERBUND AG | 4,639 | 61.250 | 284,138.750 | |
| OMV AG | 10,288 | 46.300 | 476,334.400 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 21,491 | 99.150 | 2,130,832.650 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 9,768 | 37.200 | 363,369.600 | |
| RYANAIR HOLDINGS PLC | 58,879 | 29.450 | 1,733,986.550 | |
| AIB GROUP PLC | 149,140 | 9.050 | 1,349,717.000 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 66,750 | 16.220 | 1,082,685.000 | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 10,662 | 73.950 | 788,454.900 | |
| JERONIMO MARTINS SA | 19,788 | 20.100 | 397,738.800 | |
| EDP ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 216,179 | 3.845 | 831,208.250 | |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA | 521,940 | 0.873 | 455,653.620 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA CLASS B | 29,156 | 14.005 | 408,329.780 | |

| | | | | | |
|----------------------------|------------------------------------|---------|----------------|--------------------------------------|--|
| | EDP RENOVAVEIS SA | 21,782 | 11.680 | 254,413.760 | |
| | KERRY GROUP PLC | 11,282 | 76.600 | 864,201.200 | |
| ユーロ 小計 | | | | 421,916,903.410 (77,079,999,083) | |
| 香港・ドル | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 101,500 | 53.250 | 5,404,875.000 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 146,000 | 37.720 | 5,507,120.000 | |
| | MTR CORPORATION CORP LTD | 114,000 | 29.720 | 3,388,080.000 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | 107,500 | 93.950 | 10,099,625.000 | |
| | SINO LAND LTD | 268,000 | 10.290 | 2,757,720.000 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 199,169 | 54.050 | 10,765,084.450 | |
| | WHARF (HOLDINGS) LTD | 77,000 | 22.740 | 1,750,980.000 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD A | 26,000 | 63.950 | 1,662,700.000 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 122,000 | 68.700 | 8,381,400.000 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT LTD | 106,507 | 29.120 | 3,101,483.840 | |
| | HONG KONG AND CHINA GAS LTD | 832,475 | 6.990 | 5,819,000.250 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 55,800 | 153.600 | 8,570,880.000 | |
| | WH GROUP LTD | 609,000 | 8.880 | 5,407,920.000 | |
| | HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING L | 89,500 | 398.400 | 35,656,800.000 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 140,669 | 38.780 | 5,455,143.820 | |
| | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDING | 47,000 | 55.000 | 2,585,000.000 | |
| | AIA GROUP LTD | 780,600 | 80.950 | 63,189,570.000 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 99,000 | 26.980 | 2,671,020.000 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT COMPA | 122,000 | 24.080 | 2,937,760.000 | |
| | SANDS CHINA LTD | 177,600 | 20.060 | 3,562,656.000 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES LTD | 109,000 | 89.800 | 9,788,200.000 | | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 275,000 | 38.060 | 10,466,500.000 | | |
| 香港・ドル 小計 | | | | 208,929,518.360 (4,178,590,367) | |
| 合計 | | | | 836,211,564,442 [836,211,564,442] | |

(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 REIT INC | 10,237 | 1,855,558.620 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP REIT INC | 23,407 | 4,312,037.540 | |
| | | BXP INC | 10,800 | 751,032.000 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS REIT CORP CLASS | 7,700 | 1,470,315.000 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL REIT | 26,000 | 1,611,480.000 | |
| | | EQUINIX REIT INC | 6,988 | 5,226,185.440 | |
| | | AMERICAN TOWER REIT CORP | 33,500 | 5,979,415.000 | |
| | | AMERICAN HOMES RENT REIT CLASS A | 23,500 | 752,470.000 | |
| | | KIMCO REALTY REIT CORP | 48,500 | 991,825.000 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT | 20,300 | 923,447.000 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 41,700 | 1,140,912.000 | |
| | | VICI PPTYS INC | 76,400 | 2,168,996.000 | |
| | | VENTAS REIT INC | 32,500 | 2,564,250.000 | |
| | | WEYERHAEUSER REIT | 51,214 | 1,215,308.220 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 31,200 | 2,753,400.000 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 21,100 | 1,675,129.000 | |
| | | SUN COMMUNITIES REIT INC | 9,100 | 1,129,583.000 | |
| | | PROLOGIS REIT INC | 66,454 | 8,510,763.780 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES RE | 11,000 | 523,160.000 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC | 4,600 | 1,207,270.000 | |
| | | WELLTOWER INC | 47,900 | 9,060,764.000 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 49,800 | 816,720.000 | |
| | | MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 8,400 | 1,151,556.000 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I | 13,200 | 825,132.000 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT REIT INC | 46,100 | 1,033,562.000 | |
| | | REALTY INCOME REIT CORP | 65,495 | 3,782,991.200 | |
| | | PUBLIC STORAGE REIT | 11,320 | 3,024,364.400 | |
| | | REGENCY CENTERS REIT CORP | 12,200 | 830,210.000 | |
| | | UDR REIT INC | 22,300 | 811,943.000 | |
| | | W. P. CAREY REIT INC | 15,700 | 1,022,855.000 | |

| | | | | |
|---------------|---------------------------------------|---------|------------------------------------|--|
| | DIGITAL REALTY TRUST REIT INC | 24,400 | 3,620,716.000 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE REIT INC | 15,200 | 2,004,576.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | 74,747,927.200 (11,631,524,952) | |
| イギリス・ポンド | LAND SECURITIES GROUP REIT PLC | 48,766 | 290,645.360 | |
| | SEGRE REIT PLC | 89,617 | 627,856.700 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | 918,502.060 (191,149,464) | |
| オーストラリア・ドル | TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS | 208,784 | 3,016,928.800 | |
| | APA GROUP UNITS | 86,730 | 792,712.200 | |
| | SCENTRE GROUP UNIT | 345,787 | 1,438,473.920 | |
| | STOCKLAND STAPLED UNITS LTD | 162,875 | 957,705.000 | |
| | GOODMAN GROUP UNITS | 137,157 | 3,933,662.760 | |
| | VICINITY CENTRES | 262,867 | 659,796.170 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | 10,799,278.850 (1,109,301,923) | |
| シンガポール・ドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 285,800 | 788,808.000 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T | 450,991 | 1,046,299.120 | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | 1,835,107.120 (221,167,110) | |
| ユーロ | UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS | 8,397 | 771,348.420 | |
| | GECINA SA | 3,108 | 246,309.000 | |
| | KLEPIERRE REIT SA | 15,036 | 501,600.960 | |
| | COVIVIO SA | 3,853 | 208,832.600 | |
| ユーロ 小計 | | | 1,728,090.980 (315,704,941) | |
| 香港・ドル | LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 193,600 | 6,632,736.000 | |
| | HKT TRUST AND HKT UNITS LTD | 277,000 | 3,240,900.000 | |
| 香港・ドル 小計 | | | 9,873,636.000 (197,472,720) | |
| 投資証券 合計 | | | 13,666,321,110 [13,666,321,110] | |

| | | | |
|----|--|------------------|--|
| 合計 | | 13,666,321,110 | |
| | | [13,666,321,110] | |

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 526銘柄 | 98.2% | 1.8% | 77.1% |
| | 投資証券 32銘柄 | | | |
| イギリス・ポンド | 株式 71銘柄 | 99.4% | 0.6% | 3.8% |
| | 投資証券 2銘柄 | | | |
| イスラエル・シケル | 株式 10銘柄 | 100% | -% | 0.2% |
| オーストラリア・ドル | 株式 40銘柄 | 91.6% | 8.4% | 1.6% |
| | 投資証券 6銘柄 | | | |
| カナダ・ドル | 株式 83銘柄 | 100% | -% | 3.3% |
| シンガポール・ドル | 株式 12銘柄 | 93.2% | 6.8% | 0.4% |
| | 投資証券 2銘柄 | | | |
| スイス・フラン | 株式 40銘柄 | 100% | -% | 2.4% |
| 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% | -% | 0.5% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 5銘柄 | 100% | -% | 0.0% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 11銘柄 | 100% | - | 0.2% |
| | | | | |
| ユーロ | 株式 216銘柄 | 99.6% | 0.4% | 9.1% |
| | 投資証券 4銘柄 | | | |
| 香港・ドル | 株式 22銘柄 | 95.5% | 4.5% | 0.5% |
| | 投資証券 2銘柄 | | | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2024年12月18日現在 金額（円） | 2025年12月18日現在 金額（円） |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 3,171,608,678 | 3,868,008,545 |
| コール・ローン | 1,335,347,355 | 2,401,225,042 |
| 国債証券 | 324,394,571,828 | 380,587,952,315 |
| 派生商品評価勘定 | 19,916,088 | 7,886,943 |
| 未収入金 | 3,462,085 | 1,342,837 |
| 未収利息 | 2,482,543,434 | 3,101,577,426 |
| 前払費用 | 153,891,904 | 196,768,510 |
| 流動資産合計 | 331,561,341,372 | 390,164,761,618 |
| 資産合計 | 331,561,341,372 | 390,164,761,618 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 337,728 | 504,491 |
| 未払金 | 14,265 | 1,220,335,358 |
| 未払解約金 | 309,636,718 | 591,949,818 |
| 流動負債合計 | 309,988,711 | 1,812,789,667 |
| 負債合計 | 309,988,711 | 1,812,789,667 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 89,547,195,166 | 96,342,155,305 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 241,704,157,495 | 292,009,816,646 |
| 元本等合計 | 331,251,352,661 | 388,351,971,951 |
| 純資産合計 | 331,251,352,661 | 388,351,971,951 |
| 負債純資産合計 | 331,561,341,372 | 390,164,761,618 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|----|------------------------------|
| | |

| | |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 2023年12月19日 | 2024年12月19日 |
| 期首元本額 | 82,652,055,717円 | 89,547,195,166円 |
| 期中追加設定元本額 | 16,450,147,562円 | 16,742,229,880円 |
| 期中一部解約元本額 | 9,555,008,113円 | 9,947,269,741円 |
| 期末元本額の内訳 | | |

| ファンド名 | | |
|---|-----------------|-----------------|
| ダイワ外国債券インデックスV A | 324,211,441円 | 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) | 4,781,204円 | 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) | 30,065,328円 | 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) | 14,033,041円 | 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) | 165,405,939円 | 128,585,190円 |
| 外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用) | 862,368,326円 | 1,068,874,178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) | 626,597,140円 | 697,540,586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) | 981,378,486円 | 1,055,877,362円 |
| ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジな し) | 6,255,603,498円 | 8,990,949,850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) | 1,141,672,928円 | 1,108,770,873円 |
| D-I's 外国債券インデック ス | 1,854,652円 | 1,207,634円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 21,957,522円 | 28,034,880円 |
| iFree 外国債券インデック ス | 1,366,095,940円 | 1,250,435,277円 |
| iFree 8資産バランス | 2,814,766,620円 | 3,417,582,606円 |
| iFree 年金バランス | 671,427,825円 | 790,545,183円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 2,389,602円 | 4,416,493円 |
| DCダイワ外国債券インデック ス | 51,472,893,222円 | 50,684,294,827円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30 | 1,196,484,774円 | 1,225,140,614円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50 | 934,115,462円 | 1,010,850,139円 |
| ダイワ・ライフ・バランス70 | 750,649,313円 | 849,032,107円 |

| | | |
|--|----------------|----------------|
| D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) | 742,484,165円 | 803,421,268円 |
| D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) | 609,463,845円 | 665,045,291円 |
| D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) | 292,026,114円 | 324,214,241円 |
| D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 36,746,467円 | 34,970,586円 |
| D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 22,755,567円 | 31,253,447円 |
| ダイワつみたてインデックス外 国債券 | 2,478,042,791円 | 2,946,240,617円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス30 | 5,041,201円 | 5,339,628円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス50 | 2,514,030円 | 3,213,774円 |
| ダイワつみたてインデックスバ ランス70 | 10,205,784円 | 41,493,736円 |
| ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ラップ専 用) | 2,584,397,859円 | 3,410,440,718円 |
| ダイワ世界バランスファンド4 0VA | 89,069,708円 | 80,675,074円 |
| ダイワ世界バランスファンド6 0VA | 26,929,432円 | 24,732,473円 |
| ダイワ・バランスファンド35 VA | 2,415,693,402円 | 2,044,376,496円 |
| ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用) | 150,818,032円 | 128,123,750円 |
| スタイル9(4資産分散・保守 型) | 237,164円 | 402,700円 |
| スタイル9(4資産分散・バラ ンス型) | 2,681,759円 | 5,038,174円 |
| スタイル9(4資産分散・積極 型) | 2,477,850円 | 5,755,951円 |
| スタイル9(6資産分散・保守 型) | 52,155円 | 159,844円 |
| スタイル9(6資産分散・バラ ンス型) | 1,827,207円 | 4,730,681円 |
| スタイル9(6資産分散・積極 型) | 641,559円 | 2,337,929円 |

| | | |
|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| スタイル9（8資産分散・保守型） | 81,076円 | 235,471円 |
| スタイル9（8資産分散・バランス型） | 1,766,798円 | 3,130,277円 |
| スタイル9（8資産分散・積極型） | 2,017,872円 | 3,474,251円 |
| ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用） | 2,705,214円 | 388,878,702円 |
| ダイワ・インデックスセレクト外国債券 | 127,039,766円 | 106,972,669円 |
| ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド | 68,146,721円 | 64,139,066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） | 4,105,335,628円 | 6,303,174,632円 |
| ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス | 6,026,779,896円 | 6,215,078,711円 |
| ダイワライフスタイル25 | 24,997,512円 | 22,659,781円 |
| ダイワライフスタイル50 | 58,284,801円 | 57,438,361円 |
| ダイワライフスタイル75 | 17,181,528円 | 17,576,423円 |
| 計 | 89,547,195,166円 | 96,342,155,305円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 89,547,195,166口 | 96,342,155,305口 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 2,282,920,276 | 2,624,840,997 |
| 合計 | 2,282,920,276 | 2,624,840,997 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | (円) | うち 1年超 | | | (円) | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 1,044,836,940 | - | 1,064,415,300 | 19,578,360 | 1,839,140,097 | - | 1,846,522,549 | 7,382,452 |
| アメリカ・ドル | 157,201,956 | - | 159,885,120 | 2,683,164 | 89,701,666 | - | 89,603,368 | 98,298 |
| イギリス・ポンド | 23,424,418 | - | 24,157,456 | 733,038 | 6,188,832 | - | 6,230,127 | 41,295 |
| イスラエル・シェケル | - | - | - | - | 63,525,189 | - | 63,725,886 | 200,697 |
| オーストラリア・ドル | - | - | - | - | 47,723,551 | - | 47,977,675 | 254,124 |
| オフショア・人民元 | 492,890,369 | - | 502,671,610 | 9,781,241 | 783,974,557 | - | 785,746,630 | 1,772,073 |
| カナダ・ドル | 49,991,058 | - | 50,164,920 | 173,862 | 182,784,226 | - | 184,467,998 | 1,683,772 |
| シンガポール・ドル | - | - | - | - | 39,477,916 | - | 39,501,335 | 23,419 |
| スウェーデン・クローナ | 11,630,489 | - | 11,889,468 | 258,979 | - | - | - | - |
| ニュージーランド・ドル | 52,620,253 | - | 52,491,257 | 128,996 | 163,378,414 | - | 163,860,274 | 481,860 |
| ノルウェー・クローネ | 25,831,178 | - | 26,163,883 | 332,705 | 35,011,265 | - | 34,681,411 | 329,854 |
| メキシコ・ペソ | 108,926,260 | - | 112,484,941 | 3,558,681 | - | - | - | - |
| ユーロ | 122,320,959 | - | 124,506,645 | 2,185,686 | 427,374,481 | - | 430,727,845 | 3,353,364 |
| 合計 | 1,044,836,940 | - | 1,064,415,300 | 19,578,360 | 1,839,140,097 | - | 1,846,522,549 | 7,382,452 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 3,6992円 | 4,0310円 |
| (1万口当たり純資産額) | (36,992円) | (40,310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 | 743,670.100 | |
| | | 5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115 | 738,000.000 | 772,966.440 | |
| | | 6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 714,000.000 | 788,770.080 | |
| | | 5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 2,391,000.000 | 2,575,346.100 | |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215 | 2,576,000.000 | 2,665,850.880 | |
| | | 5% United States Treasury Note/Bond 20370515 | 847,000.000 | 907,840.010 | |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215 | 548,000.000 | 553,945.800 | |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515 | 519,000.000 | 529,296.960 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215 | 1,049,000.000 | 957,170.540 | |
| 4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515 | 1,121,000.000 | 1,099,936.410 | |
| 4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815 | 1,060,000.000 | 1,063,392.000 | |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115 | 1,210,000.000 | 1,195,008.100 | |
| 4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215 | 1,010,000.000 | 1,021,867.500 | |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515 | 1,178,000.000 | 1,158,209.600 | |
| 3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815 | 1,091,000.000 | 1,010,876.960 | |
| 4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115 | 1,469,000.000 | 1,417,114.920 | |
| 4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215 | 1,254,000.000 | 1,276,572.000 | |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515 | 1,365,000.000 | 1,330,970.550 | |
| 3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815 | 1,517,000.000 | 1,367,666.520 | |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115 | 1,450,000.000 | 1,199,976.500 | |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215 | 1,623,000.000 | 1,336,816.410 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20420515 | 1,353,000.000 | 1,090,423.290 | |
| 2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815 | 5,231,000.000 | 4,044,399.960 | |
| 2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115 | 1,630,000.000 | 1,253,877.500 | |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215 | 2,626,000.000 | 2,127,138.780 | |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515 | 2,298,000.000 | 1,786,419.240 | |
| 3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815 | 3,214,000.000 | 2,780,110.000 | |
| 3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115 | 2,081,000.000 | 1,827,118.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215 | 4,307,000.000 | 3,704,838.330 | |
| 3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515 | 1,327,000.000 | 1,097,614.780 | |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815 | 1,929,000.000 | 1,531,510.260 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20441115 | 2,746,000.000 | 2,129,632.840 | |
| 2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215 | 2,063,000.000 | 1,464,234.880 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20450515 | 2,935,000.000 | 2,263,706.800 | |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815 | 1,873,000.000 | 1,409,357.580 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20451115 | 2,359,000.000 | 1,807,748.880 | |
| 2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215 | 2,248,000.000 | 1,570,250.480 | |
| 2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515 | 2,823,000.000 | 1,964,610.390 | |
| 2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815 | 2,780,000.000 | 1,835,773.000 | |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115 | 1,000,000.000 | 741,090.000 | |
| 2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215 | 3,640,000.000 | 3,588,093.600 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20470215 | 2,345,000.000 | 1,771,389.550 | |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515 | 6,400,000.000 | 6,301,248.000 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20470515 | 2,000,000.000 | 1,506,940.000 | |
| 2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815 | 5,900,000.000 | 5,781,764.000 | |
| 2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815 | 2,450,000.000 | 1,757,287.000 | |
| 2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 5,500,000.000 | 5,375,810.000 | |
| 2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115 | 2,500,000.000 | 1,787,100.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215 | 6,350,000.000 | 6,252,718.000 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20480215 | 3,000,000.000 | 2,241,210.000 | |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515 | 3,800,000.000 | 2,897,348.000 | |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515 | 11,500,000.000 | 11,336,010.000 | |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815 | 3,700,000.000 | 3,640,726.000 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20480815 | 3,220,000.000 | 2,392,266.800 | |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115 | 3,700,000.000 | 3,659,078.000 | |
| 3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115 | 3,020,000.000 | 2,397,004.200 | |
| 2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215 | 6,600,000.000 | 6,419,094.000 | |
| 3% United States Treasury Note/Bond 20490215 | 4,700,000.000 | 3,475,039.000 | |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515 | 4,150,000.000 | 2,988,788.500 | |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515 | 3,900,000.000 | 3,751,761.000 | |
| 1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815 | 5,700,000.000 | 5,322,546.000 | |
| 2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815 | 2,200,000.000 | 1,384,614.000 | |
| 1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115 | 5,350,000.000 | 4,993,636.500 | |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115 | 4,500,000.000 | 2,902,320.000 | |
| 1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130 | 2,000,000.000 | 1,964,500.000 | |
| 1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231 | 2,500,000.000 | 2,455,075.000 | |
| 1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215 | 5,000,000.000 | 4,593,050.000 | |
| 1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131 | 6,500,000.000 | 6,356,285.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 2% United States Treasury Note/Bond 20500215 | 4,400,000.000 | 2,592,216.000 | |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228 | 1,300,000.000 | 1,264,146.000 | |
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331 | 1,600,000.000 | 1,542,736.000 | |
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 6,800,000.000 | 5,967,476.000 | |
| 0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430 | 2,400,000.000 | 2,304,840.000 | |
| 1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515 | 3,900,000.000 | 1,880,073.000 | |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515 | 3,400,000.000 | 2,157,844.000 | |
| 0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531 | 3,500,000.000 | 3,352,720.000 | |
| 0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630 | 3,500,000.000 | 3,344,950.000 | |
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815 | 8,000,000.000 | 6,964,640.000 | |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731 | 5,000,000.000 | 4,756,500.000 | |
| 1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815 | 6,200,000.000 | 3,066,086.000 | |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815 | 6,100,000.000 | 3,834,155.000 | |
| 0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831 | 3,500,000.000 | 3,328,395.000 | |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930 | 4,000,000.000 | 3,786,480.000 | |
| 0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115 | 9,800,000.000 | 8,569,218.000 | |
| 0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031 | 4,000,000.000 | 3,785,600.000 | |
| 1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115 | 6,000,000.000 | 3,167,100.000 | |
| 1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115 | 4,300,000.000 | 2,793,796.000 | |
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130 | 5,000,000.000 | 4,732,700.000 | |

| | | | |
|---|----------------|---------------|--|
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231 | 5,000,000.000 | 4,721,350.000 | |
| 0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131 | 7,000,000.000 | 6,611,850.000 | |
| 1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215 | 5,900,000.000 | 3,314,797.000 | |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 10,700,000.000 | 9,427,877.000 | |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229 | 5,000,000.000 | 4,751,550.000 | |
| 1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215 | 4,700,000.000 | 3,285,488.000 | |
| 1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331 | 4,000,000.000 | 3,804,600.000 | |
| 1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515 | 8,000,000.000 | 7,175,280.000 | |
| 1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430 | 1,500,000.000 | 1,424,115.000 | |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515 | 6,400,000.000 | 4,054,592.000 | |
| 2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515 | 3,800,000.000 | 2,796,838.000 | |
| 1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531 | 6,000,000.000 | 5,685,420.000 | |
| 1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630 | 5,000,000.000 | 4,729,000.000 | |
| 1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815 | 10,300,000.000 | 8,980,261.000 | |
| 2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815 | 3,900,000.000 | 2,247,375.000 | |
| 1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815 | 5,700,000.000 | 3,845,562.000 | |
| 1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731 | 5,000,000.000 | 4,688,650.000 | |
| 1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831 | 5,000,000.000 | 4,695,100.000 | |
| 1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930 | 5,000,000.000 | 4,701,250.000 | |
| 1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115 | 10,000,000.000 | 8,719,500.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115 | 6,600,000.000 | 3,669,402.000 | |
| 2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115 | 4,000,000.000 | 2,790,840.000 | |
| 1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031 | 6,000,000.000 | 5,650,740.000 | |
| 1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130 | 5,000,000.000 | 4,893,800.000 | |
| 1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130 | 5,600,000.000 | 5,283,768.000 | |
| 1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231 | 6,500,000.000 | 6,099,275.000 | |
| 1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231 | 4,000,000.000 | 3,907,800.000 | |
| 1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215 | 7,900,000.000 | 7,055,332.000 | |
| 1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131 | 4,300,000.000 | 4,073,648.000 | |
| 2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215 | 5,200,000.000 | 3,172,000.000 | |
| 2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215 | 2,500,000.000 | 1,840,625.000 | |
| 1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228 | 5,000,000.000 | 4,748,100.000 | |
| 1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228 | 5,000,000.000 | 4,904,450.000 | |
| 2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331 | 3,000,000.000 | 2,890,170.000 | |
| 2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331 | 5,000,000.000 | 4,936,900.000 | |
| 2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515 | 6,300,000.000 | 5,949,783.000 | |
| 2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515 | 5,000,000.000 | 3,511,800.000 | |
| 3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515 | 1,500,000.000 | 1,251,675.000 | |
| 2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430 | 3,000,000.000 | 2,934,780.000 | |
| 2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430 | 3,000,000.000 | 2,970,090.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531 | 5,000,000.000 | 4,866,850.000 | |
| 2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531 | 2,000,000.000 | 1,975,380.000 | |
| 3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630 | 4,000,000.000 | 3,956,000.000 | |
| 3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630 | 3,000,000.000 | 2,989,380.000 | |
| 2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731 | 4,070,000.000 | 4,022,747.300 | |
| 2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815 | 9,500,000.000 | 8,872,620.000 | |
| 3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815 | 5,200,000.000 | 3,744,156.000 | |
| 3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815 | 2,000,000.000 | 1,691,820.000 | |
| 2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731 | 3,360,000.000 | 3,250,800.000 | |
| 3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831 | 2,500,000.000 | 2,484,950.000 | |
| 3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831 | 3,500,000.000 | 3,442,705.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930 | 2,500,000.000 | 2,523,325.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930 | 3,500,000.000 | 3,538,255.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031 | 3,000,000.000 | 3,034,080.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115 | 10,200,000.000 | 10,339,842.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115 | 3,700,000.000 | 3,225,475.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031 | 3,000,000.000 | 3,041,070.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130 | 2,500,000.000 | 2,523,025.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130 | 3,000,000.000 | 3,021,780.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115 | 2,500,000.000 | 2,294,425.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231 | 5,000,000.000 | 5,046,950.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231 | 1,500,000.000 | 1,511,355.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131 | 3,000,000.000 | 2,985,210.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215 | 8,000,000.000 | 7,790,240.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215 | 2,500,000.000 | 2,252,825.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215 | 4,500,000.000 | 3,662,100.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131 | 3,700,000.000 | 3,700,555.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228 | 7,500,000.000 | 7,603,950.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229 | 3,000,000.000 | 3,032,160.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331 | 1,800,000.000 | 1,798,488.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331 | 3,700,000.000 | 3,710,767.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430 | 3,000,000.000 | 2,981,520.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430 | 2,000,000.000 | 2,000,100.000 | |
| 3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515 | 6,300,000.000 | 6,071,688.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515 | 5,600,000.000 | 4,552,296.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515 | 2,500,000.000 | 2,247,150.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531 | 3,700,000.000 | 3,711,026.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531 | 1,500,000.000 | 1,505,385.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630 | 3,000,000.000 | 3,011,010.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630 | 3,500,000.000 | 3,542,630.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731 | 3,500,000.000 | 3,553,725.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815 | 9,000,000.000 | 8,949,330.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815 | 5,000,000.000 | 4,449,800.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815 | 2,300,000.000 | 2,201,606.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731 | 3,000,000.000 | 3,041,070.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831 | 3,100,000.000 | 3,158,590.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831 | 3,000,000.000 | 3,065,730.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930 | 1,500,000.000 | 1,560,930.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930 | 4,200,000.000 | 4,322,472.000 | |
| 4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031 | 6,000,000.000 | 6,218,520.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115 | 10,000,000.000 | 10,352,300.000 | |
| 4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115 | 2,300,000.000 | 2,304,922.000 | |
| 4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031 | 3,100,000.000 | 3,261,417.000 | |
| 4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115 | 5,300,000.000 | 5,229,351.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130 | 3,000,000.000 | 3,090,630.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130 | 4,000,000.000 | 4,093,880.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215 | 2,000,000.000 | 2,016,780.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131 | 5,000,000.000 | 5,065,600.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231 | 4,500,000.000 | 4,508,955.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131 | 8,500,000.000 | 8,613,220.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231 | 1,000,000.000 | 1,006,250.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115 | 7,000,000.000 | 7,035,350.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215 | 10,200,000.000 | 10,195,920.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215 | 4,000,000.000 | 4,027,640.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215 | 4,400,000.000 | 3,998,984.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215 | 3,000,000.000 | 2,909,160.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228 | 3,600,000.000 | 3,689,136.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228 | 5,200,000.000 | 5,308,732.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315 | 5,000,000.000 | 5,044,700.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331 | 5,000,000.000 | 5,086,800.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331 | 2,000,000.000 | 2,037,340.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415 | 5,000,000.000 | 5,063,650.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515 | 8,500,000.000 | 8,712,160.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515 | 4,000,000.000 | 4,054,200.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430 | 2,500,000.000 | 2,583,200.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430 | 1,600,000.000 | 1,668,240.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515 | 5,200,000.000 | 5,032,612.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515 | 3,500,000.000 | 3,444,210.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531 | 5,600,000.000 | 5,766,320.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531 | 2,300,000.000 | 2,398,003.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615 | 4,500,000.000 | 4,573,620.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630 | 2,500,000.000 | 2,560,725.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630 | 100,000.000 | 102,210.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715 | 2,200,000.000 | 2,229,458.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731 | 8,300,000.000 | 8,414,540.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731 | 5,000,000.000 | 5,089,600.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815 | 10,500,000.000 | 10,366,230.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815 | 7,000,000.000 | 7,028,700.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815 | 5,300,000.000 | 4,817,488.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831 | 4,000,000.000 | 3,993,720.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815 | 1,800,000.000 | 1,656,054.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831 | 5,000,000.000 | 5,003,600.000 | |
| 3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915 | 4,000,000.000 | 3,992,160.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930 | 6,800,000.000 | 6,774,364.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930 | 2,300,000.000 | 2,280,404.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015 | 4,610,000.000 | 4,641,025.300 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031 | 5,000,000.000 | 5,090,700.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115 | 10,000,000.000 | 10,133,500.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115 | 4,200,000.000 | 4,248,888.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115 | 6,100,000.000 | 5,783,776.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031 | 3,300,000.000 | 3,356,826.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130 | 6,000,000.000 | 6,038,640.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130 | 5,500,000.000 | 5,600,650.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115 | 2,400,000.000 | 2,356,728.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130 | 3,500,000.000 | 3,558,765.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215 | 4,000,000.000 | 4,039,760.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231 | 4,000,000.000 | 4,111,640.000 | |
| 4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231 | 3,500,000.000 | 3,628,310.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231 | 1,500,000.000 | 1,510,830.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115 | 3,000,000.000 | 3,045,210.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131 | 6,500,000.000 | 6,651,450.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215 | 9,600,000.000 | 9,991,296.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215 | 5,500,000.000 | 5,585,690.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215 | 5,600,000.000 | 5,421,360.000 | |
| 4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215 | 3,500,000.000 | 3,490,130.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131 | 6,500,000.000 | 6,541,860.000 | |
| 4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131 | 4,000,000.000 | 4,118,960.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229 | 4,000,000.000 | 4,063,880.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228 | 4,000,000.000 | 4,028,320.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315 | 3,000,000.000 | 3,024,900.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331 | 5,000,000.000 | 5,022,250.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331 | 3,500,000.000 | 3,554,880.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331 | 7,000,000.000 | 7,096,880.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415 | 3,000,000.000 | 3,016,380.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430 | 2,500,000.000 | 2,508,150.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430 | 3,500,000.000 | 3,529,295.000 | |
| 4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515 | 6,800,000.000 | 6,718,128.000 | |
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515 | 9,500,000.000 | 9,603,075.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515 | 4,000,000.000 | 4,022,880.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430 | 4,500,000.000 | 4,540,320.000 | |
| 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450515 | 1,200,000.000 | 1,234,500.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531 | 5,800,000.000 | 5,830,566.000 | |
| 4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320531 | 3,500,000.000 | 3,552,535.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531 | 5,800,000.000 | 5,881,084.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280615 | 2,000,000.000 | 2,017,840.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630 | 5,800,000.000 | 5,821,924.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320630 | 3,300,000.000 | 3,325,575.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630 | 3,200,000.000 | 3,227,872.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280715 | 2,000,000.000 | 2,017,720.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731 | 6,000,000.000 | 6,051,780.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350815 | 7,500,000.000 | 7,571,475.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280815 | 6,000,000.000 | 6,017,520.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731 | 8,000,000.000 | 8,047,280.000 | |
| 4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550815 | 5,600,000.000 | 5,536,104.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320731 | 4,600,000.000 | 4,632,936.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320831 | 3,300,000.000 | 3,298,317.000 | |
| 4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450815 | 2,500,000.000 | 2,530,075.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831 | 3,500,000.000 | 3,507,350.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831 | 5,500,000.000 | 5,486,635.000 | |
| 3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280915 | 3,000,000.000 | 2,988,630.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930 | 5,500,000.000 | 5,485,370.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930 | 4,500,000.000 | 4,500,675.000 | |
| 3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320930 | 3,000,000.000 | 2,997,180.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281015 | 8,000,000.000 | 7,994,000.000 | |
| 3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031 | 4,500,000.000 | 4,486,635.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031 | 8,800,000.000 | 8,801,144.000 | |
| 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20351115 | 4,000,000.000 | 3,952,160.000 | |
| 3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281115 | 4,500,000.000 | 4,496,625.000 | |
| 4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20551115 | 2,400,000.000 | 2,325,000.000 | |
| 3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321031 | 4,000,000.000 | 3,964,360.000 | |

| | | | | |
|--|--|---------------|--|--|
| アメリカ・ドル 小計 | | | 1,127,899,523.120 (175,512,444,793) | |
| イギリス・ポンド | 2.5% United Kingdom Gilt 20650722 | 1,282,000.000 | 714,830.380 | |
| | 1.5% United Kingdom Gilt 20470722 | 1,760,000.000 | 927,678.400 | |
| | 1.75% United Kingdom Gilt 20370907 | 1,450,000.000 | 1,073,072.500 | |
| | 1.75% United Kingdom Gilt 20570722 | 1,810,000.000 | 850,899.100 | |
| | 1.25% United Kingdom Gilt 20270722 | 2,610,000.000 | 2,514,186.900 | |
| | 1.625% United Kingdom Gilt 20281022 | 1,500,000.000 | 1,419,030.000 | |
| | 1.625% United Kingdom Gilt 20711022 | 1,740,000.000 | 711,677.400 | |
| | 1.75% United Kingdom Gilt 20490122 | 1,210,000.000 | 655,807.900 | |
| | 1.625% United Kingdom Gilt 20541022 | 1,600,000.000 | 749,984.000 | |
| | 0.875% United Kingdom Gilt 20291022 | 2,600,000.000 | 2,335,242.000 | |
| | 1.25% United Kingdom Gilt 20411022 | 2,190,000.000 | 1,312,729.800 | |
| | 0.375% United Kingdom Gilt 20301022 | 1,700,000.000 | 1,443,062.000 | |
| | 0.5% United Kingdom Gilt 20611022 | 3,000,000.000 | 786,300.000 | |
| | 0.125% United Kingdom Gilt 20280131 | 2,200,000.000 | 2,050,664.000 | |
| | 0.625% United Kingdom Gilt 20501022 | 1,900,000.000 | 699,200.000 | |
| | 0.625% United Kingdom Gilt 20350731 | 4,200,000.000 | 2,951,928.000 | |
| | 0.25% United Kingdom Gilt 20310731 | 2,500,000.000 | 2,042,575.000 | |
| 0.875% United Kingdom Gilt 20460131 | 2,050,000.000 | 964,504.500 | | |
| 1.25% United Kingdom Gilt 20510731 | 2,200,000.000 | 973,676.000 | | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131 | 3,100,000.000 | 2,009,513.000 | |
| 0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131 | 2,700,000.000 | 2,447,631.000 | |
| 0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731 | 3,100,000.000 | 2,426,153.000 | |
| 1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731 | 1,300,000.000 | 596,089.000 | |
| 1% UNITED KINGDOM GILT 20320131 | 4,100,000.000 | 3,426,657.000 | |
| 1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022 | 1,220,000.000 | 394,914.000 | |
| 4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129 | 2,000,000.000 | 2,006,600.000 | |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129 | 1,300,000.000 | 1,181,544.000 | |
| 3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131 | 2,600,000.000 | 2,445,820.000 | |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022 | 2,500,000.000 | 1,956,750.000 | |
| 4% UNITED KINGDOM GILT 20631022 | 1,100,000.000 | 884,840.000 | |
| 4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607 | 3,400,000.000 | 3,461,642.000 | |
| 4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131 | 3,300,000.000 | 3,362,898.000 | |
| 4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022 | 1,500,000.000 | 1,442,550.000 | |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307 | 2,300,000.000 | 2,301,426.000 | |
| 4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731 | 1,980,000.000 | 1,734,301.800 | |
| 4% UNITED KINGDOM GILT 20311022 | 2,200,000.000 | 2,192,586.000 | |
| 4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722 | 2,800,000.000 | 2,827,608.000 | |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731 | 3,100,000.000 | 3,067,512.000 | |
| 4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131 | 2,550,000.000 | 2,421,556.500 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307 | 2,000,000.000 | 2,027,540.000 | |
| 4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307 | 3,000,000.000 | 3,054,600.000 | |
| 4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307 | 1,800,000.000 | 1,804,464.000 | |
| 5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131 | 350,000.000 | 359,915.500 | |
| 4.75% UNITED KINGDOM GILT 20351022 | 1,300,000.000 | 1,322,048.000 | |
| 4% UNITED KINGDOM GILT 20290522 | 800,000.000 | 804,064.000 | |
| 5.25% UNITED KINGDOM GILT 20410131 | 1,100,000.000 | 1,136,740.000 | |
| 4.125% UNITED KINGDOM GILT 20310307 | 500,000.000 | 502,365.000 | |
| 4.125% UNITED KINGDOM GILT 20330307 | 1,100,000.000 | 1,092,344.000 | |
| 6% United Kingdom Gilt 20281207 | 949,000.000 | 1,009,176.090 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20320607 | 1,440,000.000 | 1,455,854.400 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20360307 | 2,262,000.000 | 2,204,771.400 | |
| 4.75% United Kingdom Gilt 20381207 | 1,757,000.000 | 1,756,701.310 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20551207 | 1,708,000.000 | 1,465,122.400 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20461207 | 1,366,000.000 | 1,211,642.000 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20271207 | 2,332,000.000 | 2,358,887.960 | |
| 4.5% United Kingdom Gilt 20421207 | 2,116,000.000 | 1,995,112.920 | |
| 4.75% United Kingdom Gilt 20301207 | 2,300,000.000 | 2,392,230.000 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20491207 | 1,143,000.000 | 999,587.790 | |
| 4.25% United Kingdom Gilt 20390907 | 846,000.000 | 797,896.440 | |

| | | | | |
|---|--|---------------|-------------------------------------|--|
| | 4.5% United Kingdom Gilt 20340907 | 1,760,000.000 | 1,775,065.600 | |
| | 4% United Kingdom Gilt 20600122 | 1,174,000.000 | 956,516.500 | |
| | 4.25% United Kingdom Gilt 20401207 | 1,577,000.000 | 1,468,060.840 | |
| | 3.75% United Kingdom Gilt 20520722 | 1,552,000.000 | 1,229,866.880 | |
| | 3.25% United Kingdom Gilt 20440122 | 2,466,000.000 | 1,932,850.800 | |
| | 3.5% United Kingdom Gilt 20680722 | 1,386,000.000 | 999,624.780 | |
| | 3.5% United Kingdom Gilt 20450122 | 1,724,000.000 | 1,388,819.920 | |
| | イギリス・ポンド 小計 | | 107,267,507.710 (22,323,441,030) | |
| イスラエル・ シュケル | 5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131 | 2,500,000.000 | 2,867,025.000 | |
| | 2% Israel Government Bond - Fixed 20270331 | 1,800,000.000 | 1,760,868.000 | |
| | 3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331 | 2,400,000.000 | 2,192,832.000 | |
| | 2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928 | 1,200,000.000 | 1,152,156.000 | |
| | 1% Israel Government Bond - Fixed 20300331 | 2,400,000.000 | 2,138,592.000 | |
| | 1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531 | 3,400,000.000 | 2,604,706.000 | |
| | 1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430 | 3,400,000.000 | 2,911,522.000 | |
| | 2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129 | 1,980,000.000 | 1,455,616.800 | |
| | 3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228 | 3,800,000.000 | 3,794,794.000 | |
| | 4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330 | 2,700,000.000 | 2,702,619.000 | |
| | 3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930 | 2,500,000.000 | 2,498,125.000 | |
| 4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831 | 1,600,000.000 | 1,642,976.000 | | |

| | | | | |
|--|---|---------------|-----------------------------------|--|
| | 4.1% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20280731 | 1,400,000.000 | 1,410,150.000 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | | 29,131,981.800 (1,398,734,235) | |
| オーストラリア・ドル | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421 | 1,989,000.000 | 2,008,631.430 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421 | 1,354,000.000 | 1,315,790.120 | |
| | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421 | 2,258,000.000 | 2,253,732.380 | |
| | 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421 | 1,463,000.000 | 1,326,355.800 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621 | 2,207,000.000 | 1,874,890.640 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621 | 792,000.000 | 661,256.640 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121 | 1,672,000.000 | 1,632,574.240 | |
| | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521 | 1,728,000.000 | 1,655,614.080 | |
| | 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321 | 1,252,000.000 | 897,884.320 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121 | 1,500,000.000 | 1,443,765.000 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121 | 1,900,000.000 | 1,801,390.000 | |
| | 2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521 | 2,870,000.000 | 2,671,424.700 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521 | 1,390,000.000 | 1,053,592.200 | |
| | 1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621 | 2,840,000.000 | 2,448,193.600 | |
| | 1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521 | 2,700,000.000 | 2,221,317.000 | |
| | 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221 | 2,000,000.000 | 1,706,460.000 | |
| | 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621 | 2,000,000.000 | 1,013,360.000 | |
| 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121 | 2,500,000.000 | 2,061,675.000 | | |

| | | | | |
|-----------|--|----------------|-----------------------------------|--|
| | 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121 | 1,600,000.000 | 1,339,888.000 | |
| | 3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121 | 1,700,000.000 | 1,521,398.000 | |
| | 3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521 | 2,000,000.000 | 1,876,520.000 | |
| | 3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221 | 2,300,000.000 | 2,100,613.000 | |
| | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621 | 900,000.000 | 831,456.000 | |
| | 4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621 | 1,100,000.000 | 1,069,706.000 | |
| | 4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221 | 1,700,000.000 | 1,633,649.000 | |
| | 4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321 | 2,500,000.000 | 2,397,200.000 | |
| | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20361021 | 1,400,000.000 | 1,336,356.000 | |
| | オーストラリア・ドル 小計 | | 44,154,693.150 (4,535,570,081) | |
| オフショア・人民元 | 3.25% China Government Bond 20281122 | 5,000,000.000 | 5,284,300.000 | |
| | 3.29% China Government Bond 20290523 | 5,000,000.000 | 5,332,500.000 | |
| | 3.12% China Government Bond 20261205 | 12,000,000.000 | 12,227,280.000 | |
| | 3.13% China Government Bond 20291121 | 25,000,000.000 | 26,641,750.000 | |
| | 2.85% China Government Bond 20270604 | 13,000,000.000 | 13,301,080.000 | |
| | 2.68% China Government Bond 20300521 | 29,500,000.000 | 30,879,715.000 | |
| | 3.28% China Government Bond 20271203 | 29,000,000.000 | 30,175,370.000 | |
| | 3.27% China Government Bond 20301119 | 12,500,000.000 | 13,593,875.000 | |
| | 3.81% China Government Bond 20500914 | 16,300,000.000 | 20,795,377.000 | |
| | 3.01% China Government Bond 20280513 | 27,000,000.000 | 28,071,090.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 3.72% China Government Bond 20510412 | 17,000,000.000 | 21,514,860.000 | |
| 3.02% China Government Bond 20310527 | 15,800,000.000 | 17,021,340.000 | |
| 3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803 | 5,500,000.000 | 5,728,085.000 | |
| 3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517 | 5,000,000.000 | 5,309,250.000 | |
| 3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816 | 4,500,000.000 | 4,779,900.000 | |
| 4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022 | 14,000,000.000 | 18,419,800.000 | |
| 3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722 | 11,800,000.000 | 15,054,322.000 | |
| 3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316 | 23,000,000.000 | 27,437,390.000 | |
| 2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014 | 15,500,000.000 | 16,169,135.000 | |
| 3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018 | 11,500,000.000 | 14,209,170.000 | |
| 2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118 | 16,000,000.000 | 17,144,320.000 | |
| 2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120 | 17,000,000.000 | 17,195,670.000 | |
| 2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217 | 15,200,000.000 | 16,156,992.000 | |
| 2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324 | 15,000,000.000 | 15,645,600.000 | |
| 2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415 | 15,000,000.000 | 15,228,900.000 | |
| 3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415 | 5,500,000.000 | 6,566,010.000 | |
| 2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515 | 5,000,000.000 | 5,322,100.000 | |
| 2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615 | 19,000,000.000 | 19,819,090.000 | |
| 2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815 | 19,000,000.000 | 20,115,300.000 | |
| 2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901 | 32,000,000.000 | 33,797,760.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925 | 9,500,000.000 | 9,884,845.000 | |
| 2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015 | 17,200,000.000 | 17,516,652.000 | |
| 3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025 | 19,500,000.000 | 22,565,790.000 | |
| 2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115 | 29,500,000.000 | 31,619,575.000 | |
| 2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215 | 19,000,000.000 | 19,941,830.000 | |
| 2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115 | 20,000,000.000 | 20,526,400.000 | |
| 2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225 | 15,000,000.000 | 16,187,850.000 | |
| 2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325 | 15,000,000.000 | 15,802,650.000 | |
| 2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415 | 25,000,000.000 | 25,724,000.000 | |
| 3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415 | 21,700,000.000 | 25,458,223.000 | |
| 2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525 | 35,000,000.000 | 37,221,800.000 | |
| 2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625 | 33,000,000.000 | 34,515,030.000 | |
| 2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715 | 35,000,000.000 | 35,922,600.000 | |
| 2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825 | 28,000,000.000 | 29,506,680.000 | |
| 2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925 | 25,000,000.000 | 25,758,000.000 | |
| 2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915 | 30,000,000.000 | 31,413,600.000 | |
| 3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015 | 26,000,000.000 | 29,697,460.000 | |
| 2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015 | 20,000,000.000 | 20,653,400.000 | |
| 2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125 | 36,000,000.000 | 38,395,800.000 | |
| 2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225 | 50,000,000.000 | 52,275,000.000 | |

| | | | |
|---|----------------|----------------|--|
| 2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115 | 58,000,000.000 | 59,642,560.000 | |
| 2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225 | 35,000,000.000 | 35,293,650.000 | |
| 2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225 | 16,000,000.000 | 16,665,120.000 | |
| 2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325 | 35,000,000.000 | 36,153,600.000 | |
| 2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415 | 73,000,000.000 | 74,365,100.000 | |
| 1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515 | 85,000,000.000 | 85,606,900.000 | |
| 2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525 | 21,000,000.000 | 21,742,350.000 | |
| 2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625 | 20,000,000.000 | 20,494,400.000 | |
| 1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715 | 28,000,000.000 | 28,398,440.000 | |
| 1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815 | 45,000,000.000 | 45,209,250.000 | |
| 2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825 | 44,000,000.000 | 45,030,040.000 | |
| 1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915 | 33,000,000.000 | 33,356,070.000 | |
| 1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015 | 21,000,000.000 | 21,161,280.000 | |
| 1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115 | 34,000,000.000 | 34,054,060.000 | |
| 2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125 | 19,000,000.000 | 19,321,100.000 | |
| 1.06% CHINA GOVERNMENT BOND 20261215 | 5,000,000.000 | 4,988,300.000 | |
| 1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225 | 9,100,000.000 | 8,995,441.000 | |
| 1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125 | 33,000,000.000 | 32,829,390.000 | |
| 1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115 | 4,000,000.000 | 3,715,600.000 | |
| 1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215 | 29,000,000.000 | 28,449,580.000 | |

| | | | | |
|--------|--|----------------|---------------------------------------|--|
| | 1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225 | 20,000,000.000 | 20,047,600.000 | |
| | 1.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315 | 10,000,000.000 | 10,031,400.000 | |
| | 1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325 | 52,000,000.000 | 52,338,520.000 | |
| | 1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515 | 17,000,000.000 | 16,728,000.000 | |
| | 1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525 | 30,000,000.000 | 30,087,000.000 | |
| | 1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525 | 37,000,000.000 | 36,570,060.000 | |
| | 1.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20270615 | 20,000,000.000 | 20,013,600.000 | |
| | 1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725 | 8,000,000.000 | 7,994,000.000 | |
| | 1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815 | 10,000,000.000 | 10,005,500.000 | |
| | 1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825 | 39,000,000.000 | 38,961,780.000 | |
| | 1.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20270915 | 31,000,000.000 | 31,026,040.000 | |
| | 1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20320915 | 13,000,000.000 | 13,041,990.000 | |
| | 1.63% CHINA GOVERNMENT BOND 20301025 | 12,000,000.000 | 12,006,840.000 | |
| | 1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20351115 | 10,000,000.000 | 9,946,700.000 | |
| | オフショア・人民元 小計 | | 2,003,795,777.000 (44,278,476,423) | |
| カナダ・ドル | 2.75% Canada Government International Bond 20641201 | 855,000.000 | 663,839.100 | |
| | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 1,383,000.000 | 1,515,159.480 | |
| | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601 | 1,117,000.000 | 1,298,735.900 | |
| | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601 | 1,012,000.000 | 1,151,099.400 | |
| | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601 | 913,000.000 | 947,557.050 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201 | 961,000.000 | 926,240.630 | |
| 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201 | 1,337,000.000 | 1,119,269.550 | |
| 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 1,240,000.000 | 1,213,340.000 | |
| 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601 | 650,000.000 | 639,931.500 | |
| 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201 | 3,710,000.000 | 2,579,822.700 | |
| 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 1,220,000.000 | 1,197,905.800 | |
| 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601 | 3,450,000.000 | 3,206,913.000 | |
| 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201 | 2,000,000.000 | 1,770,580.000 | |
| 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601 | 3,400,000.000 | 3,134,256.000 | |
| 1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201 | 2,650,000.000 | 1,694,277.500 | |
| 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301 | 2,200,000.000 | 2,168,320.000 | |
| 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201 | 2,700,000.000 | 2,463,480.000 | |
| 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601 | 1,500,000.000 | 1,397,760.000 | |
| 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201 | 600,000.000 | 586,572.000 | |
| 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901 | 1,200,000.000 | 1,203,216.000 | |
| 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201 | 2,270,000.000 | 2,167,895.400 | |
| 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301 | 1,300,000.000 | 1,323,478.000 | |
| 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601 | 1,700,000.000 | 1,642,268.000 | |
| 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201 | 1,780,000.000 | 1,428,005.000 | |
| 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901 | 1,200,000.000 | 1,216,968.000 | |

| | | | | |
|---------------|--|---------------|-----------------------------------|--|
| | 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201 | 1,000,000.000 | 996,060.000 | |
| | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301 | 1,800,000.000 | 1,866,474.000 | |
| | 3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601 | 1,700,000.000 | 1,657,075.000 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301 | 1,500,000.000 | 1,518,585.000 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901 | 800,000.000 | 818,120.000 | |
| | 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201 | 2,600,000.000 | 2,573,194.000 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301 | 2,000,000.000 | 1,986,680.000 | |
| | 3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201 | 1,700,000.000 | 1,710,421.000 | |
| | 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601 | 2,600,000.000 | 2,563,678.000 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201 | 1,250,000.000 | 1,165,975.000 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501 | 3,200,000.000 | 3,210,592.000 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901 | 2,400,000.000 | 2,375,880.000 | |
| | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801 | 500,000.000 | 499,500.000 | |
| | 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20351201 | 2,800,000.000 | 2,750,328.000 | |
| | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20271101 | 900,000.000 | 898,407.000 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310301 | 200,000.000 | 197,246.000 | |
| | 3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320301 | 1,000,000.000 | 992,920.000 | |
| | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280201 | 500,000.000 | 495,985.000 | |
| | カナダ・ドル 小計 | | 66,934,010.010 (7,554,841,710) | |
| シンガポール・ ドル | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301 | 772,000.000 | 790,605.200 | |

| | | | |
|---|-------------|---------------|--|
| 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901 | 809,000.000 | 845,235.110 | |
| 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401 | 400,000.000 | 421,996.000 | |
| 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901 | 568,000.000 | 615,138.320 | |
| 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701 | 625,000.000 | 649,081.250 | |
| 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301 | 818,000.000 | 875,832.600 | |
| 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801 | 750,000.000 | 747,000.000 | |
| 2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501 | 550,000.000 | 563,491.500 | |
| 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701 | 650,000.000 | 650,643.500 | |
| 1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301 | 540,000.000 | 497,334.600 | |
| 1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701 | 600,000.000 | 588,894.000 | |
| 1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001 | 500,000.000 | 458,495.000 | |
| 2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801 | 240,000.000 | 247,917.600 | |
| 3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801 | 920,000.000 | 1,054,136.000 | |
| 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901 | 500,000.000 | 511,715.000 | |
| 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801 | 400,000.000 | 413,212.000 | |
| 3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401 | 600,000.000 | 625,518.000 | |
| 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501 | 300,000.000 | 326,247.000 | |
| 3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601 | 100,000.000 | 118,424.000 | |
| 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301 | 230,000.000 | 240,462.700 | |
| 2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401 | 160,000.000 | 164,432.000 | |

| | | | | |
|-----------------|--|----------------|-----------------------------------|---------------------------------|
| | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20400701 | 90,000.000 | 89,418.600 | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | 11,495,229.980 (1,385,405,117) | |
| スウェーデン・ クローナ | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330 | 3,655,000.000 | 3,869,475.400 | |
| | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512 | 5,050,000.000 | 4,888,804.000 | |
| | 2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601 | 3,300,000.000 | 3,242,184.000 | |
| | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112 | 6,400,000.000 | 6,034,304.000 | |
| | 0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512 | 5,000,000.000 | 4,417,900.000 | |
| | 1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111 | 4,000,000.000 | 3,745,520.000 | |
| | 2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511 | 6,700,000.000 | 6,404,530.000 | |
| | 2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20361015 | 5,000,000.000 | 4,830,950.000 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | | 37,433,667.400 (626,265,256) | |
| デンマーク・ク ローネ | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115 | 13,662,000.000 | 16,073,206.380 | |
| | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115 | 5,100,000.000 | 4,974,336.000 | |
| | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115 | 4,090,000.000 | 3,840,469.100 | |
| | 0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115 | 3,500,000.000 | 1,704,010.000 | |
| | DANISH GOVERNMENT BOND 20311115 | 2,900,000.000 | 2,525,262.000 | |
| | 2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115 | 2,000,000.000 | 1,950,300.000 | |
| | 2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20351115 | 500,000.000 | 477,940.000 | |
| | デンマーク・クローネ 小計 | | | 31,545,523.480 (771,288,049) |
| ニュージーラン ド・ドル | 4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415 | 600,000.000 | 613,542.000 | |

| | | | | |
|----------------|---|---------------|---------------------------------|--|
| | 3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414 | 1,500,000.000 | 1,429,965.000 | |
| | 2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415 | 490,000.000 | 408,395.400 | |
| | 3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420 | 1,100,000.000 | 1,082,334.000 | |
| | 1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515 | 530,000.000 | 466,474.200 | |
| | 1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515 | 350,000.000 | 230,744.500 | |
| | 0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515 | 1,100,000.000 | 1,024,551.000 | |
| | 2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515 | 940,000.000 | 827,735.800 | |
| | 2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515 | 380,000.000 | 250,617.600 | |
| | 4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515 | 500,000.000 | 496,100.000 | |
| | 4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515 | 1,100,000.000 | 1,133,506.000 | |
| | 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515 | 700,000.000 | 681,709.000 | |
| | 4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515 | 500,000.000 | 501,380.000 | |
| | 4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515 | 1,300,000.000 | 1,267,344.000 | |
| | ニュージーランド・ドル 小計 | | 10,414,398.500 (934,796,409) | |
| ノルウェー・ク ローネ | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217 | 4,450,000.000 | 4,340,174.000 | |
| | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426 | 3,500,000.000 | 3,357,165.000 | |
| | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906 | 3,850,000.000 | 3,571,722.000 | |
| | 1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819 | 4,800,000.000 | 4,292,208.000 | |
| | 1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917 | 3,500,000.000 | 3,025,330.000 | |
| | 2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518 | 3,200,000.000 | 2,867,584.000 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|--|---------------|---------------------------------|--|
| | 3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006 | 1,600,000.000 | 1,486,736.000 | |
| | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815 | 4,000,000.000 | 3,737,520.000 | |
| | 3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413 | 3,500,000.000 | 3,395,490.000 | |
| | 3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531 | 2,000,000.000 | 1,896,760.000 | |
| | 3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612 | 3,900,000.000 | 3,790,605.000 | |
| | ノルウェー・クローネ 小計 | | 35,761,294.000 (545,359,733) | |
| ポーランド・ズ ロチ | 2.5% Poland Government Bond 20270725 | 3,170,000.000 | 3,109,991.900 | |
| | 2.75% Poland Government Bond 20291025 | 4,840,000.000 | 4,568,911.600 | |
| | 1.25% Poland Government Bond 20301025 | 5,800,000.000 | 4,977,270.000 | |
| | 1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425 | 5,000,000.000 | 4,176,950.000 | |
| | 3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525 | 3,700,000.000 | 3,703,071.000 | |
| | 7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725 | 5,000,000.000 | 5,421,300.000 | |
| | 6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025 | 5,000,000.000 | 5,314,750.000 | |
| | 4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725 | 7,000,000.000 | 7,098,980.000 | |
| | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025 | 4,500,000.000 | 4,451,445.000 | |
| | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125 | 4,000,000.000 | 4,076,640.000 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND 20270125 | 1,000,000.000 | 962,550.000 | |
| | 4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725 | 2,900,000.000 | 2,891,735.000 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND 20280125 | 100,000.000 | 92,278.000 | |
| 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025 | 3,600,000.000 | 3,535,416.000 | | |

| | | | | |
|---|--|---------------|-----------------------------------|--|
| | 4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20310125 | 2,000,000.000 | 1,981,740.000 | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20290425 | 827,000.000 | 864,694.660 | |
| | 2.75% Poland Government Bond 20280425 | 3,650,000.000 | 3,557,217.000 | |
| | ポーランド・ズロチ 小計 | | 60,784,940.160 (2,635,355,394) | |
| マレーシア・リ ンギット | 3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531 | 2,373,000.000 | 2,395,140.090 | |
| | 4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415 | 3,378,000.000 | 3,544,771.860 | |
| | 4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630 | 1,800,000.000 | 1,879,956.000 | |
| | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315 | 731,000.000 | 740,195.980 | |
| | 3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415 | 1,427,000.000 | 1,457,580.610 | |
| | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615 | 1,886,000.000 | 1,916,157.140 | |
| | 4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930 | 1,300,000.000 | 1,476,696.000 | |
| | 4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531 | 1,220,000.000 | 1,289,308.200 | |
| | 4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315 | 930,000.000 | 1,031,304.900 | |
| | 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130 | 1,550,000.000 | 1,565,205.500 | |
| | 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116 | 1,190,000.000 | 1,212,931.300 | |
| | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407 | 1,950,000.000 | 2,143,323.000 | |
| | 4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107 | 2,200,000.000 | 2,367,970.000 | |
| | 4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608 | 2,000,000.000 | 2,224,940.000 | |
| | 3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815 | 2,310,000.000 | 2,366,017.500 | |
| 4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706 | 1,200,000.000 | 1,372,260.000 | | |

| | | | | |
|---------|---|----------------|-----------------------------------|--|
| | 3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705 | 2,000,000.000 | 2,039,120.000 | |
| | 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522 | 2,550,000.000 | 2,537,173.500 | |
| | 4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615 | 2,650,000.000 | 2,694,308.000 | |
| | 2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415 | 1,800,000.000 | 1,737,792.000 | |
| | 3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715 | 1,400,000.000 | 1,410,346.000 | |
| | 4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015 | 1,900,000.000 | 2,099,310.000 | |
| | 4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430 | 500,000.000 | 521,715.000 | |
| | 4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331 | 2,200,000.000 | 2,362,822.000 | |
| | 3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420 | 2,300,000.000 | 2,325,645.000 | |
| | 4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418 | 1,200,000.000 | 1,235,400.000 | |
| | 4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516 | 1,500,000.000 | 1,559,775.000 | |
| | 3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515 | 1,000,000.000 | 1,002,260.000 | |
| | 3.476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702 | 2,050,000.000 | 2,036,142.000 | |
| | 3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715 | 830,000.000 | 818,803.300 | |
| | マレーシア・リングgit 小計 | | 53,364,369.880 (2,028,401,045) | |
| メキシコ・ペソ | 8% Mexican Bonos 20471107 | 21,300,000.000 | 18,466,887.000 | |
| | 5.5% MEXICAN BONOS 20270304 | 14,000,000.000 | 13,663,160.000 | |
| | 8% MEXICAN BONOS 20530731 | 37,000,000.000 | 31,757,100.000 | |
| | 7.5% MEXICAN BONOS 20330526 | 30,000,000.000 | 27,790,800.000 | |
| | 8% MEXICAN BONOS 20350524 | 5,000,000.000 | 4,645,300.000 | |
| | 8.5% MEXICAN BONOS 20290301 | 45,000,000.000 | 45,349,200.000 | |
| | 8.5% MEXICAN BONOS 20280302 | 10,000,000.000 | 10,116,700.000 | |
| | 8.5% MEXICAN BONOS 20300228 | 10,000,000.000 | 9,995,600.000 | |
| | 8% MEXICAN BONOS 20360221 | 4,000,000.000 | 3,705,640.000 | |
| | 8% MEXICAN BONOS 20320415 | 5,000,000.000 | 4,792,900.000 | |

| | | | | |
|-----|--|----------------|------------------------------------|--|
| | 8% MEXICAN BONOS 20550429 | 1,000,000.000 | 854,270.000 | |
| | 7.5% Mexican Bonos 20270603 | 27,968,000.000 | 27,915,699.840 | |
| | 10% Mexican Bonos 20361120 | 8,874,000.000 | 9,423,566.820 | |
| | 8.5% Mexican Bonos 20290531 | 29,544,000.000 | 29,737,808.640 | |
| | 8.5% Mexican Bonos 20381118 | 18,894,000.000 | 17,744,111.160 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20310529 | 44,515,000.000 | 42,795,385.550 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20421113 | 42,654,000.000 | 36,577,511.160 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20341123 | 35,944,000.000 | 33,267,969.200 | |
| | メキシコ・ペソ 小計 | | 368,599,609.370 (3,183,926,566) | |
| ユーロ | 0.75% Finland Government Bond 20310415 | 364,000.000 | 329,106.960 | |
| | 1.375% Finland Government Bond 20470415 | 360,000.000 | 235,350.000 | |
| | 0.5% Finland Government Bond 20270915 | 800,000.000 | 777,744.000 | |
| | 1.125% Finland Government Bond 20340415 | 470,000.000 | 404,237.600 | |
| | 0.5% Finland Government Bond 20280915 | 500,000.000 | 476,320.000 | |
| | 0.5% Finland Government Bond 20290915 | 500,000.000 | 465,340.000 | |
| | 0.125% Finland Government Bond 20360415 | 510,000.000 | 370,770.000 | |
| | 0.25% Finland Government Bond 20400915 | 400,000.000 | 249,800.000 | |
| | Finland Government Bond 20300915 | 500,000.000 | 442,290.000 | |
| | 0.125% Finland Government Bond 20520415 | 520,000.000 | 204,422.400 | |
| | 0.125% Finland Government Bond 20310915 | 600,000.000 | 517,098.000 | |
| | 0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415 | 450,000.000 | 268,663.500 | |
| | 1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915 | 800,000.000 | 733,192.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415 | 270,000.000 | 267,737.400 | |
| 2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415 | 400,000.000 | 373,964.000 | |
| 3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915 | 600,000.000 | 600,786.000 | |
| 2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415 | 1,000,000.000 | 1,014,970.000 | |
| 2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415 | 400,000.000 | 334,880.000 | |
| 3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915 | 600,000.000 | 596,136.000 | |
| 2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415 | 500,000.000 | 499,015.000 | |
| 3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415 | 350,000.000 | 326,480.000 | |
| 3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915 | 500,000.000 | 492,560.000 | |
| 2.625% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320415 | 100,000.000 | 98,813.000 | |
| 1.5% Austria Government Bond 20470220 | 784,000.000 | 530,791.520 | |
| 1.5% Austria Government Bond 20861102 | 240,000.000 | 111,580.800 | |
| 0.5% Austria Government Bond 20270420 | 1,280,000.000 | 1,254,489.600 | |
| 2.1% Austria Government Bond 21170920 | 540,000.000 | 310,581.000 | |
| 0.75% Austria Government Bond 20280220 | 1,200,000.000 | 1,164,144.000 | |
| 0.5% Austria Government Bond 20290220 | 1,280,000.000 | 1,208,064.000 | |
| Austria Government Bond 20300220 | 980,000.000 | 883,509.200 | |
| 0.75% Austria Government Bond 20510320 | 1,200,000.000 | 615,396.000 | |
| Austria Government Bond 20401020 | 700,000.000 | 417,683.000 | |
| 0.85% Austria Government Bond 21200630 | 750,000.000 | 225,757.500 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| Austria Government Bond 20310220 | 1,200,000.000 | 1,046,988.000 | |
| 0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020 | 600,000.000 | 437,232.000 | |
| 0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420 | 300,000.000 | 102,939.000 | |
| AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020 | 1,800,000.000 | 1,688,472.000 | |
| 0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220 | 1,500,000.000 | 1,340,775.000 | |
| 1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523 | 1,000,000.000 | 708,030.000 | |
| 2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220 | 1,300,000.000 | 1,300,975.000 | |
| 3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020 | 500,000.000 | 442,125.000 | |
| 2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523 | 200,000.000 | 203,448.000 | |
| 3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020 | 800,000.000 | 830,112.000 | |
| 2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220 | 500,000.000 | 496,250.000 | |
| 3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715 | 500,000.000 | 487,785.000 | |
| 2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020 | 800,000.000 | 801,192.000 | |
| 2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220 | 1,100,000.000 | 1,086,734.000 | |
| 2.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320920 | 300,000.000 | 299,409.000 | |
| 1% Belgium Government Bond 20310622 | 1,774,000.000 | 1,612,920.800 | |
| 1.9% Belgium Government Bond 20380622 | 758,000.000 | 626,850.840 | |
| 1.6% Belgium Government Bond 20470622 | 1,244,000.000 | 803,163.720 | |
| 2.15% Belgium Government Bond 20660622 | 740,000.000 | 432,567.000 | |
| 0.8% Belgium Government Bond 20270622 | 1,100,000.000 | 1,078,858.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.25% Belgium Government Bond 20570622 | 580,000.000 | 374,105.800 | |
| 1.45% Belgium Government Bond 20370622 | 600,000.000 | 482,454.000 | |
| 0.8% Belgium Government Bond 20280622 | 1,490,000.000 | 1,436,807.000 | |
| 1.25% Belgium Government Bond 20330422 | 1,350,000.000 | 1,195,236.000 | |
| 0.9% Belgium Government Bond 20290622 | 1,500,000.000 | 1,422,000.000 | |
| 1.7% Belgium Government Bond 20500622 | 700,000.000 | 436,009.000 | |
| 0.1% Belgium Government Bond 20300622 | 420,000.000 | 375,223.800 | |
| 0.4% Belgium Government Bond 20400622 | 860,000.000 | 536,966.800 | |
| Belgium Government Bond 20271022 | 1,200,000.000 | 1,153,848.000 | |
| Belgium Government Bond 20311022 | 1,600,000.000 | 1,359,680.000 | |
| 0.65% Belgium Government Bond 20710622 | 530,000.000 | 155,454.300 | |
| 0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622 | 1,400,000.000 | 1,188,166.000 | |
| 1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622 | 800,000.000 | 432,256.000 | |
| 2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422 | 800,000.000 | 722,592.000 | |
| 3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622 | 1,500,000.000 | 1,492,860.000 | |
| 3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622 | 600,000.000 | 504,300.000 | |
| 3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622 | 700,000.000 | 655,368.000 | |
| 2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022 | 1,400,000.000 | 1,357,104.000 | |
| 3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622 | 1,000,000.000 | 866,230.000 | |
| 2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022 | 800,000.000 | 804,712.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622 | 800,000.000 | 784,368.000 | |
| 3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622 | 700,000.000 | 659,883.000 | |
| 2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022 | 550,000.000 | 547,096.000 | |
| 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704 | 1,167,000.000 | 1,244,465.460 | |
| 5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104 | 2,162,000.000 | 2,311,545.540 | |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704 | 950,000.000 | 1,010,239.500 | |
| 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104 | 1,951,000.000 | 2,241,308.800 | |
| 5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104 | 3,048,000.000 | 3,480,633.120 | |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704 | 1,705,000.000 | 1,961,875.300 | |
| 4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104 | 1,971,000.000 | 2,159,979.480 | |
| 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704 | 2,725,000.000 | 3,061,919.000 | |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704 | 1,739,000.000 | 2,056,106.650 | |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704 | 1,474,000.000 | 1,470,049.680 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704 | 2,708,000.000 | 2,400,073.320 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815 | 3,079,000.000 | 2,684,302.990 | |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215 | 2,200,000.000 | 2,155,780.000 | |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815 | 3,300,000.000 | 3,215,652.000 | |
| 1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815 | 3,470,000.000 | 2,291,761.500 | |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215 | 1,900,000.000 | 1,836,122.000 | |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815 | 4,100,000.000 | 3,899,182.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215 | 4,700,000.000 | 4,417,906.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815 | 3,000,000.000 | 2,760,180.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815 | 3,150,000.000 | 1,359,004.500 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215 | 1,750,000.000 | 1,587,985.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515 | 2,800,000.000 | 2,144,268.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115 | 2,000,000.000 | 1,922,720.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815 | 3,500,000.000 | 3,133,585.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815 | 1,900,000.000 | 1,701,526.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215 | 1,900,000.000 | 1,676,199.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515 | 3,400,000.000 | 2,509,982.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115 | 2,000,000.000 | 1,877,580.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815 | 1,700,000.000 | 737,392.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815 | 1,600,000.000 | 1,391,072.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815 | 1,000,000.000 | 869,780.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215 | 3,100,000.000 | 2,652,918.000 | |
| 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515 | 1,600,000.000 | 1,257,904.000 | |
| 1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815 | 2,700,000.000 | 2,553,201.000 | |
| 1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815 | 2,650,000.000 | 1,870,317.000 | |
| 2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115 | 3,200,000.000 | 3,170,304.000 | |
| 2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215 | 4,200,000.000 | 4,102,854.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215 | 1,000,000.000 | 976,960.000 | |
| 1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815 | 1,000,000.000 | 707,330.000 | |
| 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815 | 2,400,000.000 | 2,381,616.000 | |
| 2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115 | 1,800,000.000 | 1,795,140.000 | |
| 2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215 | 2,400,000.000 | 2,303,088.000 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815 | 2,100,000.000 | 1,734,096.000 | |
| 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515 | 1,600,000.000 | 1,476,112.000 | |
| 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815 | 3,500,000.000 | 3,448,200.000 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215 | 1,900,000.000 | 1,850,011.000 | |
| 2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815 | 1,850,000.000 | 1,649,645.000 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215 | 800,000.000 | 779,808.000 | |
| 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350815 | 1,600,000.000 | 1,565,168.000 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20321115 | 50,000.000 | 49,510.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815 | 2,400,000.000 | 966,528.000 | |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210 | 100,000.000 | 99,984.000 | |
| 2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311 | 2,000,000.000 | 2,003,300.000 | |
| 1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610 | 100,000.000 | 99,444.000 | |
| 1.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270916 | 1,400,000.000 | 1,394,890.000 | |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271216 | 700,000.000 | 698,152.000 | |
| GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416 | 2,600,000.000 | 2,531,204.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015 | 3,000,000.000 | 2,958,540.000 | |
| 1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015 | 430,000.000 | 424,130.500 | |
| 2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413 | 1,000,000.000 | 1,001,140.000 | |
| 2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019 | 1,100,000.000 | 1,105,456.000 | |
| 2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412 | 100,000.000 | 99,398.000 | |
| 2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412 | 1,100,000.000 | 1,093,532.000 | |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011 | 1,010,000.000 | 1,015,504.500 | |
| 2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418 | 500,000.000 | 499,790.000 | |
| 2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301010 | 1,400,000.000 | 1,383,270.000 | |
| 5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425 | 3,323,000.000 | 3,634,032.800 | |
| 5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025 | 2,927,000.000 | 3,395,993.210 | |
| 4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425 | 2,659,000.000 | 2,926,149.730 | |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425 | 2,964,000.000 | 2,758,357.680 | |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025 | 2,374,000.000 | 2,417,634.120 | |
| 4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425 | 3,164,000.000 | 3,352,004.880 | |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425 | 1,717,000.000 | 1,570,179.330 | |
| 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025 | 5,099,000.000 | 5,143,565.260 | |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525 | 2,788,000.000 | 2,454,527.320 | |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525 | 5,087,000.000 | 5,038,876.980 | |
| 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525 | 5,120,000.000 | 4,762,675.200 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525 | 5,669,000.000 | 4,508,499.010 | |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525 | 1,587,000.000 | 782,978.190 | |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625 | 3,170,000.000 | 2,472,536.600 | |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525 | 3,400,000.000 | 3,343,526.000 | |
| 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525 | 2,550,000.000 | 1,721,428.500 | |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525 | 5,400,000.000 | 5,195,502.000 | |
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525 | 6,350,000.000 | 5,366,893.000 | |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125 | 4,950,000.000 | 4,712,499.000 | |
| 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525 | 3,250,000.000 | 1,875,380.000 | |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525 | 4,550,000.000 | 4,244,786.000 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125 | 4,200,000.000 | 3,789,996.000 | |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525 | 2,770,000.000 | 1,210,877.800 | |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525 | 3,100,000.000 | 1,933,160.000 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125 | 5,600,000.000 | 4,881,072.000 | |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525 | 1,180,000.000 | 292,840.600 | |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625 | 2,400,000.000 | 1,286,664.000 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125 | 5,200,000.000 | 4,364,984.000 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225 | 4,000,000.000 | 3,900,520.000 | |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525 | 2,600,000.000 | 1,101,438.000 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525 | 4,200,000.000 | 3,455,844.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525 | 3,000,000.000 | 2,243,520.000 | |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225 | 4,300,000.000 | 4,156,724.000 | |
| 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125 | 4,100,000.000 | 3,808,285.000 | |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525 | 1,600,000.000 | 1,283,760.000 | |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525 | 2,100,000.000 | 1,618,428.000 | |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525 | 4,600,000.000 | 4,529,528.000 | |
| 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225 | 5,300,000.000 | 5,336,464.000 | |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125 | 3,200,000.000 | 3,242,304.000 | |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625 | 700,000.000 | 568,470.000 | |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924 | 3,100,000.000 | 3,113,671.000 | |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525 | 1,800,000.000 | 1,450,440.000 | |
| 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225 | 4,600,000.000 | 4,607,774.000 | |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125 | 3,700,000.000 | 3,575,310.000 | |
| 3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525 | 1,200,000.000 | 1,133,424.000 | |
| 3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525 | 1,100,000.000 | 969,375.000 | |
| 3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525 | 3,500,000.000 | 3,414,740.000 | |
| 2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924 | 3,500,000.000 | 3,496,605.000 | |
| 2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225 | 3,200,000.000 | 3,172,864.000 | |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20351125 | 1,800,000.000 | 1,789,632.000 | |
| 5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115 | 1,139,000.000 | 1,215,221.880 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115 | 1,755,000.000 | 1,901,331.900 | |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115 | 1,729,000.000 | 1,808,412.970 | |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115 | 1,468,000.000 | 1,444,159.680 | |
| 2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115 | 1,879,000.000 | 1,672,291.210 | |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715 | 1,600,000.000 | 1,567,504.000 | |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715 | 1,350,000.000 | 1,300,738.500 | |
| 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715 | 1,200,000.000 | 1,113,228.000 | |
| 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115 | 1,200,000.000 | 824,292.000 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715 | 1,400,000.000 | 1,249,738.000 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115 | 1,300,000.000 | 1,272,596.000 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115 | 1,630,000.000 | 653,483.300 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715 | 1,500,000.000 | 1,297,920.000 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115 | 900,000.000 | 612,819.000 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115 | 900,000.000 | 838,908.000 | |
| 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715 | 1,000,000.000 | 867,640.000 | |
| 2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115 | 1,500,000.000 | 1,083,345.000 | |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715 | 900,000.000 | 880,866.000 | |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115 | 1,300,000.000 | 1,302,249.000 | |
| 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115 | 600,000.000 | 585,570.000 | |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715 | 1,350,000.000 | 1,309,122.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715 | 1,800,000.000 | 1,728,252.000 | |
| 3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20560115 | 450,000.000 | 441,927.000 | |
| 6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101 | 2,392,000.000 | 2,577,356.080 | |
| 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901 | 1,509,000.000 | 1,324,162.590 | |
| 1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301 | 2,065,000.000 | 1,907,378.550 | |
| 2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301 | 1,610,000.000 | 1,285,021.500 | |
| 2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901 | 2,324,000.000 | 2,054,323.040 | |
| 1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201 | 1,068,000.000 | 1,059,765.720 | |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301 | 968,000.000 | 687,793.040 | |
| 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901 | 1,500,000.000 | 1,421,940.000 | |
| 2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 1,510,000.000 | 1,511,600.600 | |
| 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301 | 1,650,000.000 | 1,478,499.000 | |
| 2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801 | 2,700,000.000 | 2,694,924.000 | |
| 2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901 | 1,300,000.000 | 1,197,222.000 | |
| 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201 | 2,100,000.000 | 2,089,143.000 | |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201 | 2,550,000.000 | 2,577,846.000 | |
| 3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301 | 2,470,000.000 | 2,462,194.800 | |
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901 | 1,450,000.000 | 1,375,484.500 | |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801 | 2,900,000.000 | 2,943,848.000 | |
| 3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301 | 1,250,000.000 | 1,148,000.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401 | 1,900,000.000 | 1,798,521.000 | |
| 0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115 | 2,350,000.000 | 2,319,332.500 | |
| 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901 | 1,550,000.000 | 1,127,625.000 | |
| 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301 | 1,800,000.000 | 1,480,554.000 | |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801 | 2,000,000.000 | 1,844,900.000 | |
| 1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201 | 2,100,000.000 | 1,988,301.000 | |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915 | 2,200,000.000 | 2,154,262.000 | |
| 1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301 | 1,500,000.000 | 1,135,950.000 | |
| 0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401 | 2,600,000.000 | 2,351,310.000 | |
| 1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901 | 1,200,000.000 | 725,484.000 | |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301 | 1,200,000.000 | 906,252.000 | |
| 0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315 | 1,900,000.000 | 1,815,849.000 | |
| 0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801 | 1,800,000.000 | 1,585,188.000 | |
| 1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430 | 1,100,000.000 | 722,359.000 | |
| 2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301 | 1,160,000.000 | 683,982.400 | |
| 0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715 | 2,300,000.000 | 2,193,832.000 | |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201 | 1,900,000.000 | 1,691,969.000 | |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601 | 2,300,000.000 | 2,019,722.000 | |
| 0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215 | 2,600,000.000 | 2,440,048.000 | |
| 2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901 | 800,000.000 | 532,024.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401 | 300,000.000 | 296,070.000 | |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615 | 1,800,000.000 | 1,814,310.000 | |
| 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201 | 1,600,000.000 | 1,538,544.000 | |
| 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301 | 2,300,000.000 | 2,195,419.000 | |
| 2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201 | 1,000,000.000 | 1,007,280.000 | |
| 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430 | 1,500,000.000 | 1,573,230.000 | |
| 4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501 | 1,800,000.000 | 1,942,668.000 | |
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215 | 3,100,000.000 | 3,238,818.000 | |
| 3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401 | 1,500,000.000 | 1,535,325.000 | |
| 4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901 | 1,600,000.000 | 1,677,120.000 | |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001 | 1,200,000.000 | 1,229,352.000 | |
| 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030 | 900,000.000 | 951,264.000 | |
| 3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615 | 1,200,000.000 | 1,247,520.000 | |
| 4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101 | 2,100,000.000 | 2,256,996.000 | |
| 3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801 | 700,000.000 | 724,661.000 | |
| 4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301 | 2,100,000.000 | 2,232,930.000 | |
| 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115 | 1,500,000.000 | 1,580,190.000 | |
| 4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201 | 600,000.000 | 628,314.000 | |
| 2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215 | 200,000.000 | 201,752.000 | |
| 3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215 | 1,000,000.000 | 1,029,980.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001 | 2,000,000.000 | 2,064,300.000 | |
| 3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701 | 1,400,000.000 | 1,435,434.000 | |
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701 | 1,600,000.000 | 1,658,224.000 | |
| 4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030 | 50,000.000 | 51,764.000 | |
| 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715 | 1,200,000.000 | 1,231,584.000 | |
| 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715 | 1,500,000.000 | 1,528,260.000 | |
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201 | 1,700,000.000 | 1,756,066.000 | |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001 | 800,000.000 | 810,248.000 | |
| 4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001 | 1,000,000.000 | 988,780.000 | |
| 3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115 | 1,300,000.000 | 1,311,401.000 | |
| 2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015 | 800,000.000 | 806,120.000 | |
| 3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801 | 1,000,000.000 | 1,013,650.000 | |
| 4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430 | 500,000.000 | 498,500.000 | |
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001 | 500,000.000 | 495,905.000 | |
| 2.55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225 | 800,000.000 | 803,448.000 | |
| 2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701 | 500,000.000 | 503,900.000 | |
| 2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615 | 500,000.000 | 503,020.000 | |
| 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715 | 1,700,000.000 | 1,715,334.000 | |
| 3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001 | 600,000.000 | 604,854.000 | |
| 2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301001 | 1,500,000.000 | 1,492,830.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270826 | 700,000.000 | 698,362.000 | |
| 2.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290115 | 300,000.000 | 298,506.000 | |
| 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321115 | 1,600,000.000 | 1,609,840.000 | |
| 4.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20551001 | 400,000.000 | 415,920.000 | |
| 2.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310201 | 1,550,000.000 | 1,548,698.000 | |
| 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360201 | 700,000.000 | 694,708.000 | |
| 5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101 | 1,554,000.000 | 1,705,546.080 | |
| 6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501 | 2,849,000.000 | 3,292,218.930 | |
| 5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201 | 1,805,000.000 | 2,101,146.350 | |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801 | 2,298,000.000 | 2,581,757.040 | |
| 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201 | 2,740,000.000 | 2,845,572.200 | |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801 | 1,544,000.000 | 1,739,979.920 | |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901 | 2,243,000.000 | 2,524,810.520 | |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901 | 2,410,000.000 | 2,555,973.700 | |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901 | 1,313,000.000 | 1,431,773.980 | |
| 3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301 | 2,318,000.000 | 2,393,682.700 | |
| 5.5% Belgium Government Bond 20280328 | 2,006,000.000 | 2,148,606.540 | |
| 5% Belgium Government Bond 20350328 | 1,904,000.000 | 2,161,801.600 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 4.25% Belgium Government Bond 20410328 | 1,504,000.000 | 1,577,936.640 | |
| 4% Belgium Government Bond 20320328 | 780,000.000 | 829,179.000 | |
| 3.75% Belgium Government Bond 20450622 | 643,000.000 | 620,649.320 | |
| 3% Belgium Government Bond 20340622 | 747,000.000 | 736,340.310 | |
| 2.4% IRISH TREASURY 20300515 | 961,000.000 | 956,627.450 | |
| 2% IRISH TREASURY 20450218 | 1,081,000.000 | 850,390.270 | |
| 1.7% IRISH TREASURY 20370515 | 550,000.000 | 469,694.500 | |
| 0.9% IRISH TREASURY 20280515 | 800,000.000 | 775,976.000 | |
| 1.3% IRISH TREASURY 20330515 | 750,000.000 | 672,757.500 | |
| 1.35% IRISH TREASURY 20310318 | 750,000.000 | 705,607.500 | |
| 1.1% IRISH TREASURY 20290515 | 950,000.000 | 910,898.000 | |
| 1.5% IRISH TREASURY 20500515 | 600,000.000 | 391,860.000 | |
| 0.4% IRISH TREASURY 20350515 | 350,000.000 | 273,378.000 | |
| 0.2% IRISH TREASURY 20270515 | 500,000.000 | 487,285.000 | |
| 0.2% IRISH TREASURY 20301018 | 800,000.000 | 714,872.000 | |
| IRISH TREASURY 20311018 | 800,000.000 | 685,848.000 | |
| 0.55% IRISH TREASURY 20410422 | 400,000.000 | 262,600.000 | |
| 0.35% IRISH TREASURY 20321018 | 100,000.000 | 84,934.000 | |
| 3% IRISH TREASURY 20431018 | 200,000.000 | 186,762.000 | |
| 2.6% IRISH TREASURY 20341018 | 500,000.000 | 483,335.000 | |
| 3.15% IRISH TREASURY 20551018 | 320,000.000 | 283,984.000 | |

| | | | |
|--|---------------|---------------|--|
| 6.25% Austria Government Bond 20270715 | 825,000.000 | 877,437.000 | |
| 4.15% Austria Government Bond 20370315 | 1,373,000.000 | 1,486,505.910 | |
| 3.8% Austria Government Bond 20620126 | 338,000.000 | 334,816.040 | |
| 3.15% Austria Government Bond 20440620 | 723,000.000 | 676,294.200 | |
| 2.4% Austria Government Bond 20340523 | 1,371,000.000 | 1,308,523.530 | |
| 2.75% Finland Government Bond 20280704 | 389,000.000 | 394,193.150 | |
| 2.625% Finland Government Bond 20420704 | 407,000.000 | 358,066.390 | |
| 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131 | 2,652,000.000 | 2,939,768.520 | |
| 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730 | 2,052,000.000 | 1,994,708.160 | |
| 2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031 | 1,752,000.000 | 1,507,122.960 | |
| 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730 | 1,250,000.000 | 1,070,375.000 | |
| 1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430 | 1,900,000.000 | 1,884,211.000 | |
| 2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730 | 1,750,000.000 | 1,670,200.000 | |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031 | 2,050,000.000 | 2,024,067.500 | |
| 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430 | 2,400,000.000 | 2,355,048.000 | |
| 2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031 | 2,200,000.000 | 1,793,440.000 | |
| 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730 | 2,900,000.000 | 2,835,127.000 | |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430 | 1,600,000.000 | 1,551,072.000 | |
| 1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730 | 3,950,000.000 | 3,496,461.000 | |
| 0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031 | 3,800,000.000 | 3,536,888.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430 | 2,560,000.000 | 2,343,552.000 | |
| 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031 | 1,700,000.000 | 907,256.000 | |
| 0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730 | 2,600,000.000 | 2,545,296.000 | |
| 1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031 | 2,400,000.000 | 2,247,720.000 | |
| 1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031 | 2,100,000.000 | 1,506,981.000 | |
| 0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430 | 2,200,000.000 | 1,915,782.000 | |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031 | 950,000.000 | 430,815.500 | |
| SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131 | 2,500,000.000 | 2,387,575.000 | |
| 0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730 | 700,000.000 | 525,546.000 | |
| 0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031 | 2,200,000.000 | 1,930,610.000 | |
| 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730 | 600,000.000 | 396,318.000 | |
| SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131 | 2,200,000.000 | 2,149,334.000 | |
| 0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430 | 2,100,000.000 | 1,838,676.000 | |
| 1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031 | 1,600,000.000 | 1,043,936.000 | |
| 0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730 | 3,100,000.000 | 2,921,595.000 | |
| 2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031 | 2,100,000.000 | 2,050,482.000 | |
| 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730 | 1,300,000.000 | 1,237,301.000 | |
| 3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430 | 2,600,000.000 | 2,624,050.000 | |
| 3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730 | 2,100,000.000 | 2,160,900.000 | |
| 3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031 | 1,500,000.000 | 1,549,065.000 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531 | 1,400,000.000 | 1,447,880.000 | |
| 3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430 | 2,600,000.000 | 2,619,448.000 | |
| 2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531 | 200,000.000 | 200,966.000 | |
| 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031 | 1,200,000.000 | 1,176,972.000 | |
| 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031 | 2,600,000.000 | 2,649,790.000 | |
| 3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730 | 1,800,000.000 | 1,829,556.000 | |
| 2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131 | 200,000.000 | 201,050.000 | |
| 3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430 | 1,200,000.000 | 1,190,244.000 | |
| 2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531 | 500,000.000 | 501,265.000 | |
| 3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131 | 500,000.000 | 486,305.000 | |
| 3.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20351031 | 1,500,000.000 | 1,487,790.000 | |
| 3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330131 | 200,000.000 | 200,162.000 | |
| 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730 | 2,179,000.000 | 2,552,524.180 | |
| 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131 | 1,754,000.000 | 1,879,814.420 | |
| 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730 | 1,858,000.000 | 2,112,973.340 | |
| 4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730 | 1,973,000.000 | 2,199,204.450 | |
| 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031 | 1,770,000.000 | 1,906,644.000 | |
| 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031 | 1,699,000.000 | 1,997,752.160 | |
| 4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415 | 850,000.000 | 913,716.000 | |
| 4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414 | 680,000.000 | 698,183.200 | |

| | | | |
|---|---------------|--------------------------------------|--|
| 3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215 | 630,000.000 | 666,117.900 | |
| 2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017 | 1,300,000.000 | 1,298,648.000 | |
| 4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215 | 570,000.000 | 596,835.600 | |
| 2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418 | 720,000.000 | 679,874.400 | |
| 1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615 | 1,000,000.000 | 988,870.000 | |
| 0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018 | 900,000.000 | 817,686.000 | |
| 0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015 | 620,000.000 | 604,958.800 | |
| 0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012 | 750,000.000 | 607,192.500 | |
| 1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412 | 630,000.000 | 334,435.500 | |
| 0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017 | 750,000.000 | 655,027.500 | |
| 1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411 | 520,000.000 | 360,271.600 | |
| 1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716 | 570,000.000 | 531,177.300 | |
| 3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618 | 500,000.000 | 502,645.000 | |
| 2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020 | 630,000.000 | 620,442.900 | |
| 3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612 | 440,000.000 | 413,432.800 | |
| 3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615 | 300,000.000 | 296,334.000 | |
| 3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615 | 300,000.000 | 292,530.000 | |
| 2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20331014 | 100,000.000 | 99,321.000 | |
| ユーロ 小計 | | 617,842,500.810 (112,873,646,474) | |
| 国債証券 合計 | | 380,587,952,315 [380,587,952,315] | |

| | | | |
|----|--|-------------------|--|
| 合計 | | 380,587,952,315 | |
| | | [380,587,952,315] | |

- (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 288銘柄 | 100% | 46.1% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 66銘柄 | 100% | 5.9% |
| イスラエル・シケル | 国債証券 13銘柄 | 100% | 0.4% |
| 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 84銘柄 | 100% | 11.6% |
| カナダ・ドル | 国債証券 43銘柄 | 100% | 2.0% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 22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% | 0.2% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 11銘柄 | 100% | 0.1% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 17銘柄 | 100% | 0.7% |
| マレーシア・リングギット | 国債証券 30銘柄 | 100% | 0.5% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 18銘柄 | 100% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券 410銘柄 | 100% | 29.7% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」- REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | | |
|--|---------------|---------------|
| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
| | 金額 (円) | 金額 (円) |

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 6,739,841,082 | 8,955,019,082 |
| 投資証券 | 2 253,282,199,744 | 244,822,013,400 |
| 派生商品評価勘定 | - | 264,708,000 |
| 未収入金 | 1,090,085,949 | 807,814,995 |
| 未収配当金 | 1,671,925,406 | 1,353,279,820 |
| 前払金 | 58,240,000 | - |
| 差入委託証拠金 | 477,207,668 | 423,729,969 |
| 流動資産合計 | 263,319,499,849 | 256,626,565,266 |
| 資産合計 | 263,319,499,849 | 256,626,565,266 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 81,256,000 | - |
| 前受金 | - | 229,155,600 |
| 未払解約金 | 1,036,039,000 | 1,379,583,900 |
| 流動負債合計 | 1,117,295,000 | 1,608,739,500 |
| 負債合計 | 1,117,295,000 | 1,608,739,500 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 86,235,422,547 | 64,556,516,313 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 175,966,782,302 | 190,461,309,453 |
| 元本等合計 | 262,202,204,849 | 255,017,825,766 |
| 純資産合計 | 262,202,204,849 | 255,017,825,766 |
| 負債純資産合計 | 263,319,499,849 | 256,626,565,266 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|---------------------------|------------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 2023年12月19日 | 2024年12月19日 |
| 期首元本額 | 126,407,264,091円 | 86,235,422,547円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,954,092,175円 | 4,767,742,763円 |
| 期中一部解約元本額 | 47,125,933,719円 | 26,446,648,997円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワJ-REITオープン | 3,409,516,133円 | 2,637,173,228円 |
| ダイワJ-REITオープン (毎月分配型) | 65,612,425,608円 | 42,858,374,015円 |
| ダイワJ-REITオープン (年1回決算型) | 740,904,069円 | 879,562,608円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 26,039,587円 | 29,043,888円 |
| iFree J-REITイン デックス | 602,624,144円 | 492,921,438円 |
| iFree 8資産バランス | 3,343,787,945円 | 3,502,471,902円 |
| ダイワJ-REITオープン (奇数月決算型) | 106,813,641円 | 117,092,863円 |

| | | | |
|----|---------------------------------------|---|---|
| | D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 402,452円 | 545,816円 |
| | D C・ダイワJ - R E I Tオー プン | 5,235,391,280円 | 5,402,979,572円 |
| | D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 9,854,023円 | 8,549,687円 |
| | D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 10,974,561円 | 10,257,941円 |
| | ダイワ国内R E I Tインデック ス（投資一任専用） | 5,833,615円 | 409,244,215円 |
| | ダイワ・ノーロード J - R E I Tファンド | 80,451,279円 | 62,601,054円 |
| | ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス | 4,413,686,051円 | 5,702,650,498円 |
| | ダイワJ - R E I Tインデック ス（ダイワSMA専用） | 1,316,355,536円 | 1,197,200,099円 |
| | ダイワファンドラップオンライ ン J - R E I Tインデックス | 635,940,818円 | 670,868,095円 |
| | スタイル9（6資産分散・保守 型） | 78,153円 | 65,782円 |
| | スタイル9（6資産分散・バラ ンス型） | 3,016,134円 | 3,861,394円 |
| | スタイル9（6資産分散・積極 型） | 1,622,065円 | 2,073,000円 |
| | スタイル9（8資産分散・保守 型） | 106,132円 | 73,374円 |
| | スタイル9（8資産分散・バラ ンス型） | 2,184,396円 | 2,954,874円 |
| | スタイル9（8資産分散・積極 型） | 1,188,682円 | 4,571,537円 |
| | ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T | 676,226,243円 | 561,379,433円 |
| 計 | | 86,235,422,547円 | 64,556,516,313円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 86,235,422,547口 | 64,556,516,313口 |
| 3. | 2 差入委託証拠金代用有価証券 | 先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 679,000,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 858,000,000円 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p> |

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p> |

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|------|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 21,350,591,373 | 6,470,949,171 |
| 合計 | 21,350,591,373 | 6,470,949,171 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|-----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|----------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 不動産投信 指数先物取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 9,004,240,000 | - | 8,923,600,000 | 80,640,000 | 9,930,884,400 | - | 10,196,160,000 | 265,275,600 |
| 合計 | 9,004,240,000 | - | 8,923,600,000 | 80,640,000 | 9,930,884,400 | - | 10,196,160,000 | 265,275,600 |

(注)

1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|-----------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 3.0405円 | 3.9503円 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| (1万口当たり純資産額) | (30,405円) | (39,503円) |
|--------------|-----------|-----------|

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|------------|--------------------------|---------------|----------------|----|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート | 4,633 | 593,024,000 | |
| | サンケイリアルエステート | 6,706 | 699,435,800 | |
| | SOSILA物流リート投 | 10,445 | 1,286,824,000 | |
| | 東海道リート投資法 | 4,310 | 488,323,000 | |
| | 三井不動産アコモーションファン ド投資法人 | 36,142 | 4,806,886,000 | |
| | 森ヒルズリート | 24,230 | 3,607,847,000 | |
| | 産業ファンド | 38,329 | 5,757,015,800 | |
| | アドバンス・レジデンス | 43,106 | 7,332,330,600 | |
| | A P I 投資法人 | 32,321 | 4,531,404,200 | |
| | G L P 投資法人 | 68,881 | 10,091,066,500 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル | 10,614 | 3,502,620,000 | |
| | 日本プロロジスリート | 107,764 | 9,978,946,400 | |
| | 星野リゾート・リート | 8,411 | 2,131,347,400 | |
| | O n e リート投資法人 | 10,346 | 938,382,200 | |
| | イオンリート投資 | 25,420 | 3,454,578,000 | |
| | ヒューリックリート投資法 | 18,498 | 3,259,347,600 | |
| | 日本リート投資法人 | 26,725 | 2,693,880,000 | |
| | 積水ハウス・リート投資 | 61,792 | 5,382,083,200 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 4,551 | 660,350,100 | |
| | ヘルスケア&メディカル投資 | 5,433 | 629,684,700 | |
| | サムティ・レジデンシャル | 5,799 | 675,003,600 | |
| | 野村不動産マスターF | 66,708 | 11,447,092,800 | |
| | いちごホテルリート投資 | 3,464 | 434,385,600 | |
| | ラサールロジポート投資 | 27,139 | 4,252,681,300 | |
| スターアジア不動産投 | 38,577 | 2,360,912,400 | | |
| マリモ地方創生リート | 3,829 | 427,316,400 | | |
| 三井不ロジパーク | 46,225 | 5,537,755,000 | | |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------------|--|
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人 | 6,124 | 461,749,600 | |
| 投資法人みらい | 28,826 | 1,436,976,100 | |
| 三菱地所物流REIT | 21,320 | 2,799,316,000 | |
| CREロジスティクスファンド | 8,881 | 1,503,553,300 | |
| セントラル・リート投資法人 | 3,396 | 392,238,000 | |
| MIRARTH不動産投資法人 | 13,765 | 1,284,274,500 | |
| 霞ヶ関ホテルリート | 2,605 | 267,012,500 | |
| 日本ビルファンド | 124,188 | 17,858,234,400 | |
| ジャパンリアルエステイト | 107,516 | 14,073,844,400 | |
| 日本都市ファンド投資法人 | 108,702 | 13,348,605,600 | |
| オリックス不動産投資 | 83,422 | 8,784,336,600 | |
| 日本プライムリアルティ | 58,049 | 6,164,803,800 | |
| NTT都市開発リート投資法人 | 21,079 | 2,911,009,900 | |
| 東急リアル・エステート | 13,802 | 2,815,608,000 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 14,695 | 2,035,257,500 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 48,264 | 8,779,221,600 | |
| 森トラストリート投資法人 | 40,351 | 3,135,272,700 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 115,558 | 7,615,272,200 | |
| フロンティア不動産投資 | 36,792 | 3,476,844,000 | |
| 平和不動産リート | 16,077 | 2,499,973,500 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 41,502 | 4,278,856,200 | |
| 福岡リート投資法人 | 11,817 | 2,197,962,000 | |
| KDX不動産投資法人 | 61,043 | 10,761,880,900 | |
| いちごオフィスリート投資法人 | 15,108 | 1,460,943,600 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 8,552 | 3,202,724,000 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 9,981 | 1,655,847,900 | |
| スターツプロシード投資法人 | 3,499 | 702,599,200 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 65,905 | 9,312,376,500 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 77,029 | 6,555,167,900 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 30,650 | 3,435,865,000 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 17,552 | 2,653,862,400 | |
| 投資証券 合計 | | 244,822,013,400 | |
| 合計 | | 244,822,013,400 | |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターF

5,000口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2024年12月18日現在 金額（円） | 2025年12月18日現在 金額（円） |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 384,813,214 | 665,086,840 |
| コール・ローン | 477,425,849 | 272,012,023 |
| 投資信託受益証券 | 2,436,751,481 | 2,264,797,736 |
| 投資証券 | 44,581,526,801 | 55,593,406,331 |
| 派生商品評価勘定 | 10,905,213 | 4,384,207 |
| 未収入金 | 8,188,260 | 371,990 |
| 未収配当金 | 152,190,003 | 209,944,360 |
| 差入委託証拠金 | 458,266,664 | 427,228,888 |
| 流動資産合計 | 48,510,067,485 | 59,437,232,375 |
| 資産合計 | 48,510,067,485 | 59,437,232,375 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 11,154,736 | 2,476,297 |
| 未払金 | 70,119,584 | 88,348,122 |
| 未払解約金 | 22,453,000 | 61,533,600 |
| 流動負債合計 | 103,727,320 | 152,358,019 |
| 負債合計 | 103,727,320 | 152,358,019 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 11,802,580,977 | 13,900,892,178 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 36,603,759,188 | 45,383,982,178 |

| | | |
|---------|----------------|----------------|
| 元本等合計 | 48,406,340,165 | 59,284,874,356 |
| 純資産合計 | 48,406,340,165 | 59,284,874,356 |
| 負債純資産合計 | 48,510,067,485 | 59,437,232,375 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引 |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <p>3. 収益及び費用の計上基準</p> | <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 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。</p> <p>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。</p> |
| <p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 2023年12月19日 | 2024年12月19日 |
| 期首元本額 | 10,445,718,817円 | 11,802,580,977円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,291,480,579円 | 3,040,620,723円 |
| 期中一部解約元本額 | 934,618,419円 | 942,309,522円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワバランスファンド2023-01 | 81,228,434円 | -円 |
| (適格機関投資家専用) | | |

| | | |
|--|----------------|----------------|
| ダイワファンドラップ 外国REIT ITインデックス(為替ヘッジ なし) | 2,220,179,211円 | 3,316,225,048円 |
| ダイワファンドラップオンライ ン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし) | 348,458,085円 | 287,333,892円 |
| D-I's グローバルREIT インデックス | 1,418,982円 | 1,342,806円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 19,354,919円 | 23,142,505円 |
| iFree 外国REITイン デックス | 639,683,559円 | 573,870,747円 |
| iFree 8資産バランス グローバル・リート・インデッ クスファンド(資産形成型) | 2,505,567,342円 | 3,217,055,369円 |
| グローバル・リート・インデッ クスファンド(毎月決算型) | 399,772,618円 | 421,156,452円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 233,694,425円 | 209,665,275円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 3,988,687円 | 7,870,608円 |
| DCダイワ・グローバルREIT インデックスファンド | 4,465,154,844円 | 4,648,114,970円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 7,266,352円 | 7,817,949円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 8,113,100円 | 9,334,545円 |
| ダイワ海外REITインデック ス(為替ヘッジなし)(投資一 任専用) | 4,512,917円 | 333,776,743円 |
| ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用) | 128,911,402円 | 125,924,548円 |
| スタイル9(6資産分散・保守 型) | 36,802円 | 28,486円 |
| スタイル9(6資産分散・ balan ス型) | 1,875,063円 | 2,788,705円 |
| スタイル9(6資産分散・積極 型) | 1,571,462円 | 3,977,707円 |
| スタイル9(8資産分散・保守 型) | 45,990円 | 44,536円 |
| スタイル9(8資産分散・ balan ス型) | 1,219,504円 | 1,977,904円 |
| スタイル9(8資産分散・積極 型) | 1,269,394円 | 4,573,631円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT | 188,715,773円 | 154,881,294円 |
| ダイワ・ノーロード グローバル REITファンド | 61,268,444円 | 54,952,247円 |
| ダイワ外国REITインデック ス（為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用） | 241,581,630円 | 342,313,732円 |
| ダイワバランスファンド2023-08 （適格機関投資家専用） | 80,995,964円 | -円 |
| ダイワバランスファンド2024-01 （適格機関投資家専用） | 78,847,818円 | 76,761,976円 |
| ダイワバランスファンド2024-05 （適格機関投資家専用） | 77,848,256円 | 75,960,503円 |
| 計 | 11,802,580,977円 | 13,900,892,178円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 11,802,580,977口 | 13,900,892,178口 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|-------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|----------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資信託受益証券 | 113,934,008 | 30,706,910 |
| 投資証券 | 2,303,581,204 | 1,330,192,663 |
| 合計 | 2,417,515,212 | 1,360,899,573 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|------|---------------|-----------|-----|------|---------------|-----------|-----|------|
| | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | (円) | うち 1年超 | (円) | (円) | (円) | うち 1年超 | (円) | (円) |
| 市場取引 | | | | | | | | |

| | | | | | | | | |
|-----------------|---------------|---|---------------|------------|---------------|---|---------------|---------|
| 不動産投信 指数先物取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 1,454,680,152 | - | 1,443,525,416 | 11,154,736 | 1,488,216,878 | - | 1,488,043,017 | 173,861 |
| 合計 | 1,454,680,152 | - | 1,443,525,416 | 11,154,736 | 1,488,216,878 | - | 1,488,043,017 | 173,861 |

- (注) 1. 時価の算定方法
 不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
 原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

| 種類 | 2024年12月18日現在 | | | | 2025年12月18日現在 | | | |
|---------------|---------------|-----------|-------------|------------|---------------|-----------|-------------|-----------|
| | 契約額等 | うち 1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等 | うち 1年超 | 時価 | 評価損益 |
| | (円) | | (円) | (円) | (円) | | (円) | (円) |
| 市場取引以外の 取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 510,745,240 | - | 521,650,453 | 10,905,213 | 270,677,628 | - | 272,759,399 | 2,081,771 |
| アメリカ・ドル | 348,313,004 | - | 355,763,494 | 7,450,490 | 61,052,326 | - | 61,055,571 | 3,245 |
| ユーロ | 162,432,236 | - | 165,886,959 | 3,454,723 | 209,625,302 | - | 211,703,828 | 2,078,526 |
| 合計 | 510,745,240 | - | 521,650,453 | 10,905,213 | 270,677,628 | - | 272,759,399 | 2,081,771 |

- (注) 1. 時価の算定方法
 (1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 4,1013円 | 4,2648円 |
| (1万口当たり純資産額) | (41,013円) | (42,648円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|---------|---------------------------------------|---------|-----------------------------------|----|
| 投資信託 受益証券 | アメリカ・ドル | VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND;ET | 162,800 | 14,554,320.000 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | | 14,554,320.000 (2,264,797,736) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | | 2,264,797,736 [2,264,797,736] | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST REIT | 28,059 | 322,397.910 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 29,767 | 584,623.880 | |
| | | XENIA HOTELS RESORTS REIT INC | 22,665 | 343,148.100 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC | 33,652 | 6,099,761.520 | |

| | | | |
|--|---------|----------------|--|
| SIMON PROPERTY GROUP REIT INC | 77,259 | 14,232,652.980 | |
| BXP INC | 34,855 | 2,423,816.700 | |
| APARTMENT INVESTMENT AND MANAGEMENT | 30,987 | 177,245.640 | |
| VORNADO REALTY TRUST REIT | 38,173 | 1,305,516.600 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 10,185 | 225,597.750 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 16,707 | 479,825.040 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 5,042 | 146,066.740 | |
| EQUITY RESIDENTIAL REIT | 82,239 | 5,097,173.220 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 52,155 | 642,549.600 | |
| EPR PROPERTIES REIT | 18,012 | 895,736.760 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 8,863 | 61,597.850 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 47,025 | 402,063.750 | |
| EQUINIX REIT INC | 23,158 | 17,319,405.040 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY INC TRUST | 24,720 | 579,684.000 | |
| CHATHAM LODGING TRUST REIT | 11,068 | 77,918.720 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES REIT | 14,908 | 1,469,630.640 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 5,779 | 91,886.100 | |
| BRAEMAR HOTELS RESORTS INC | 13,415 | 37,696.150 | |
| HOST HOTELS & RESORTS REIT INC | 151,311 | 2,809,845.270 | |
| AMERICAN HOMES RENT REIT CLASS A | 77,107 | 2,468,966.140 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES REIT INC | 12,811 | 141,049.110 | |
| RLJ LODGING TRUST REIT | 34,476 | 267,189.000 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 9,424 | 98,198.080 | |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES REIT INC | 18,118 | 126,463.640 | |
| KIMCO REALTY REIT CORP | 160,252 | 3,277,153.400 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 2,842 | 101,118.360 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS | 83,204 | 1,423,620.440 | |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|---------------|--|
| WHITESTONE REIT | 10,377 | 142,476.210 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT | 66,971 | 3,046,510.790 | |
| PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A | 29,463 | 250,730.130 | |
| PARK HOTELS RESORTS INC | 47,307 | 518,011.650 | |
| INVITATION HOMES INC | 133,457 | 3,651,383.520 | |
| OUTFRONT MEDIA INC | 34,428 | 843,830.280 | |
| LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A | 20,540 | 2,664,859.600 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 14,606 | 252,099.560 | |
| ALEXANDER AND BALDWIN INC | 17,216 | 360,503.040 | |
| GLADSTONE LAND REIT CORP | 7,606 | 67,237.040 | |
| AMERICOLD REALTY INC TRUST | 67,394 | 851,186.220 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TR | 14,128 | 77,562.720 | |
| VICI PPTYS INC | 252,345 | 7,164,074.550 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 2,485 | 37,548.350 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES I | 6,631 | 387,449.330 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST | 46,888 | 1,433,366.160 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 10,543 | 230,259.120 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 44,756 | 783,677.560 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES REIT INC | 25,056 | 129,539.520 | |
| AMERICAN ASSETS TRUST REIT INC | 10,915 | 208,258.200 | |
| INDEPENDENCE REALTY INC TRUST | 55,237 | 948,419.290 | |
| PARAMOUNT GROUP REIT INC | 43,809 | 288,701.310 | |
| EMPIRE STATE REALTY REIT INC TRUST | 32,724 | 221,541.480 | |
| NETSTREIT CORP | 19,752 | 346,450.080 | |
| CTO REALTY GROWTH INC | 6,775 | 122,356.500 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY REIT INC | 55,877 | 2,302,132.400 | |
| STAG INDUSTRIAL REIT INC | 44,180 | 1,656,308.200 | |

| | | | |
|------------------------------------|---------|----------------|--|
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 2,814 | 47,472.180 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A | 5,340 | 85,440.000 | |
| PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC | 29,722 | 1,078,016.940 | |
| ORION PROPERTIES INC | 11,711 | 24,124.660 | |
| DIGITAL CORE REIT UNITS | 210,100 | 106,100.500 | |
| VENTAS REIT INC | 107,546 | 8,485,379.400 | |
| CARETRUST REIT INC | 52,132 | 1,894,476.880 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 18,365 | 533,870.550 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP REIT INC | 72,435 | 1,879,688.250 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 56,744 | 1,069,624.400 | |
| UMH PROPERTIES INC | 19,093 | 309,879.390 | |
| CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC | 3,566 | 134,402.540 | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE T | 7,905 | 33,675.300 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E | 7,600 | 108,528.000 | |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES | 3,506 | 91,261.180 | |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 39,891 | 1,900,008.330 | |
| LINEAGE INC | 13,534 | 470,983.200 | |
| MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C | 2,112 | 31,489.920 | |
| SILA RLTY TR INC TRUST | 13,053 | 306,484.440 | |
| CURLINE PROPERTIES | 22,906 | 531,648.260 | |
| FRONTVIEW REIT INC | 4,624 | 71,255.840 | |
| MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A | 36,486 | 1,086,553.080 | |
| SMARTSTOP SELF STORAGE REIT INC | 7,300 | 235,571.000 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 69,891 | 5,548,646.490 | |
| TERRENO REALTY REIT CORP | 24,445 | 1,487,967.150 | |
| SUN COMMUNITIES REIT INC | 27,840 | 3,455,779.200 | |
| ACADIA REALTY TRUST REIT | 31,003 | 628,430.810 | |
| ALEXANDERS REIT INC | 496 | 108,777.760 | |
| PROLOGIS REIT INC | 219,616 | 28,126,221.120 | |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|----------------|--|
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES RE | 36,836 | 1,751,920.160 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST REIT | 39,261 | 119,746.050 | |
| SAUL CENTERS REIT INC | 2,809 | 90,168.900 | |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 19,219 | 284,441.200 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST REIT | 25,286 | 2,725,577.940 | |
| COUSINS PROPERTIES REIT INC | 39,748 | 998,469.760 | |
| SITE CENTERS CORP | 11,854 | 75,865.600 | |
| EASTGROUP PROPERTIES REIT INC | 12,603 | 2,300,173.530 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC | 15,241 | 4,000,000.450 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 31,332 | 1,836,055.200 | |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST RE | 18,577 | 1,889,280.900 | |
| GETTY REALTY REIT CORP | 12,321 | 352,380.600 | |
| WELLTOWER INC | 158,270 | 29,938,353.200 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 164,446 | 2,696,914.400 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES REIT INC | 25,574 | 655,205.880 | |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 36,597 | 68,436.390 | |
| KILROY REALTY REIT CORP | 25,754 | 1,003,118.300 | |
| LTC PROPERTIES REIT INC | 10,869 | 374,980.500 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 13,999 | 700,509.960 | |
| MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 27,704 | 3,797,941.360 | |
| MACERICH REIT | 59,811 | 1,098,129.960 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I | 45,858 | 2,866,583.580 | |
| NATIONAL HEALTH INVESTORS REIT INC | 11,234 | 871,309.040 | |
| NNN REIT INC | 44,673 | 1,817,297.640 | |
| REALTY INCOME REIT CORP | 216,361 | 12,497,011.360 | |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 26,666 | 778,113.880 | |
| PUBLIC STORAGE REIT | 37,367 | 9,983,341.390 | |
| REGENCY CENTERS REIT CORP | 38,666 | 2,631,221.300 | |
| SAFEHOLD INC | 10,867 | 149,638.590 | |
| TANGER INC | 26,781 | 917,784.870 | |

| | | | | |
|----------|------------------------------------|---------|-------------------------------------|--|
| | SL GREEN REALTY REIT CORP | 16,807 | 748,919.920 | |
| | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 51,415 | 255,532.550 | |
| | UDR REIT INC | 71,353 | 2,597,962.730 | |
| | UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRU | 3,020 | 128,591.600 | |
| | W. P. CAREY REIT INC | 51,822 | 3,376,203.300 | |
| | ELME | 20,862 | 363,207.420 | |
| | AGREE REALTY REIT CORP | 26,142 | 1,886,668.140 | |
| | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN | 69,809 | 3,107,198.590 | |
| | CUBESMART REIT | 53,962 | 1,953,964.020 | |
| | SUNSTONE HOTEL INVESTORS REIT INC | 44,954 | 414,475.880 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST REIT INC | 75,863 | 11,257,310.570 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE REIT INC | 50,228 | 6,624,068.640 | |
| | CENTERSPACE | 3,965 | 260,222.950 | |
| | KITE REALTY GROUP TRUST REIT | 52,027 | 1,237,722.330 | |
| | ONE LIBERTY PROPERTIES REIT INC | 3,782 | 81,199.540 | |
| | GLADSTONE COMMERCIAL REIT CORP | 10,524 | 116,079.720 | |
| | DIAMONDROCK HOSPITALITY | 48,500 | 451,535.000 | |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST REIT INC | 116,640 | 583,200.000 | |
| | FRANKLIN STREET PROPERTIES REIT CO | 16,005 | 15,931.370 | |
| | DOUGLAS EMMETT REIT INC | 39,624 | 448,939.920 | |
| | MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT | 341,662 | 25,282.980 | |
| | EAGLE HOSPITALITY TRUST UNITS | 90,000 | 0.000 | |
| | PRIME US REIT UNITS | 201,020 | 39,399.920 | |
| アメリカ・ドル | 小計 | | 277,831,416.690 (43,233,346,751) | |
| イギリス・ポンド | HELICAL PLC | 26,359 | 48,816.860 | |

| | | | | |
|----------------|---------------------------------------|---------|-----------------------------------|--|
| | LIFE SCIENCE REIT PLC | 74,423 | 29,173.810 | |
| | HAMMERSON REIT PLC | 126,038 | 393,490.630 | |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 154,019 | 117,054.440 | |
| | CLS HOLDINGS PLC | 29,656 | 17,615.660 | |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 118,918 | 87,285.810 | |
| | REGIONAL REIT LTD | 28,650 | 29,223.000 | |
| | NEWRIVER REIT PLC | 82,735 | 56,259.800 | |
| | SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 463,820 | 640,071.600 | |
| | CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC | 109,917 | 90,131.940 | |
| | THE PRS REIT PLC | 121,010 | 137,951.400 | |
| | SOCIAL HOUSING REIT PLC | 80,355 | 54,159.270 | |
| | TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 147,287 | 142,868.390 | |
| | AEW UK REIT PLC | 37,621 | 40,781.160 | |
| | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 295,943 | 236,754.400 | |
| | HOME REIT PLC | 117,587 | 0.000 | |
| | LAND SECURITIES GROUP REIT PLC | 176,902 | 1,054,335.920 | |
| | SEGRE REIT PLC | 321,412 | 2,251,812.470 | |
| | UNITE GROUP PLC | 98,781 | 535,886.920 | |
| | BRITISH LAND REIT PLC | 237,410 | 914,978.140 | |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 96,457 | 296,122.990 | |
| | DERWENT LONDON REIT PLC | 26,666 | 447,188.820 | |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES REIT PLC | 591,856 | 576,171.810 | |
| | WORKSPACE GROUP REIT PLC | 34,342 | 133,246.960 | |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 51,885 | 367,086.370 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 46,726 | 472,867.120 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY REIT PLC | 556,368 | 1,033,175.370 | |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TR | 116,149 | 62,372.010 | |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 589,084 | 869,487.980 | |
| | イギリス・ポンド 小計 | | 11,136,371.050 (2,317,590,180) | |
| イスラエル・ シュケル | MENIVIM THE NEW REIT LTD | 184,093 | 428,936.690 | |
| | SELLA CAPTIAL REAL ESTATE LTD | 59,093 | 696,706.470 | |

| | | | | |
|----------------------------|------------------------------------|---------------|--------------------------------|--|
| | REIT REIT LTD | 48,408 | 1,301,207.040 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | | 2,426,850.200 (116,522,057) | |
| オーストラリア・ドル | DEXUS STAPLED UNITS | 262,137 | 1,853,308.590 | |
| | HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI | 102,584 | 77,450.920 | |
| | ABACUS STORAGE KING UNITS | 95,523 | 148,538.260 | |
| | DIGICO INFRASTRUCTURE REIT STAPLED | 99,887 | 252,714.110 | |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE | 79,206 | 240,786.240 | |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP STAPLED UN | 393,014 | 186,681.650 | |
| | CENTURIAIndustr UNITS | 129,698 | 433,191.320 | |
| | RURAL FUND GROUP STAPLED UNITS | 94,616 | 192,070.480 | |
| | WAYPOINT REIT STAPLED UNIT LTD | 162,644 | 427,753.720 | |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT STAPLE | 158,767 | 646,181.690 | |
| | CENTURIA OFFICE REIT UNITS | 95,063 | 105,995.240 | |
| | CENTURIA CAPITAL STAPLED UNITS | 201,886 | 430,017.180 | |
| | HOMECO DAILY NEEDS UNITS | 454,662 | 631,980.180 | |
| | REGION GROUP STAPLED UNITS LTD | 285,553 | 699,604.850 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA R | 66,009 | 165,022.500 | |
| | NATIONAL STORAGE REIT STAPLED UNIT | 336,196 | 934,624.880 | |
| | DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT | 60,260 | 162,702.000 | |
| | SCENTRE GROUP UNIT | 1,279,581 | 5,323,056.960 | |
| | ARENA REIT STAPLED UNITS | 97,295 | 345,397.250 | |
| | BWP GROUP STAPLED UNITS TRUST | 140,354 | 557,205.380 | |
| GPT GROUP STAPLED UNITS | 470,612 | 2,597,778.240 | | |
| CHARTER HALL RETAIL UNITS | 122,744 | 494,658.320 | | |
| MIRVAC GROUP STAPLED UNITS | 968,149 | 1,984,705.450 | | |

| | | | | |
|---------------|------------------------------------|---------|-----------------------------------|--|
| | STOCKLAND STAPLED UNITS LTD | 592,485 | 3,483,811.800 | |
| | ABACUS GROUP UNIT | 100,940 | 121,128.000 | |
| | GOODMAN GROUP UNITS | 504,919 | 14,481,076.920 | |
| | VICINITY CENTRES | 958,310 | 2,405,358.100 | |
| | CHARTER HALL GROUP STAPLED UNITS | 117,647 | 2,983,527.920 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP STAPLED | 101,016 | 522,252.720 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | 42,888,580.870 (4,405,515,027) | |
| カナダ・ドル | NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS | 8,200 | 65,108.000 | |
| | PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN | 12,996 | 200,398.320 | |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,230 | 89,840.000 | |
| | SLATE GROCERY REIT UNITS CLASS U | 6,800 | 103,360.000 | |
| | KILLAM APARTMENT REIT UNITS CLASS | 14,321 | 236,296.500 | |
| | MINTO APARTMENT REIT UNITS TRUST | 3,900 | 52,026.000 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES RE | 29,539 | 151,535.070 | |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT STA | 7,352 | 587,498.320 | |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES | 34,643 | 435,462.510 | |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT T | 16,565 | 218,658.000 | |
| | FIRST CAPITAL REALTY REAL ESTATE I | 25,854 | 488,382.060 | |
| | CHOICE PROPERTIES REAL ESTATE INVE | 39,833 | 585,545.100 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIA | 3,800 | 66,386.000 | |
| | CT REIT UNITS TRUST | 13,300 | 212,667.000 | |
| | SMARTCENTRES RL ESTATE INVESTMENT | 17,612 | 449,986.600 | |
| | CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL | 19,089 | 713,355.930 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------|--------------------------------|--|
| | HANDR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 31,903 | 332,110.230 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 35,781 | 659,443.830 | |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE UNITS TRU | 1,650 | 28,363.500 | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT T | 5,845 | 375,950.400 | |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 13,291 | 203,883.940 | |
| | ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVT | 15,524 | 201,501.520 | |
| カナダ・ドル 小計 | | | 6,457,758.830 (728,887,239) | |
| シンガポール・ ドル | KEPPEL DC REIT | 495,883 | 1,090,942.600 | |
| | AIMS APAC REIT | 158,100 | 233,988.000 | |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRU | 731,090 | 723,779.100 | |
| | SASSEUR REIT UNITS TRUST | 132,500 | 89,437.500 | |
| | LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT U | 548,940 | 334,853.400 | |
| | EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TR | 36,500 | 0.000 | |
| | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 948,477 | 2,617,796.520 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T | 1,433,222 | 3,325,075.040 | |
| | SUNTEC REIT UNITS TRUST | 547,400 | 766,360.000 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST UNITS | 846,700 | 1,083,776.000 | |
| | KEPPEL REIT UNITS | 598,300 | 583,342.500 | |
| | CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU | 673,756 | 626,593.080 | |
| | ESR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U | 137,250 | 373,320.000 | |
| | CDL HOSPITALITY REIT UNITS | 192,000 | 159,360.000 | |
| FRASERS CENTREPOINT UNITS TRUST | 347,401 | 792,074.280 | | |
| STARHILL GLOBAL REIT UNITS TRUST | 370,700 | 213,152.500 | | |

| | | | | |
|-------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------------|--|
| | CAPITALAND CHINA TRUST | 286,542 | 222,070.050 | |
| | PARKWAY LIFE REIT TRUST | 108,400 | 434,684.000 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL UNITS TRUST | 530,769 | 1,072,153.380 | |
| | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS | 562,684 | 810,264.960 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST STAPLED | 259,700 | 158,417.000 | |
| | OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 574,500 | 203,947.500 | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | 15,915,387.410 (1,918,122,491) | |
| ニュージーランド・ドル | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST UN | 114,617 | 228,660.910 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST UNITS | 260,219 | 506,125.950 | |
| ニュージーランド・ドル 小計 | | | 734,786.860 (65,954,468) | |
| ユーロ | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 9,654 | 248,107.800 | |
| | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 6,720 | 194,544.000 | |
| | STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST | 79,220 | 126,752.000 | |
| | VASTNED BELGIUM NV | 1,666 | 51,812.600 | |
| | ASCENCIO SA | 1,209 | 62,626.200 | |
| | HAMBORNER REIT N AG | 14,966 | 66,299.380 | |
| | WERELDHAVE NV | 8,167 | 154,682.980 | |
| | UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS | 26,459 | 2,430,523.740 | |
| | NSI NV | 2,915 | 55,909.700 | |
| | ICADE REIT SA | 6,604 | 137,495.280 | |
| | CARMILA SA | 13,783 | 232,381.380 | |
| | ALTAREA | 1,418 | 155,980.000 | |
| | GECINA SA | 11,340 | 898,695.000 | |
| | KLEPIERRE REIT SA | 48,000 | 1,601,280.000 | |
| | COVIVIO SA | 11,886 | 644,221.200 | |
| | MERCIALYS REIT SA | 20,402 | 213,812.960 | |
| | AEDIFICA NV | 10,333 | 678,878.100 | |
| COFINIMMO REIT SA | 8,279 | 635,413.250 | | |
| RETAIL ESTATES NV | 2,730 | 171,444.000 | | |

| | | | | | |
|-----------|---------------------------------------|---------|------------------------------------|------------------------------------|--|
| | WAREHOUSES DE PAUW NV | 40,952 | 878,010.880 | | |
| | CARE PROPERTY INV NV | 9,186 | 101,597.160 | | |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 8,422 | 235,816.000 | | |
| | MONTEA NV | 4,571 | 321,341.300 | | |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE S | 11,463 | 38,687.620 | | |
| | COLONIAL SFL SOCIMI SA | 73,617 | 382,072.230 | | |
| | MERLIN PROPERTIES REIT SA | 86,977 | 1,033,286.760 | | |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES PLC | 113,966 | 105,988.380 | | |
| ユーロ 小計 | | | 11,857,659.900 (2,166,275,887) | | |
| 韓国・ウォン | SK REITS LTD | 46,181 | 271,082,470.000 | | |
| | HANWHA REIT LTD | 29,479 | 119,242,555.000 | | |
| | SHINHAN ALPHA REIT LTD | 25,479 | 140,898,870.000 | | |
| | LOTTE REIT LTD | 35,235 | 138,649,725.000 | | |
| | IGIS VALUE PLUS REIT LTD | 16,285 | 68,478,425.000 | | |
| | JR GLOBAL | 41,466 | 119,422,080.000 | | |
| | KLI REIT LTD | 13,694 | 58,541,850.000 | | |
| | ESR KENDALL SQUARE REIT LTD | 44,693 | 188,827,925.000 | | |
| 韓国・ウォン 小計 | | | 1,105,143,900.000 (116,482,167) | | |
| 香港・ドル | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 638,000 | 555,060.000 | | |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 181,000 | 416,300.000 | | |
| | FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 367,000 | 1,798,300.000 | | |
| | PROSPERITY REAL ESTATE INVESTMENT | 303,000 | 433,290.000 | | |
| | LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 641,874 | 21,990,603.240 | | |
| | CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT TR | 455,000 | 1,041,950.000 | | |
| | 香港・ドル 小計 | | | 26,235,503.240 (524,710,064) | |
| | 投資証券 合計 | | | 55,593,406,331 [55,593,406,331] | |
| 合計 | | | 57,858,204,067 [57,858,204,067] | | |

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資信託 受益証券 時価比率 | 組入 投資証券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|-------------|--------------|----------------------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 投資信託受益証券 1銘柄 | 5.0% | 95% | 78.7% |
| | 投資証券 140銘柄 | | | |
| イギリス・ポンド | 投資証券 29銘柄 | -% | 100% | 4.0% |
| イスラエル・シケル | 投資証券 3銘柄 | -% | 100% | 0.2% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 29銘柄 | -% | 100% | 7.6% |
| カナダ・ドル | 投資証券 22銘柄 | -% | 100% | 1.3% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 22銘柄 | -% | 100% | 3.3% |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 2銘柄 | -% | 100% | 0.1% |
| ユーロ | 投資証券 27銘柄 | -% | 100% | 3.7% |
| 韓国・ウォン | 投資証券 8銘柄 | -% | 100% | 0.2% |
| 香港・ドル | 投資証券 6銘柄 | -% | 100% | 0.9% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2024年12月18日現在 金額 (円) | 2025年12月18日現在 金額 (円) |
|------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |

| | | | |
|-----------------|---|-------------|-------------|
| コール・ローン | | 5,111,467 | 4,842,883 |
| 国債証券 | | 527,947,150 | 652,788,800 |
| 未収利息 | | 157,545 | 1,146,893 |
| 前払費用 | | 115,729 | 739,081 |
| 流動資産合計 | | 533,331,891 | 659,517,657 |
| 資産合計 | | 533,331,891 | 659,517,657 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払解約金 | | - | 94,800 |
| 流動負債合計 | | - | 94,800 |
| 負債合計 | | - | 94,800 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 514,496,492 | 635,968,648 |
| 剰余金 | | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 18,835,399 | 23,454,209 |
| 元本等合計 | | 533,331,891 | 659,422,857 |
| 純資産合計 | | 533,331,891 | 659,422,857 |
| 負債純資産合計 | | 533,331,891 | 659,517,657 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|----|---------------|---------------|
|----|---------------|---------------|

| | | | |
|----|------------------------|--------------|--------------|
| 1. | 1 期首 | 2023年12月19日 | 2024年12月19日 |
| | 期首元本額 | 438,719,306円 | 514,496,492円 |
| | 期中追加設定元本額 | 156,102,799円 | 193,695,817円 |
| | 期中一部解約元本額 | 80,325,613円 | 72,223,661円 |
| | 期末元本額の内訳 | | |
| | ファンド名 | | |
| | DCダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 89,130,290円 | 109,021,210円 |
| | DCダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 8,503,653円 | 17,181,908円 |
| | DCダイワ・ターゲットイヤー 2020 | 70,567,206円 | 65,495,139円 |
| | DCダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 242,410,057円 | 290,700,908円 |
| | DCダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 103,885,286円 | 153,569,483円 |
| | 計 | 514,496,492円 | 635,968,648円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 514,496,492口 | 635,968,648口 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自2024年12月19日 至2025年12月18日 |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025年12月18日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 2,109,630 | 2,798,450 |
| 合計 | 2,109,630 | 2,798,450 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|---------------|---------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(1口当たり情報)

| | 2024年12月18日現在 | 2025年12月18日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0366円 | 1.0369円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,366円) | (10,369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 | 468 2年国債 | 3,000,000 | 2,992,290 | |
| | 469 2年国債 | 4,000,000 | 3,992,880 | |
| | 470 2年国債 | 32,000,000 | 31,975,040 | |
| | 473 2年国債 | 19,000,000 | 18,957,820 | |
| | 152 5年国債 | 61,000,000 | 60,408,300 | |
| | 153 5年国債 | 61,000,000 | 60,141,730 | |
| | 154 5年国債 | 60,000,000 | 59,049,000 | |
| | 155 5年国債 | 72,000,000 | 70,940,160 | |
| | 156 5年国債 | 16,000,000 | 15,733,120 | |
| | 161 5年国債 | 49,000,000 | 48,039,600 | |
| | 163 5年国債 | 58,000,000 | 56,869,000 | |
| | 350 10年国債 | 5,000,000 | 4,892,350 | |
| | 352 10年国債 | 5,000,000 | 4,862,450 | |
| | 97 20年国債 | 14,000,000 | 14,287,000 | |
| | 98 20年国債 | 17,000,000 | 17,319,090 | |
| | 99 20年国債 | 6,000,000 | 6,125,340 | |
| | 100 20年国債 | 60,000,000 | 61,502,400 | |
| | 101 20年国債 | 16,000,000 | 16,470,880 | |
| | 104 20年国債 | 13,000,000 | 13,321,230 | |
| 106 20年国債 | 14,000,000 | 14,407,680 | | |
| 108 20年国債 | 69,000,000 | 70,501,440 | | |
| 国債証券 合計 | | | 652,788,800 | |
| 合計 | | | 652,788,800 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年12月30日

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,437,268,940円 |
| 負債総額 | 3,497,334円 |
| 純資産総額(-) | 1,433,771,606円 |
| 発行済数量 | 484,902,456口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 2.9568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

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

| | |
|-----------------|------------------|
| 資産総額 | 920,890,694,269円 |
| 負債総額 | 172,248,656円 |
| 純資産総額(-) | 920,718,445,613円 |
| 発行済数量 | 106,817,691,292口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 8.6195円 |

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

| | |
|-----------------|------------------|
| 資産総額 | 256,464,727,683円 |
| 負債総額 | 899,598,600円 |
| 純資産総額（ - ） | 255,565,129,083円 |
| 発行済数量 | 64,063,977,774口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 3.9892円 |

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 60,935,468,399円 |
| 負債総額 | 391,835,871円 |
| 純資産総額（ - ） | 60,543,632,528円 |
| 発行済数量 | 13,970,089,281口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 4.3338円 |

(参考) ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

| | |
|-----------------|--------------|
| 資産総額 | 670,469,886円 |
| 負債総額 | 3,914,880円 |
| 純資産総額（ - ） | 666,555,006円 |
| 発行済数量 | 643,796,106口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.0354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

| | |
|------------|------------------|
| 資産総額 | 393,781,029,381円 |
| 負債総額 | 42,214,925円 |
| 純資産総額（ - ） | 393,738,814,456円 |
| 発行済数量 | 96,567,012,315口 |

1 単位当たり純資産額 (/)

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

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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年間ににおける資本金の額の増減：2024年10月1日262億5,026万9,396円増加しました。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を審議・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 | 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 |
| 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 | | | | | 株主資本 合計 |
|-------------------------|--------|--------|-------|-----------------------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | 利益準備金 | その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | |
| 当期首残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 11,505 | 11,879 | 38,549 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △ 10,316 | △ 10,316 | △ 10,316 |
| 当期純利益 | - | - | - | 11,859 | 11,859 | 11,859 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 1,543 | 1,543 | 1,543 |
| 当期末残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 13,048 | 13,422 | 40,092 |

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

(単位:百万円)

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

リースに関する会計基準等

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

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

(1)概要

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

(2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取利息」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた93百万円は、「受取利息」4百万円、「その他」89百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

| | 前事業年度 (2024年3月31日) | 当事業年度 (2025年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物 | 39百万円 | 40百万円 |
| 器具備品 | 308百万円 | 269百万円 |

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2024年3月31日)

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

当事業年度(2025年3月31日)

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

(損益計算書関係)

1 投資有価証券売却益の項目

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

2 固定資産売却益の項目

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

3 固定資産売却損の項目

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 剰余金の配当の 総額(百万円) | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----|-------|--------------------|-----------------|-----|-------|
| | | | | | |

| | | | | | |
|----------------------|------|--------|-------|----------------|----------------|
| 2023年6月26日 定時株主総会 | 普通株式 | 10,316 | 3,955 | 2023年 3月31日 | 2023年 6月27日 |
|----------------------|------|--------|-------|----------------|----------------|

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

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

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

| | 当事業年度期首 株式数 | 当事業年度 増加株式数 | 当事業年度 減少株式数 | 当事業年度末 株式数 |
|-------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 2,608 | 652 | - | 3,260 |
| 合計 | 2,608 | 652 | - | 3,260 |

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2025年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| | |
|-----------|------------|
| 剰余金の配当の総額 | 16,551百万円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 5,076円 |
| 基準日 | 2025年3月31日 |
| 効力発生日 | 2025年6月20日 |

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(2024年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

当事業年度(2025年3月31日)

(1)時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

| | 貸借対照表計上額 | | | |
|--------------|----------|-------|------|--------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 有価証券及び投資有価証券 | 2,230 | 7,968 | - | 10,199 |
| 資産合計 | 2,230 | 7,968 | - | 10,199 |

(2)時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

| 区分 | 前事業年度 | 当事業年度 |
|--------|-------|-------|
| 非上場株式 | 666 | 342 |
| 子会社株式 | 1,448 | 1,386 |
| 関連会社株式 | 2,027 | 2,027 |

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2024年3月31日)

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

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、記載していません。

2.その他有価証券

前事業年度(2024年3月31日)

| | 貸借対照表計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|--|-------------------|---------------|-------------|
| | | | |

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

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

当事業年度(2025年3月31日)

| | 貸借対照表計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|----------------------|-------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| (1)株式 | 120 | 55 | 65 |
| (2)その他 | 7,230 | 5,161 | 2,068 |
| 小計 | 7,350 | 5,216 | 2,134 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 2,848 | 3,020 | 172 |
| 小計 | 2,848 | 3,020 | 172 |
| 合計 | 10,199 | 8,236 | 1,962 |

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

| 種類 | 売却額 (百万円) | 売却益の合計額 (百万円) | 売却損の合計額 (百万円) |
|--------|--------------|------------------|------------------|
| (1)株式 | 704 | 380 | - |
| (2)その他 | | | |
| 証券投資信託 | 3,039 | 387 | 176 |
| 合計 | 3,744 | 767 | 176 |

4. 減損処理を行った有価証券

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注)その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度187百万円、当事業年度191百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

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

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

前事業年度(2024年3月31日)

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

当事業年度(2025年3月31日)

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

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 | ㈱かんぼ 生命保険 | 東京都 千代田 区 | 500,000 | 生命保 険業 | 被所有 20.0 | あり | 投資顧 問契約 の締結 | 投資顧問 報酬 (注2) | 215 | - | - |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

| 属性 | 会社等の 名称 | 所在地 | 資本金又 は出資金 (百万円) | 事業の 内容 | 議決権等 の所有(被 所有)割合 (%) | 関係内容 | | 取引の内 容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残 高 (百万 円) |
|-----|--|-----------|-----------------------|-----------------|-------------------------------|----------------|------------|-------------|---------------|----|-----------------------|
| | | | | | | 役員 の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商 品取引 業 | 所有 直接100.0 | なし | 経営管 理 | 債務保証 (注) | 2,354 | - | - |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

| 属性 | 会社等の 名称 | 所在地 | 資本金又 は出資金 (百万円) | 事業の 内容 | 議決権等 の所有(被 所有)割合 (%) | 関係内容 | | 取引の内 容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残 高 (百万 円) |
|-----|--|-----------|-----------------------|-----------------|-------------------------------|----------------|------------|-------------|---------------|----|-----------------------|
| | | | | | | 役員 の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商 品取引 業 | 所有 直接100.0 | なし | 経営管 理 | 債務保証 (注) | 2,341 | - | - |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

| 属性 | 会社等 の 名称 | 所在地 | 資本金又 は出資金 (百万円) | 事業の 内容 | 議決権等 の所有(被 所有)割合 (%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (百万円) (注1) | 科目 | 期末残高 (百万円) |
|-------------------------|----------------|-----------------|-----------------------|-------------|-------------------------------|----------------|-----------------------------|------------------------------|-----------------------|-----------------|---------------|
| | | | | | | 役員 の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 同一の 親会社 をもつ 会社 | 大和証 券(株) | 東京都 千代田 区 | 100,000 | 金融商品 取引業 | - | なし | 証券投資 信託受益 証券の募 集販売 | 証券投資信 託の代行手 数料 (注2) | 13,749 | 未払手 数料 | 3,491 |
| | | | | | | | 本社ビル の管理 | 不動産の賃 借料(注3) | 1,030 | 長期差 入保証 金 | 1,010 |

| | | | | | | | | | | | |
|-------------|---------|--------|-------|---------|---|----|--------------|------------------|-----|------|----|
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)大和総研 | 東京都江東区 | 3,898 | 情報サービス業 | - | なし | ソフトウェアの開発・保守 | ソフトウェアの購入・保守(注4) | 902 | 未払費用 | 87 |
|-------------|---------|--------|-------|---------|---|----|--------------|------------------|-----|------|----|

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額(百万円)(注1) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-------------|---------|---------|---------------|---------|-------------------|--------|----------------------------|---------------------------------|-----------------|------------------|----------------|
| | | | | | | 役員の兼任等 | 事業上の関係 | | | | |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株) | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | - | なし | 証券投資信託受益証券の募集販売 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 | (株)大和総研 | 東京都江東区 | 3,898 | 情報サービス業 | - | なし | ソフトウェアの開発・保守 | ソフトウェアの購入・保守(注4) | 857 | 未払費用 | 77 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1 株当たり情報)

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

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

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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 | | | | | 株主資本 合計 |
|---------------------------|--------|--------|-------|--------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | 利益剰余金 | | | |
| | | 資本準備金 | 利益準備金 | その他利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | |
| | | | | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 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。

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 | | | 合計 |
|--------------|------------|--------|------|--------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | |
| 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

大和かんぼ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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

| 当中間会計期間 (自 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。

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

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

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

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

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2025年3月31日、株式会社大和証券グループ本社、株式会社かんぼ生命保険、三井物産株式会社、三井物産かんぼ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ぼオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化いたしました。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

| | 名 称 | 資本金の額 (2025年03月末日現在) | 事業の内容 | 備考 |
|---------|-------------------|-------------------------|-------|----|
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037百万円 | (注6) | |
| 再信託受託会社 | 株式会社日本カスト ディ銀行 | 51,000百万円 | (注6) | |
| 販売会社 | 大和証券株式会社 | 100,000百万円 | (注1) | |
| | 東海東京証券株式会社 | 6,000百万円 | (注1) | |
| | 第一生命保険株式会社 | 60,000百万円 | (注9) | |
| | 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065百万円 | (注3) | |

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

独立監査人の監査報告書

2025年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋山 範之指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2050の2024年12月19日から2025年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2050の2025年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年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、継続企業的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。