

iFree 年金バランス

追加型投信／内外／資産複合
※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2024年2月28日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「iFree 年金バランス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2024年2月27日に関東財務局長に提出しており、2024年2月28日にその届出の効力が生じております。

発行者名	大和アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長 小松 幹太
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

i F r e e 年金バランス

(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わないものとします。

(3)【発行（売出）価額の総額】

10 兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1 万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2024 年 2 月 28 日から 2024 年 8 月 29 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、国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
---------	-----	---

	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MR F（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MR F
	E T F	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、3,000 億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。



SIMPLE & EASY

どんなファンド?

FREE & LOW

費用はどれくらいかかるのかな?

これらの質問については、以降でご説明します。

ファンドの目的・特色

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

■ 当ファンドは以下の資産クラスに投資します。

国内株式

先進国株式

国内債券

先進国債券

• 資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)の基本ポートフォリオに近づけることを目標とします。

※各資産クラスについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご参照下さい。

※GPIFの基本ポートフォリオの変更に伴い、上記の資産クラスを変更することがあります。





どんなファンド?



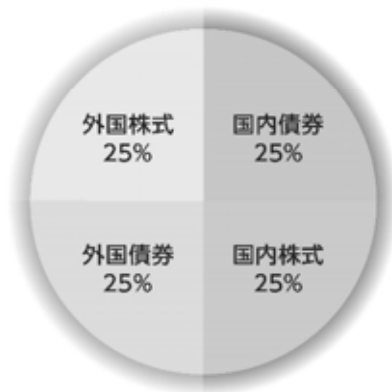
資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、
GPIFの基本ポートフォリオに近づけることを目標とするファンドです。

※当ファンドの運用は、GPIFの投資成果に連動することをめざすものではありません。

年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)とは

将来の年金の支払いに備え、国民から集めた国民年金および厚生年金の保険料の積立金を運用している機関です。
GPIFは「長期的な観点から安全かつ効率的な運用」を行なうため、各資産を組み合わせた資産構成割合を「基本ポートフォリオ」として定めています。

■ GPIFの基本ポートフォリオ (2023年12月末)



※左記は、GPIFの基本ポートフォリオで定める
資産構成割合イメージであり、当ファンドの
実際の組入比率を示すものではありません。

※GPIFの基本ポートフォリオの変更に伴い、投資する資産クラスを変更することがあります。

※資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、GPIFの基本ポートフォリオに近づけることを目標としますが、必ずしも一致するとは限りません。



費用はどれくらいかかるのかな？



ファンドへの投資にかかる主な費用は

購入時	保有期間中	売却時
購入時手数料	運用管理費用 (信託報酬)	換金時手数料 信託財産留保額
購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供等に対するものです。	ファンドの運用・管理等に対するものです。	換金する際に必要な費用等です。
当ファンドは		
無料	低水準	無料

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —



運用管理費用っていくらくらい？

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。
当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.1749%(税込)です。
1年間ファンドの値段(基準価額)が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	÷	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.1749%		175円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

ファンドの仕組みなど

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ペビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



※マザーファンドについて、くわしくは、「マザーファンドの概要」をご参照下さい。

- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 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時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、「ファンドの特色」の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

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

(注)第1計算期間は、2019年6月5日(休業日の場合翌営業日)までとします。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

[マザーファンドの概要]

- 下記は届出日現在の組入マザーファンドの一覧であり、今後変更となる場合があります。

当ファンドは投資成果を特定の指数に連動させることをめざすマザーファンド(インデックスマザーファンド)を組入れることを基本としますが、市場環境等によっては、委託会社の判断に基づき、インデックスマザーファンド以外のマザーファンドを組入れます。

資産クラス	マザーファンド	主な運用方針	特定の指数
国内株式	トピックス・インデックス・マザーファンド	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数(配当込み)に連動することをめざします。	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	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。	MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)
国内債券	ネオ・ジャパン債券マザーファンド	わが国の債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。	—
先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド	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。	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

■ 指数について

● 東証株価指数(TOPIX)

東証株価指数(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。

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

● MSCIコクサイ指数

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

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

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

● FTSE世界国債インデックス

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

(2) 【ファンドの沿革】

2018年8月31日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行いません。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行いません。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行いません。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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	国内外の様々な資産クラス など （ファミリーファンド方式で運用を行いません。）	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2023年12月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151 億 7,427 万 2,500 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
- ・ 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	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

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

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. ネオ・ジャパン債券マザーファンドの受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

② 投資態度

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

※ インデックス運用を行なうマザーファンドの受益証券への投資を基本としますが、市場環境等によっては、委託会社の判断に基づき、インデックス運用を行なわないマザーファンドの受益証券に投資を行ないます。

ロ. 資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)の基本ポートフォリオに近づけることを目標とします。

ハ. 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ニ. 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。

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】

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

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑦、⑧および⑨に定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1. から4. までに掲げるマザーファンドの受益証券、ならびに次の5. から25. までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
 2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
 3. ネオ・ジャパン債券マザーファンドの受益証券
 4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
 5. 株券または新株引受権証書
 6. 国債証券
 7. 地方債証券
 8. 特別の法律により法人の発行する債券
 9. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 10. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 13. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 14. コマーシャル・ペーパー
 15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5. から前15. までの証券または証書の性質を有するもの
 17. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 18. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
 21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 23. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

- 24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 25. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前23.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

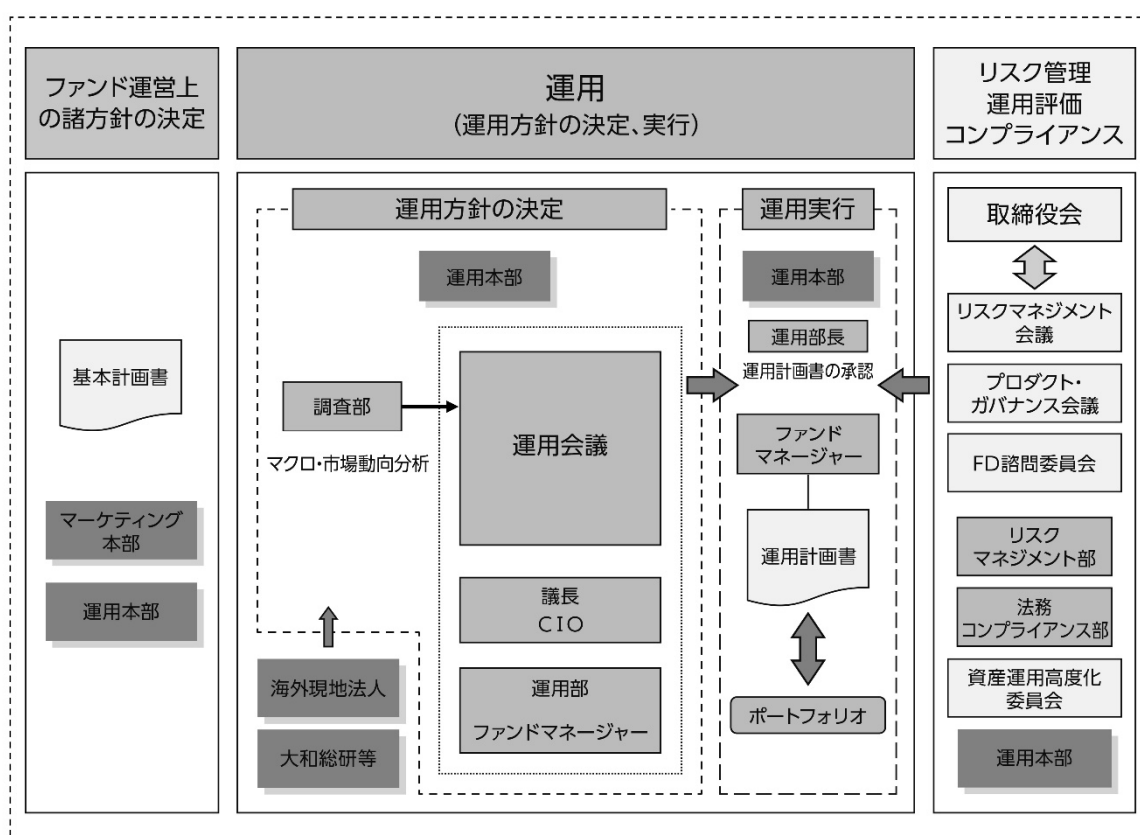
なお、前5.の証券または証書ならびに前16.および前21.の証券または証書のうち前5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前6.から前10.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前16.および前21.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券（新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

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

ロ. 基本的な運用方針の決定

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

ハ. 運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ. CIO (Chief Investment Officer) (1 名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ. Deputy-CIO (0~5 名程度)

CIO を補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. インベストメント・オフィサー (0~5 名程度)

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

ニ. 運用部長 (各運用部に 1 名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ. 運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、FD 諮問委員会および資産運用高度化委員会

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 35~45 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。

ニ. 資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤ 受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。ま

た、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

※ 上記の運用体制は2023年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

- ① 株式（信託約款）
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ② 新株引受権証券等（信託約款）
イ. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
ロ. 前イ. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ③ 投資信託証券（信託約款）
イ. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
ロ. 前イ. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④ 投資する株式等の範囲（信託約款）
イ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
ロ. 前イ. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）
イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
ロ. 前イ. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド

の受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 信用取引（信託約款）

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

⑦ 先物取引等（信託約款）

- イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の 1. から 4. までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。
- ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、か

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

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1. から4. までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑧ スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総

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

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

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

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

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

チ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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。

⑩ デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑪ 有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産

で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

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

⑫ 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

⑬ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑭ 外国為替予約取引（信託約款）

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

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

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

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

⑮ 信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑯ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

を超えないこととします。

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

<参考>マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前 1. の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への投資には、制限を設けません。

② 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、および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行なうことの指図をすることができます。

ロ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および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わが国の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。

③ 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合計額が、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合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. 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。

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ. 主として外国の株式（預託証券を含みます。）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

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
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。
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式
 株式への投資割合には、制限を設けません。
 - ② 投資信託証券
 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - ③ 外貨建資産
 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ネオ・ジャパン債券マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の債券を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ. 主として、わが国の債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

ロ. 組入れる債券（国債を除きます。）の格付けは、取得時においてBBB格相当以上（R&I、JCR、S&P、フィッチのいずれかでBBB-以上またはムーディーズでBaa3以上。これらの格付会社の格付けがない債券のうち委託会社が同等の信用力があると判断するものを含みます。）とします。

※ 債券への投資に代えて、CDS取引を利用することがあります。

ハ. 債券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ニ. 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、債券の組入総額および債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、債券先物取引等の売建玉の時価総額が債券の組入総額を超えることがあります。

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

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

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤、⑥および⑦に定めるものに限ります。）

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限り、有価証券にかかるとして前15.の証券または証書のうち前1.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。）
13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

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

17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式

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、）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。

② 投資信託証券

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

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

- イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- ⑤ スワップ取引
- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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 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（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の 1. から 4. までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額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 クレジット・デリバティブ取引
- 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、クレジット・デリバティブ取引（金融商品取引法第 2 条第 21 項第 5 号イおよび同条第 22 項第 6 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. クレジット・デリバティブ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. クレジット・デリバティブ取引の評価は、当該取引における当事者間で取り決めた者の信用状態、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ニ. 委託会社は、クレジット・デリバティブ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。

4. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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

(2) 投資対象

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

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

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。
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式
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。
- ② 投資信託証券
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③ 同一銘柄の株式
同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入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。

④ その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

② ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

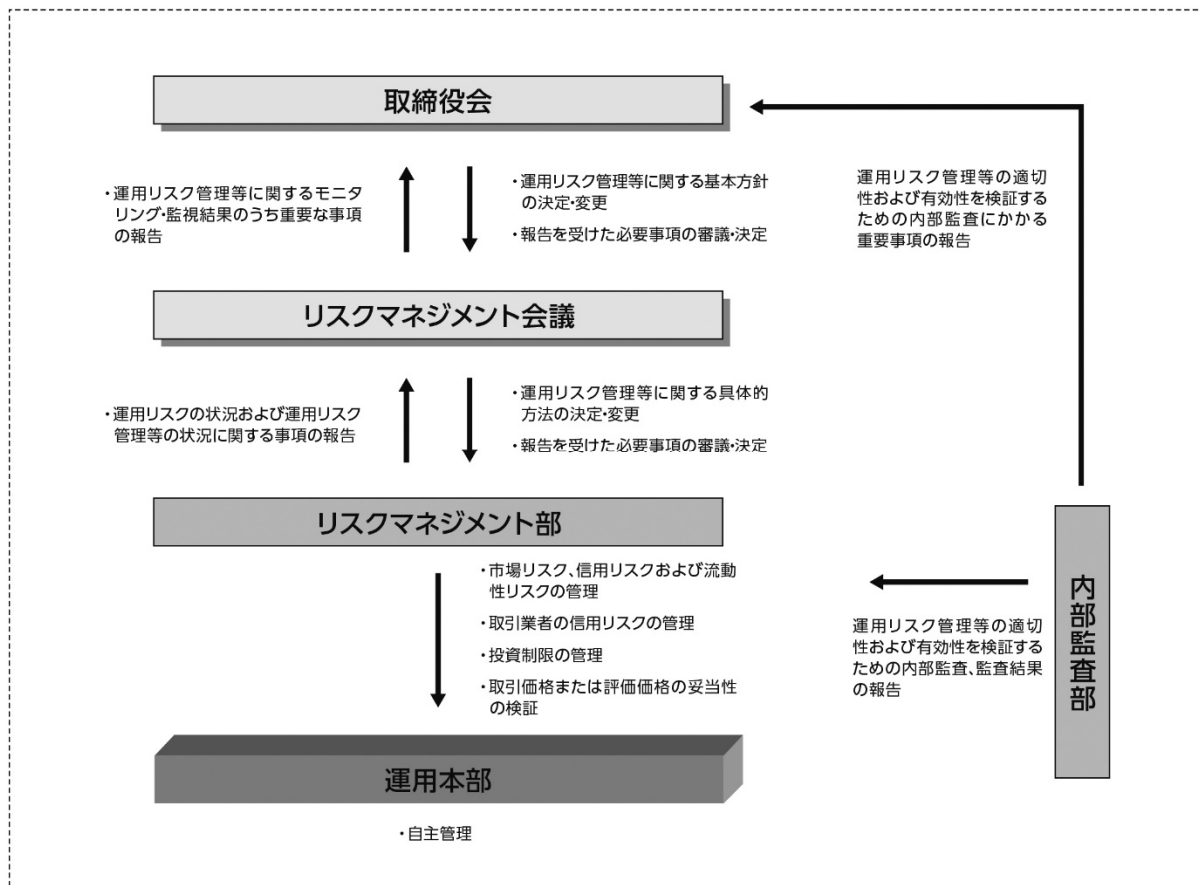
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。

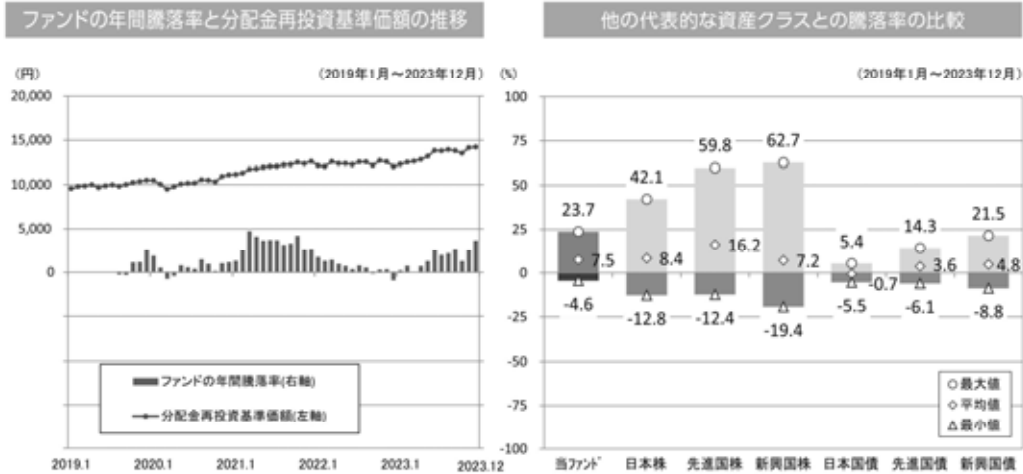


※ 流動性リスクに対する管理体制

- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行いません。
- 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年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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、なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.1749%（税抜 0.159%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 か月終了日（6 か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.0695%（税抜）	年率 0.0695%（税抜）	年率 0.02%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属

する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

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

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

<注1>個別元本について

- ① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。
- ② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。
- ④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

<注2>収益分配金の課税について

- ① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- ② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

（※）上記は、2023年12月末日現在のもので、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】 (2023年12月29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	6,920,966,040	99.00
内 日本	6,920,966,040	99.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	69,673,460	1.00
純資産総額	6,990,639,500	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】 (2023年12月29日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	1,025,651,816	1.5877 1,628,451,778	1.7002 1,743,813,217	24.94
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	322,043,485	4.7961 1,544,577,601	5.3712 1,729,759,966	24.74
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	502,268,018	3.2552 1,635,011,762	3.4344 1,724,989,281	24.68
4	ネオ・ジャパン債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,619,409,154	1.0739 1,739,212,889	1.0636 1,722,403,576	24.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.00%
合計	99.00%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1 計算期間末 (2019年6月5日)	163,092,981	163,092,981	0.9716	0.9716
第2 計算期間末 (2020年6月5日)	390,644,141	390,644,141	1.0331	1.0331
第3 計算期間末 (2021年6月7日)	1,914,505,318	1,914,505,318	1.2005	1.2005
第4 計算期間末 (2022年6月6日)	3,627,887,516	3,627,887,516	1.2451	1.2451
2022年12月末日	4,311,101,688	—	1.2027	—
2023年1月末日	4,500,320,044	—	1.2295	—
2月末日	4,661,896,069	—	1.2509	—
3月末日	4,820,872,716	—	1.2624	—
4月末日	4,999,310,677	—	1.2826	—
5月末日	5,300,867,133	—	1.3173	—
第5 計算期間末 (2023年6月5日)	5,399,250,158	5,399,250,158	1.3386	1.3386
6月末日	5,742,280,838	—	1.3816	—
7月末日	5,993,901,866	—	1.3792	—
8月末日	6,197,556,477	—	1.3937	—
9月末日	6,376,214,122	—	1.3797	—
10月末日	6,463,764,392	—	1.3520	—
11月末日	6,884,673,174	—	1.4147	—
12月末日	6,990,639,500	—	1.4226	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1 計算期間	0.0000
第2 計算期間	0.0000
第3 計算期間	0.0000
第4 計算期間	0.0000
第5 計算期間	0.0000
2023年6月6日～ 2023年12月5日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1 計算期間	△2.8
第2 計算期間	6.3
第3 計算期間	16.2

	収益率(%)
第4計算期間	3.7
第5計算期間	7.5
2023年6月6日～ 2023年12月5日	5.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	195,580,117	28,723,960
第2計算期間	319,478,121	109,199,791
第3計算期間	1,338,371,375	121,808,269
第4計算期間	1,597,162,297	278,234,119
第5計算期間	1,487,376,835	367,559,640
2023年6月6日～ 2023年12月5日	1,286,088,347	456,734,538

(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 (2023年12月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	277,485,192,200	96.71
内 日本	277,485,192,200	96.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,449,690,623	3.29
純資産総額	286,934,882,823	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)	9,440,340,000	3.29
内 日本	9,440,340,000	3.29

(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 (2023年12月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,533,800	2,876.73 13,042,539,717	2,590.50 11,744,808,900	4.09
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	584,000	12,808.89 7,480,396,692	13,410.00 7,831,440,000	2.73
3	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	5,094,300	1,323.05 6,740,060,153	1,211.50 6,171,744,450	2.15
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	82,600	57,683.61 4,764,666,474	62,120.00 5,131,112,000	1.79
5	信越化学	日本	株式	化学	750,000	4,632.00 3,474,003,957	5,917.00 4,437,750,000	1.55
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	174,800	20,765.47 3,629,805,085	25,255.00 4,414,574,000	1.54
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	24,635,400	180.88 4,456,210,950	172.30 4,244,679,420	1.48
8	日立	日本	株式	電気機器	405,600	9,929.40 4,027,366,640	10,170.00 4,124,952,000	1.44

	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 (%)
9	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	578,500	7,595.45 4,393,970,772	6,880.00 3,980,080,000	1.39
10	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,731,300	2,536.27 4,391,056,274	2,253.50 3,901,484,550	1.36
11	任 天 堂	日本	株式	その他製 品	521,300	6,447.28 3,360,970,130	7,359.00 3,836,246,700	1.34
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	628,400	5,053.85 3,175,845,316	5,963.00 3,747,149,200	1.31
13	三井物産	日本	株式	卸売業	658,200	5,790.66 3,811,413,072	5,298.00 3,487,143,600	1.22
14	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	587,300	5,724.76 3,362,153,833	5,767.00 3,386,959,100	1.18
15	武田薬品	日本	株式	医薬品	732,900	4,810.06 3,525,298,400	4,054.00 2,971,176,600	1.04
16	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	2,013,700	1,796.18 3,616,984,342	1,466.00 2,952,084,200	1.03
17	HOYA	日本	株式	精密機器	164,000	16,074.47 2,636,213,812	17,625.00 2,890,500,000	1.01
18	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	640,000	4,727.72 3,025,745,720	4,486.00 2,871,040,000	1.00
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	801,900	3,581.39 2,871,921,106	3,529.00 2,829,905,100	0.99
20	第一三共	日本	株式	医薬品	721,400	4,055.46 2,925,610,840	3,872.00 2,793,260,800	0.97
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,098,500	2,678.40 2,942,232,972	2,412.50 2,650,131,250	0.92
22	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	408,500	6,493.12 2,652,439,755	6,293.00 2,570,690,500	0.90
23	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	449,200	5,103.35 2,292,426,452	5,251.00 2,358,749,200	0.82
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信 業	1,332,400	1,757.90 2,342,237,633	1,759.50 2,344,357,800	0.82
25	ダイキン工業	日本	株式	機械	99,600	24,850.11 2,475,070,969	22,985.00 2,289,306,000	0.80
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	751,300	2,758.30 2,072,311,750	2,993.00 2,248,640,900	0.78
27	SMC	日本	株式	機械	25,000	69,725.69 1,743,142,483	75,760.00 1,894,000,000	0.66
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	928,300	1,912.98 1,775,825,503	1,999.00 1,855,671,700	0.65
29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	494,200	3,391.37 1,676,016,473	3,645.00 1,801,359,000	0.63
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	301,100	6,057.63 1,823,955,016	5,595.00 1,684,654,500	0.59

(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	96.71%
合計	96.71%

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

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	0.33%
建設業	2.05%
食料品	3.27%
繊維製品	0.39%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.99%
医薬品	4.46%
石油・石炭製品	0.45%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.93%
非鉄金属	0.65%
金属製品	0.51%
機械	5.16%
電気機器	16.98%
輸送用機器	7.92%
精密機器	2.29%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.36%
陸運業	2.75%
海運業	0.81%
空運業	0.44%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.45%
卸売業	6.77%
小売業	4.15%
銀行業	6.71%
証券、商品先物取引業	0.78%
保険業	2.32%
その他金融業	1.11%
不動産業	1.86%
サービス業	4.81%
合計	96.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0603 月	買建	399	9,349,929,450	9,440,340,000	3.29%

(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 (2023年12月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	394,204,531,174	92.30
内 香港	2,478,864,666	0.58
内 シンガポール	1,465,370,783	0.34
内 イスラエル	836,418,929	0.20
内 ノルウェー	830,771,149	0.19
内 スウェーデン	3,892,504,824	0.91
内 デンマーク	4,079,520,711	0.96
内 イギリス	16,810,304,680	3.94
内 アイルランド	592,238,049	0.14
内 オランダ	5,230,997,386	1.22
内 ベルギー	1,023,783,141	0.24
内 フランス	13,390,343,353	3.14
内 ドイツ	9,649,448,173	2.26
内 スイス	10,793,662,024	2.53
内 ポルトガル	252,009,198	0.06
内 スペイン	3,006,959,366	0.70
内 イタリア	2,962,573,922	0.69
内 フィンランド	1,239,523,665	0.29
内 オーストリア	206,763,584	0.05
内 カナダ	12,875,365,191	3.01
内 アメリカ	294,867,980,404	69.04
内 オーストラリア	7,474,772,261	1.75
内 ニュージーランド	244,355,715	0.06
投資証券	8,742,184,936	2.05
内 香港	137,624,462	0.03
内 シンガポール	178,472,346	0.04
内 イギリス	141,184,137	0.03
内 ベルギー	36,501,502	0.01
内 フランス	154,805,472	0.04
内 カナダ	33,596,897	0.01
内 アメリカ	7,356,706,279	1.72
内 オーストラリア	703,293,841	0.16

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,137,310,650	5.65
純資産総額	427,084,026,760	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)	24,057,701,579	5.63
内 イギリス	1,007,608,997	0.24
内 ドイツ	4,392,552,485	1.03
内 カナダ	1,632,664,656	0.38
内 アメリカ	15,900,306,006	3.72
内 オーストラリア	1,124,569,435	0.26
為替予約取引(買建)	12,655,814,230	2.96
内 日本	12,655,814,230	2.96

(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 (2023年12月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	787,200	26,861.18 21,145,133,453	27,455.45 21,612,931,342	5.06
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	355,500	53,732.57 19,101,969,051	53,225.96 18,921,829,633	4.43
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	467,800	20,751.14 9,707,391,813	21,753.88 10,176,467,590	2.38
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	124,480	68,198.95 8,489,407,966	70,237.05 8,743,108,308	2.05
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	298,800	19,132.15 5,716,718,692	19,888.82 5,942,779,685	1.39
6	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	112,000	47,084.01 5,273,409,596	50,820.52 5,691,898,867	1.33
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	262,840	19,335.68 5,082,208,289	20,037.74 5,266,720,212	1.23

	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 (%)
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	143,950	34,602.40 4,981,020,385	35,908.51 5,169,031,368	1.21
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	22,412	133,199.07 2,985,260,102	159,191.41 3,567,797,888	0.84
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	146,370	21,895.85 3,204,910,583	24,153.64 3,535,369,604	0.83
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	46,666	75,969.11 3,545,179,373	74,446.56 3,474,123,496	0.81
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	40,685	83,938.68 3,415,046,152	82,381.95 3,351,709,860	0.78
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	65,950	50,882.07 3,355,673,618	50,714.15 3,344,598,397	0.78
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	80,950	36,069.07 2,919,791,876	36,932.53 2,989,688,465	0.70
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	201,705	14,516.58 2,928,084,846	14,209.94 2,866,217,501	0.67
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	121,300	21,588.08 2,618,640,053	22,207.74 2,693,799,032	0.63
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	42,400	58,144.91 2,465,345,508	60,464.96 2,563,714,541	0.60
18	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	170,516	14,537.06 2,478,803,958	14,718.05 2,509,664,037	0.59
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	50,450	44,124.44 2,226,081,844	49,266.06 2,485,473,171	0.58
20	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	118,767	21,448.38 2,547,376,961	20,668.88 2,454,781,572	0.57
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	19,799	98,816.85 1,956,476,939	107,768.60 2,133,710,670	0.50
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	22,360	83,407.10 1,864,985,018	94,047.47 2,102,901,496	0.49
23	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需 品	127,771	16,678.97 2,131,102,535	16,283.94 2,080,616,524	0.49
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	127,821	14,350.92 1,834,354,579	15,426.84 1,971,875,279	0.46
25	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	88,972	19,666.43 1,749,764,085	21,948.19 1,952,774,583	0.46
26	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	23,020	87,525.13 2,014,829,576	84,462.60 1,944,329,089	0.46
27	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	91,418	20,409.05 1,865,757,252	21,241.87 1,941,890,104	0.45
28	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	49,066	32,801.30 1,609,434,235	37,667.21 1,848,179,395	0.43
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	360,201	4,299.86 1,548,817,400	4,805.20 1,730,837,989	0.41

	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 (%)
30	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	206,950	8,259.89 1,709,406,430	8,332.51 1,724,413,462	0.40

(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	92.30%
投資証券	2.05%
合計	94.35%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.41%
素材	3.79%
資本財・サービス	9.77%
一般消費財・サービス	9.80%
生活必需品	6.47%
ヘルスケア	11.65%
金融	14.40%
情報技術	22.34%
コミュニケーション・サービス	6.79%
公益事業	2.53%
不動産	0.34%
合計	92.30%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 24	買建	464	15,461,349,063	15,900,306,006	3.72%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 24	買建	72	993,499,334	1,007,608,997	0.24%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 24	買建	61	1,100,334,386	1,124,569,435	0.26%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 24	買建	60	1,590,070,000	1,632,664,656	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 24	買建	69	1,288,757,474	1,279,031,141	0.30%
		EURO STOXX 50 MAR 24	買建	436	3,144,708,250	3,113,521,344	0.73%

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 2024年1月	買建	2,300,000	423,202,530	414,724,960	0.10%
		スイス・フラン買/円売 2024年1月	買建	5,300,000	892,415,060	891,027,520	0.21%
		ユーロ買/円売 2024年1月	買建	10,500,000	1,671,754,730	1,647,162,300	0.39%
		豪ドル買/円売 2024年1月	買建	7,300,000	708,673,740	706,468,450	0.17%
		カナダ・ドル買/円売 2024年1月	買建	10,000,000	1,082,909,540	1,070,387,000	0.25%
		米ドル買/円売 2024年1月	買建	56,000,000	8,131,196,240	7,926,044,000	1.86%

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

(注2) 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。

ネオ・ジャパン債券マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年12月29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		55,336,558,409	38.65
	内 日本	55,336,558,409	38.65
地方債証券		245,474,930	0.17
	内 日本	245,474,930	0.17
特殊債券		2,387,872,942	1.67
	内 日本	2,387,872,942	1.67
社債券		78,044,202,900	54.51
	内 日本	78,044,202,900	54.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,165,259,351	5.00
純資産総額		143,179,368,532	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(%)
債券先物オプション取引(売建)		13,800,000	△0.01
	内 日本	13,800,000	△0.01

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

(注2) 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) 債券先物オプション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 (2023年12月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	4 ソフトバンク G 劣後 FR	日本	社債券	5,000,000,000	97.87 4,893,830,000	98.91 4,945,640,000	3.000000 2056/02/04	3.45
2	3 野村 HD 劣後 FR	日本	社債券	5,000,000,000	98.11 4,905,935,000	98.43 4,921,725,000	1.300000 永久債	3.44
3	13 三井住友 FG 劣 FR	日本	社債券	3,500,000,000	100.00 3,500,000,000	99.74 3,491,127,500	1.889000 永久債	2.44
4	1 日本航空劣後 FR	日本	社債券	3,000,000,000	98.16 2,944,800,000	99.19 2,975,868,000	1.600000 2058/10/11	2.08
5	15 みずほ FG 劣後 FR	日本	社債券	3,000,000,000	100.00 3,000,000,000	99.00 2,970,294,000	1.785000 永久債	2.07

	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 (%)
6	3 かんぽ生命劣 FR	日本	社債券	2,800,000,000	100.00 2,800,000,000	99.63 2,789,780,000	1.910000 2053/09/07	1.95
7	7 イオン 劣後 FR	日本	社債券	2,600,000,000	92.77 2,412,108,400	94.54 2,458,232,400	1.740000 2050/12/02	1.72
8	367 10 年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	97.39 2,434,759,000	97.40 2,435,175,000	0.200000 2032/06/20	1.70
9	362 10 年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	96.63 2,222,497,000	97.96 2,253,241,000	0.100000 2031/03/20	1.57
10	363 10 年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	98.17 2,257,960,000	97.68 2,246,778,000	0.100000 2031/06/20	1.57
11	75 30 年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	101.06 2,425,536,000	92.15 2,211,624,000	1.300000 2052/06/20	1.54
12	16 40 年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	94.94 2,278,619,000	86.71 2,081,112,000	1.300000 2063/03/20	1.45
13	3 関西電力劣後 FR	日本	社債券	2,100,000,000	97.12 2,039,641,800	96.15 2,019,210,900	1.259000 2082/03/20	1.41
14	168 20 年国債	日本	国債証券	2,200,000,000	93.11 2,048,612,000	90.23 1,985,148,000	0.400000 2039/03/20	1.39
15	55 日産フィナンシャル	日本	社債券	2,000,000,000	97.79 1,955,952,000	98.03 1,960,604,000	0.370000 2026/12/18	1.37
16	154 20 年国債	日本	国債証券	1,524,000,000	106.22 1,618,893,520	104.33 1,590,111,120	1.200000 2035/09/20	1.11
17	368 10 年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	98.34 1,573,520,000	97.13 1,554,096,000	0.200000 2032/09/20	1.09
18	27 NTT ファイナンス	日本	社債券	1,500,000,000	100.00 1,500,000,000	100.20 1,503,105,000	0.420000 2026/09/18	1.05
19	12 ロイズ・バンキング FR	日本	社債券	1,500,000,000	100.00 1,500,000,000	100.07 1,501,137,000	1.377000 2027/12/01	1.05
20	1 フォルヴィア	日本	社債券	1,500,000,000	100.00 1,500,000,000	100.05 1,500,751,500	2.480000 2026/03/13	1.05
21	17 三菱 UFJFG 劣 FR	日本	社債券	1,500,000,000	100.09 1,501,350,000	99.75 1,496,317,500	1.804000 永久債	1.05
22	8 クレディ・A 劣後 FR	日本	社債券	1,500,000,000	99.99 1,499,979,000	99.23 1,488,523,500	2.040000 2033/06/13	1.04
23	2 アフラック生命	日本	社債券	1,400,000,000	100.00 1,400,000,000	99.60 1,394,458,800	1.958000 2053/12/05	0.97
24	1 日本生命 2 劣ローン	日本	社債券	1,400,000,000	98.82 1,383,553,000	98.91 1,384,782,000	1.030000 2048/09/18	0.97
25	148 20 年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	110.37 1,412,838,400	108.18 1,384,780,800	1.500000 2034/03/20	0.97
26	16 楽天グループ	日本	社債券	1,500,000,000	89.35 1,340,319,000	89.33 1,340,080,500	0.600000 2026/12/02	0.94
27	4 楽天 劣後 FR	日本	社債券	1,500,000,000	89.40 1,341,112,500	86.32 1,294,869,000	1.810000 2055/11/04	0.90

	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 (%)
28	176 20 年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	91.15 1,276,188,000	88.31 1,236,424,000	0.500000 2041/03/20	0.86
29	173 20 年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	92.21 1,291,010,000	88.09 1,233,358,000	0.400000 2040/06/20	0.86
30	1 NTN 劣後 FR	日本	社債券	1,200,000,000	100.89 1,210,776,000	100.19 1,202,398,800	2.500000 2051/03/18	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	38.65%
地方債証券	0.17%
特殊債券	1.67%
社債券	54.51%
合計	95.00%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物オプション取引	日本	国先 OP0602 1450P	売建	10	1,994,500	2,000,000	△0.00%
		国先 OP0602 1470C	売建	20	11,989,000	10,000,000	△0.01%
		国先 OP0602 1480C	売建	15	2,241,750	1,800,000	△0.00%

(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) 債券先物オプション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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2023年12月29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	277,280,751,671	97.37
内 ユーロ	93,118,066,871	32.70
内 中国	20,011,925,551	7.03
内 シンガポール	1,098,663,028	0.39
内 マレーシア	1,316,498,709	0.46
内 イスラエル	765,436,630	0.27
内 ノルウェー	481,659,493	0.17
内 スウェーデン	558,993,343	0.20
内 デンマーク	772,676,567	0.27
内 イギリス	14,451,072,324	5.07
内 ポーランド	1,344,339,405	0.47
内 カナダ	5,310,603,365	1.86
内 アメリカ	131,127,579,614	46.05
内 メキシコ	2,351,544,698	0.83
内 オーストラリア	3,940,779,343	1.38
内 ニュージーランド	630,912,730	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,494,665,935	2.63
純資産総額	284,775,417,606	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,918,672,847	0.67
内 日本	1,918,672,847	0.67
為替予約取引(売建)	205,774,480	△0.07
内 日本	205,774,480	△0.07

(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 (2023年12月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,358,870,535	101.97 1,402,880,809	4.125000 2032/11/15	0.49
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	83.48 1,231,445,215	86.22 1,271,861,092	1.875000 2032/02/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,230,272,565	83.62 1,269,077,111	1.125000 2031/02/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,197,380,627	91.86 1,237,802,177	2.750000 2032/08/15	0.43
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,187,657,897	92.94 1,225,988,589	2.875000 2032/05/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,174,405,728	82.97 1,212,154,066	1.250000 2031/08/15	0.43
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,193,027,685	100.24 1,198,440,855	2.390000 2026/11/15	0.42
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,143,476,009	83.27 1,181,032,593	1.375000 2031/11/15	0.41
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,110,988,145	82.31 1,144,165,870	0.875000 2030/11/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,067,265,076	97.29 1,103,936,641	3.500000 2033/02/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,029,177,764	96.29 1,065,297,611	3.375000 2033/05/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,028,485,492	85.96 1,060,777,205	1.625000 2031/05/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,023,580,550	94.30 1,033,808,134	1.625000 2026/05/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.81 961,159,217	100.23 995,133,175	3.875000 2033/08/15	0.35
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	100.18 928,556,285	102.07 946,120,109	2.750000 2027/10/25	0.33
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 894,833,836	81.23 921,736,150	0.625000 2030/08/15	0.32
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 904,598,831	92.22 915,648,806	1.125000 2026/10/31	0.32
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 893,815,496	95.68 909,238,232	2.875000 2028/08/15	0.32
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 869,365,422	95.89 884,041,991	2.875000 2028/05/15	0.31
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 864,299,538	94.20 881,813,558	2.625000 2029/02/15	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 859,475,617	88.12 874,913,812	0.750000 2028/01/31	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.09 858,201,274	93.86 865,318,303	0.250000 2025/06/30	0.30

	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 (%)
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 850,598,760	94.97 862,126,703	2.375000 2027/05/15	0.30
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 847,195,691	95.59 860,984,191	2.750000 2028/02/15	0.30
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 849,278,040	100.66 856,656,036	4.375000 2026/08/15	0.30
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 844,465,038	92.74 855,039,174	1.500000 2027/01/31	0.30
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	98.67 788,687,112	101.79 813,648,297	2.500000 2030/05/25	0.29
28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.53 787,471,362	94.51 804,303,747	2.750000 2029/05/31	0.28
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	40,000,000	99.73 794,879,971	100.49 800,897,260	2.670000 2033/05/25	0.28
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,400,000	91.92 779,918,855	94.15 798,873,183	0.750000 2028/05/25	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	97.37%
合計	97.37%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年1月	買建	2,801,000	398,026,351	396,574,102	0.14%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2024年1月	買建	284,000	25,779,248	25,486,074	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2024年1月	買建	5,564,000	46,764,863	46,256,870	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2024年1月	買建	2,820,000	102,405,360	101,848,975	0.04%
		ユーロ買/円売 2024年1月	買建	1,778,000	276,941,970	278,990,606	0.10%
		英ポンド買/円売 2024年1月	買建	172,000	31,130,871	31,019,029	0.01%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		シンガポール・ドル買/円 売 2024年1月	買建	177,000	19,520,002	18,996,560	0.01%
		オフショア人民元買/円売 2024年1月	買建	50,715,000	1,046,331,594	1,009,223,428	0.35%
		カナダ・ドル買/円売 2024年1月	買建	96,000	10,070,572	10,277,203	0.00%
		メキシコ・ペソ売/円買 2024年1月	売建	24,696,000	205,967,356	205,774,480	△0.07%

(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

●iFree 年金バランス

2023年12月29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	14,226円
純資産総額	69億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	3.1%
6カ月間	3.0%
1年間	18.3%
3年間	27.9%
5年間	52.8%
設定来	42.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 19年6月	第2期 20年6月	第3期 21年6月	第4期 22年6月	第5期 23年6月					
分配金	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を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(除く債券)	国・地域名	比率
国内株式・先物	2,133	24.9%	日本円	50.6%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	1.3%
外国債券	979	24.9%	米ドル	30.0%	最終利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%
外国株式・先物	1,203	24.2%	ユーロ	10.6%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	1.0%
国内債券・先物等	165	22.5%	英ポンド	2.3%	残存年数	S&P500 EMINI MAR 24	アメリカ	0.9%
外国リート	55	0.5%	オフショア人民元	1.8%	債券格付別構成	TOPIX 先物 0603月	日本	0.8%
外国投資証券	3	0.0%	カナダ・ドル	1.3%	AAA	ソニーグループ	日本	0.7%
			豪ドル	0.9%	AA	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.6%
			スイス・フラン	0.7%	A	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
			デンマーク・クローネ	0.3%	BBB	NVIDIA CORP	アメリカ	0.5%
コール・ローン、その他		5.1%	その他	1.4%	BB	キーエンス	日本	0.4%
合計	4,538	-	合計	100.0%	合計	合計		7.9%

※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。

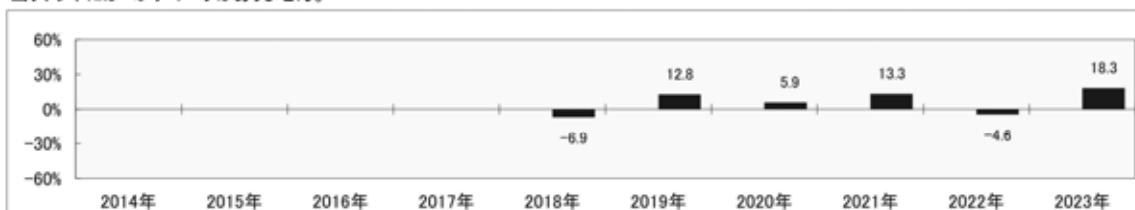
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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。

・2018年は設定日(8月31日)から年末、2023年は12月29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
iFree 年金バランス	0.19%	0.17%	0.02%

※対象期間は2022年6月7日～2023年6月5日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

継続申込期間においては、委託会社の各営業日の午後3時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。

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せん。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せん。

2【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時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、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

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

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

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け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け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約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け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国および外国の公社債：原則として、次の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)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。ただし、第1計算期間は、2018年8月31日から2019年6月5日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオ（これに準ずるものを含みます。）の参照が不能となる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 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。）を行いません。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。
4. 前3.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4.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。
5. 前3.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。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、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3.から前5.までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 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。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書

面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
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、信託約款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. 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であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合

には、これを交付します。

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

<収益分配金および償還金にかかる請求権>

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

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

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

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

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

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2022年6月7日から2023年6月5日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年7月14日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 秋山 範之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e 年金バランスの2022年6月7日から2023年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、i F r e e 年金バランスの2023年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸

表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

i F r e e 年金バランス

(1) 【貸借対照表】

	第4期 2022年6月6日現在 金額(円)	第5期 2023年6月5日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	40,208,185	61,310,842
親投資信託受益証券	3,591,433,811	5,345,906,090
流動資産合計	3,631,641,996	5,407,216,932
資産合計	3,631,641,996	5,407,216,932
負債の部		
流動負債		
未払解約金	775,191	3,693,033
未払受託者報酬	357,844	513,334
未払委託者報酬	2,487,327	3,567,990
その他未払費用	134,118	192,417
流動負債合計	3,754,480	7,966,774
負債合計	3,754,480	7,966,774
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,913,625,771	4,033,442,966
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	714,261,745	1,365,807,192
(分配準備積立金)	230,559,683	573,553,118
元本等合計	3,627,887,516	5,399,250,158
純資産合計	3,627,887,516	5,399,250,158
負債純資産合計	3,631,641,996	5,407,216,932

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第4期 自2021年6月8日 至2022年6月6日 金額(円)	第5期 自2022年6月7日 至2023年6月5日 金額(円)
営業収益		
受取利息	4	21
有価証券売買等損益	100,183,327	379,142,279
その他収益	201	-
営業収益合計	100,183,532	379,142,300
営業費用		
支払利息	6,832	17,616
受託者報酬	622,822	957,072
委託者報酬	4,329,173	6,652,193
その他費用	233,419	358,742
営業費用合計	5,192,246	7,985,623
営業利益	94,991,286	371,156,677
経常利益	94,991,286	371,156,677
当期純利益	94,991,286	371,156,677
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	4,886,345	5,538,653
期首剰余金又は期首欠損金(△)	319,807,725	714,261,745
剰余金増加額又は欠損金減少額	362,842,266	375,906,010
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	362,842,266	375,906,010
剰余金減少額又は欠損金増加額	58,493,187	89,978,587
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	58,493,187	89,978,587
分配金 ※1	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	714,261,745	1,365,807,192

(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 5 期 自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2022 年 6 月 5 日が休日のため、前計算期間末日を 2022 年 6 月 6 日としております。このため、当計算期間は 364 日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 4 期 2022 年 6 月 6 日現在	第 5 期 2023 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首元本額	1,594,697,593 円	2,913,625,771 円
期中追加設定元本額	1,597,162,297 円	1,487,376,835 円
期中一部解約元本額	278,234,119 円	367,559,640 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,913,625,771 口	4,033,442,966 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 4 期 自 2021 年 6 月 8 日 至 2022 年 6 月 6 日	第 5 期 自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (0 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (90,109,145 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (483,708,243 円) 及び分配準備積立金 (140,450,538 円) より分配対象額は 714,267,926 円 (1 万口当たり 2,451.47 円) であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (0 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (365,629,133 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (792,270,760 円) 及び分配準備積立金 (207,923,985 円) より分配対象額は 1,365,823,878 円 (1 万口当たり 3,386.25 円) であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第5期 自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第5期 2023年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2022年6月6日現在	第5期 2023年6月5日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	97,537,467	377,106,672
合計	97,537,467	377,106,672

(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 4 期 2022 年 6 月 6 日現在	第 5 期 2023 年 6 月 5 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 5 期 自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第 4 期 2022 年 6 月 6 日現在	第 5 期 2023 年 6 月 5 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1,2451 円 (12,451 円)	1,3386 円 (13,386 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	ネオ・ジャパン債券マザーファンド	1,216,296,510	1,311,046,008	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	861,208,807	1,356,834,475	
	外国株式インデックスマザーファンド	285,687,220	1,356,671,470	
	外国債券インデックスマザーファンド	408,215,928	1,321,354,137	
親投資信託受益証券 合計			5,345,906,090	
合計			5,345,906,090	

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

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

「ネオ・ジャパン債券マザーファンド」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

	2022年6月6日現在 金額(円)	2023年6月5日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,559,091,492	1,693,509,887
国債証券	48,440,413,356	38,473,829,101
地方債証券	125,764,066	125,333,190
特殊債券	2,369,607,463	1,966,207,802
社債券	63,039,640,000	62,730,433,600
未収入金	2,915,550	303,913,500
未収利息	334,068,938	328,089,589
前払費用	2,411,556	2,657,036
差入委託証拠金	195,600	-
流動資産合計	119,874,108,021	105,623,973,705
資産合計	119,874,108,021	105,623,973,705
負債の部		
流動負債		
プット・オプション(売)	3,000,000	4,300,000
未払金	1,000,000,000	1,692,406,000
未払解約金	-	962,432
流動負債合計	1,003,000,000	1,697,668,432
負債合計	1,003,000,000	1,697,668,432
純資産の部		
元本等		
元本	※1 108,031,335,737	96,413,557,321
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	10,839,772,284	7,512,747,952
元本等合計	118,871,108,021	103,926,305,273
純資産合計	118,871,108,021	103,926,305,273
負債純資産合計	119,874,108,021	105,623,973,705

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</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。 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)先物オプション取引</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。 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>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 6 月 6 日現在	2023 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	2021 年 6 月 8 日	2022 年 6 月 7 日
期首元本額	97,528,490,449 円	108,031,335,737 円
期中追加設定元本額	10,876,092,873 円	11,002,077,881 円
期中一部解約元本額	373,247,585 円	22,619,856,297 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ネオ・ジャパン債券ファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	107,233,045,428 円	95,197,260,811 円
i F r e e 年金バランス	797,393,945 円	1,216,296,510 円
ジャパン・アクティブ・ボンド・オープン	896,364 円	-円
計	108,031,335,737 円	96,413,557,321 円
2. 期末日における受益権の総数	108,031,335,737 口	96,413,557,321 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における債券先物取引を利用しております。また、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）における債券先物オプション取引を利用しております。また、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スワップ取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 6 月 5 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月6日現在	2023年6月5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	△2,195,050,069	△234,681,969
地方債証券	△857,240	△291,457
特殊債券	△29,201,435	△3,119,203
社債券	△818,813,700	△2,020,009,800
合計	△3,043,922,444	△2,258,102,429

(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

債券関連

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
債券先物オプション取引								
売建								
ブット	3,000,000	-	3,000,000	0	3,600,000	-	4,300,000	△700,000
合計	3,000,000	-	3,000,000	0	3,600,000	-	4,300,000	△700,000

(注)

1. 時価の算定方法

債券先物オプション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. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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)

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額	1.1003円	1.0779円
(1万口当たり純資産額)	(11,003円)	(10,779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	6 40年国債	412,000,000	474,759,960	
	7 40年国債	412,000,000	454,225,880	
	10 40年国債	200,000,000	177,470,000	
	12 40年国債	900,000,000	688,815,000	
	14 40年国債	300,000,000	242,409,000	
	15 40年国債	900,000,000	796,491,000	
	16 40年国債	200,000,000	192,188,000	
	360 10年国債	300,000,000	296,565,000	
	363 10年国債	400,000,000	392,948,000	
	367 10年国債	700,000,000	688,989,000	
	370 10年国債	1,000,000,000	1,006,570,000	
	29 30年国債	321,000,000	393,921,570	
	31 30年国債	428,000,000	513,985,200	
	33 30年国債	512,000,000	598,952,960	
	34 30年国債	513,000,000	616,667,040	
	36 30年国債	435,000,000	509,841,750	
	37 30年国債	500,000,000	576,965,000	
	38 30年国債	526,000,000	596,983,700	
	41 30年国債	716,000,000	799,356,720	
	42 30年国債	310,000,000	346,152,200	
	45 30年国債	914,000,000	985,383,400	
	46 30年国債	413,000,000	445,160,310	
	47 30年国債	312,000,000	342,098,640	
	48 30年国債	215,000,000	227,156,100	
	50 30年国債	515,000,000	481,581,650	
	51 30年国債	513,000,000	426,969,900	
	54 30年国債	506,000,000	469,411,140	
	56 30年国債	500,000,000	461,515,000	
	58 30年国債	500,000,000	459,160,000	
	59 30年国債	300,000,000	268,278,000	
	61 30年国債	500,000,000	443,755,000	
	62 30年国債	600,000,000	504,378,000	
	63 30年国債	400,000,000	326,160,000	
	64 30年国債	300,000,000	243,753,000	
67 30年国債	1,100,000,000	932,877,000		
68 30年国債	400,000,000	338,144,000		
75 30年国債	2,400,000,000	2,407,608,000		
144 20年国債	500,000,000	551,015,000		
148 20年国債	1,280,000,000	1,411,712,000		

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 5 0 20年国債	568,000,000	620,642,240	
	1 5 1 20年国債	434,000,000	464,610,020	
	1 5 2 20年国債	735,000,000	786,574,950	
	1 5 3 20年国債	527,000,000	569,692,270	
	1 5 4 20年国債	524,000,000	559,983,080	
	1 5 6 20年国債	500,000,000	484,670,000	
	1 5 9 20年国債	100,000,000	98,763,000	
	1 6 0 20年国債	731,000,000	729,618,410	
	1 6 1 20年国債	600,000,000	589,692,000	
	1 6 3 20年国債	900,000,000	879,417,000	
	1 6 4 20年国債	400,000,000	384,384,000	
	1 6 5 20年国債	400,000,000	383,120,000	
	1 6 7 20年国債	800,000,000	761,560,000	
	1 6 8 20年国債	1,800,000,000	1,681,398,000	
	1 7 3 20年国債	800,000,000	734,392,000	
	1 7 5 20年国債	800,000,000	742,520,000	
	1 7 6 20年国債	1,000,000,000	925,190,000	
	1 7 7 20年国債	1,100,000,000	996,853,000	
	1 8 0 20年国債	700,000,000	676,788,000	
	2 4 物価連動国債	800,000,000	885,361,843	
	2 6 物価連動国債	800,000,000	894,297,648	
	2 7 物価連動国債	1,000,000,000	1,100,521,020	
	2 8 メキシコ国債	500,000,000	433,407,500	
国債証券 合計			38,473,829,101	
地方債証券	2 6 - 1 7 愛知県公債	44,200,000	44,523,190	
	2 7 - 1 5 愛知県公債	80,000,000	80,810,000	
地方債証券 合計			125,333,190	
特殊債券	3 7 政保政策投資C	22,000,000	22,040,040	
	2 2 2 政保道路機構	51,000,000	51,384,642	
	6 9 地方公共団体	50,000,000	50,350,000	
	9 0 政保地方公共団	45,000,000	44,946,180	
	9 2 政保地方公共団	37,000,000	37,085,655	
	S 4 住宅機構RMBS	10,254,000	10,313,473	
	S 6 住宅機構RMBS	10,068,000	10,121,360	
	S 7 住宅機構RMBS	53,145,000	53,835,885	
	S 8 住宅機構RMBS	10,632,000	10,774,468	
	2 8 住宅金融RMBS	29,184,000	29,329,920	
	3 7 住宅金融RMBS	78,800,000	79,209,760	
	4 0 住宅金融RMBS	21,516,000	21,795,708	
	9 住宅機構RMBS	10,372,000	10,435,269	
	1 2 住宅機構RMBS	10,855,000	11,001,542	
	2 4 住宅機構RMBS	28,182,000	29,357,189	
	3 1 住宅機構RMBS	19,876,000	20,967,192	
	3 9 住宅機構RMBS	20,253,000	21,089,448	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	5 0 住宅機構RMB S	149,048,000	155,397,444	
	5 1 住宅機構RMB S	176,040,000	183,803,364	
	6 0 住宅機構RMB S	54,138,000	56,249,382	
	7 1 住宅機構RMB S	238,880,000	245,305,872	
	8 2 住宅機構RMB S	145,112,000	148,551,154	
	9 5 住宅機構RMB S	56,266,000	56,783,647	
	9 8 住宅機構RMB S	165,153,000	167,547,718	
	1 1 1 住宅機構RMB S	68,686,000	66,412,493	
	1 1 2 住宅機構RMB S	70,372,000	68,668,997	
	1 9 3 住宅機構RMB S	300,000,000	303,450,000	
特殊債券 合計			1,966,207,802	
社債券	0.922% SOCIETE GENERALE SA 20260928	300,000,000	292,377,000	
	3.2% SOCIETE GENERALE SA 20321020	500,000,000	510,665,000	
	7 B P C E S . A . 劣後	100,000,000	99,093,900	
	9 B P C E S A 劣後FR	1,000,000,000	957,858,000	
	1 1 B P C E S A 劣FR	1,000,000,000	995,405,000	
	8 クレディ・A 劣後FR	1,500,000,000	1,500,000,000	
	1 エイチエスピーシーH劣FR	1,200,000,000	1,190,406,000	
	2 5 ルノー	500,000,000	506,680,500	
	2 ソシエテ ジェネラル	200,000,000	191,267,600	
	1.488% Aflac Inc 20331018	1,000,000,000	989,390,000	
	1.039% Aflac Inc 20360415	300,000,000	274,947,000	
	1.428% KKR GROUP FINANCE CO LLC 20280525	1,000,000,000	1,010,710,000	
	2 プレミアムウォーターHD	200,000,000	200,730,400	
	2 野村不動産劣FR	100,000,000	97,372,000	
	2 東急不動産劣FR	500,000,000	478,635,000	
	1 大日本住友劣FR	1,100,000,000	1,033,454,400	
	2 大日本住友劣FR	500,000,000	435,796,500	
	1 9 ZHD	400,000,000	397,010,800	
	1 6 楽天グループ	1,500,000,000	1,339,300,500	
	2 0 楽天グループ	900,000,000	558,026,100	
	1 楽天 劣後FR	100,000,000	99,428,800	
	4 楽天 劣後FR	1,500,000,000	1,339,401,000	
	5 楽天 劣後FR	200,000,000	158,267,600	
	6 楽天 劣後FR	900,000,000	612,115,200	
	1 ENEOS HD 劣FR	900,000,000	889,798,500	
	4 DMG森精機劣FR	1,100,000,000	1,067,550,000	
	1 ツバキ・ナカシマ劣FR	700,000,000	614,159,700	
	1 NTN 劣後FR	1,200,000,000	1,210,868,400	
	2 かんぽ生命劣FR	1,000,000,000	963,659,000	
	1 日本生命2劣ローン	2,400,000,000	2,369,920,800	
	1 ニプロ 劣後 FR	400,000,000	401,029,200	
	7 イオン 劣後FR	2,600,000,000	2,407,974,400	
	8 イオン 劣後FR	300,000,000	258,577,500	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	9 イオン 劣後FR	800,000,000	620,096,800	
	17 三菱UFJFG劣FR	3,000,000,000	2,999,775,000	
	5 三井住友トラ劣FR	100,000,000	95,952,400	
	6 三井住友トラ劣FR	600,000,000	571,959,000	
	11 三井住友FG劣FR	500,000,000	500,388,500	
	7 みずほFG劣後FR	1,000,000,000	940,876,000	
	55 日産フィナンシャル	2,000,000,000	1,956,014,000	
	3 オリックス 劣後FR	1,000,000,000	990,899,000	
	1 三菱HC 劣後FR	800,000,000	784,133,600	
	2 野村HD劣後FR	300,000,000	300,122,400	
	3 野村HD劣後FR	5,000,000,000	4,904,425,000	
	1 第一生命劣後FR	1,000,000,000	972,663,000	
	2 第一生命劣後FR	1,000,000,000	955,178,000	
	3 第一生命劣後FR	500,000,000	470,056,500	
	2 東京建物劣FR	800,000,000	814,596,800	
	3 東京建物劣FR	500,000,000	470,672,500	
	1 商船三井劣後FR	500,000,000	503,943,500	
	1 日本航空劣後FR	3,500,000,000	3,432,065,000	
	37 光通信	600,000,000	531,078,000	
	39 光通信	300,000,000	284,257,800	
	3 関西電力劣後FR	2,100,000,000	2,037,753,900	
	1 東北電力劣後FR	1,000,000,000	1,018,062,000	
	1 JERA 劣後FR	1,000,000,000	1,037,955,000	
	4 ソフトバンクG劣後FR	5,000,000,000	4,892,490,000	
	3A明治安田劣後FR	1,600,000,000	1,592,313,600	
	4A明治安田劣後FR	1,000,000,000	969,187,000	
	5A富国生命劣後FR	1,100,000,000	1,062,548,300	
	1 大樹生命劣後FR	800,000,000	790,519,200	
	1 朝日生命劣後FR	800,000,000	778,576,000	
社債券 合計			62,730,433,600	
合計			103,295,803,693	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

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

	2022年6月6日現在 金額(円)	2023年6月5日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,071,596,590	10,496,544,143
株式 ※2※3	189,725,861,600	235,920,131,577
派生商品評価勘定	180,860,450	572,330,500
未収入金	27,283,600	-
未収配当金	1,761,580,435	2,050,889,570
未収利息	653,844	480,343
その他未収収益 ※4	25,894,232	38,322,027
差入委託証拠金	8,040,000	-
流動資産合計	203,801,770,751	249,078,698,160
資産合計	203,801,770,751	249,078,698,160
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	76,650	-
前受金	160,635,000	431,906,300
未払金	4,015,678,807	-
未払解約金	110,151,390	107,784,740
受入担保金	6,287,724,460	4,800,327,997
流動負債合計	10,574,266,307	5,340,019,037
負債合計	10,574,266,307	5,340,019,037
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	144,218,034,186	154,707,449,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	49,009,470,258	89,031,229,423
元本等合計	193,227,504,444	243,738,679,123
純資産合計	193,227,504,444	243,738,679,123
負債純資産合計	203,801,770,751	249,078,698,160

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 6 月 6 日現在	2023 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	2021 年 6 月 8 日	2022 年 6 月 7 日
期首元本額	135,290,116,425 円	144,218,034,186 円
期中追加設定元本額	23,029,834,047 円	23,949,619,642 円
期中一部解約元本額	14,101,916,286 円	13,460,204,128 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	2,962,705,495 円	2,766,727,363 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	5,195,544,975 円	4,582,469,170 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	920,931 円	914,473 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	23,273,435 円	16,539,530 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	330,149,007 円	239,546,860 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	21,795,176 円	16,395,434 円

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	647,820,107円	462,005,847円
日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	348,599,985円	582,944,013円
D-I's TOPIXインデックス	32,296,608円	13,713,849円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	196,172,434円	230,161,402円
iFree TOPIXインデックス	5,733,854,030円	6,665,168,340円
iFree 8資産バランス	3,906,692,734円	4,452,587,585円
iFree 年金バランス	671,875,066円	861,208,807円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	33,003円
DCダイワ日本株式インデックス	68,666,878,875円	69,887,459,503円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,242,640,964円	3,205,125,267円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,563,690,746円	4,812,288,474円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,451,168,891円	5,099,468,118円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,479,526,428円	7,096,930,330円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	59,020,682円	53,649,088円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	64,357,313円	71,886,039円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,017,752,901円	3,477,349,497円
ダイワつみたてインデックスバランス30	11,962,436円	12,632,163円
ダイワつみたてインデックスバランス50	9,836,532円	10,218,104円
ダイワつみたてインデックスバランス70	23,835,616円	30,731,620円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	99,068,349円	5,169,576,821円
ダイワ世界バランスファンド40VA	85,936,602円	68,265,420円
ダイワ世界バランスファンド60VA	97,123,951円	24,867,151円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,642,424,025円	4,404,601,154円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	521,432,579円	414,580,439円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	73,437,877円	59,675,537円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	132,473,472円	93,574,927円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	212,641,219円	206,174,498円

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	11,252,126,060 円	11,968,348,998 円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	1,885,192,194 円	3,416,099,506 円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,214,023,891 円	3,551,296,505 円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,206,087,227 円	1,181,419,940 円
ダイワライフスタイル25	144,026,251 円	121,938,701 円
ダイワライフスタイル50	574,809,555 円	524,432,231 円
ダイワライフスタイル75	443,384,955 円	418,523,791 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)	8,971,474,612 円	8,435,920,202 円
計	144,218,034,186 円	154,707,449,700 円
2. 期末日における受益権の総数	144,218,034,186 口	154,707,449,700 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 6,030,320,920 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 4,697,417,000 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 864,040,000 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 1,130,580,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 6 月 5 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022 年 6 月 6 日現在	2023 年 6 月 5 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	△10,908,287,189	28,833,380,551
合計	△10,908,287,189	28,833,380,551

(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	2022 年 6 月 6 日現在				2023 年 6 月 5 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)		
市場取引								

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
株価指数 先物取引								
買建	3,380,330,000	-	3,561,215,000	180,885,000	7,341,353,700	-	7,913,880,000	572,526,300
合計	3,380,330,000	-	3,561,215,000	180,885,000	7,341,353,700	-	7,913,880,000	572,526,300

- (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
場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も
近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
 4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額	1.3398円	1.5755円
(1万口当たり純資産額)	(13,398円)	(15,755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	3,900	3,630.00	14,157,000	
ニッスイ	104,200	630.40	65,687,680	
マルハニチロ	15,500	2,492.00	38,626,000	
雪国まいたけ	8,900	966.00	8,597,400	
カネコ種苗	3,200	1,479.00	4,732,800	
サカタのタネ	11,900	3,995.00	47,540,500	貸付株式数 4,700 株
ホクト	9,300	1,852.00	17,223,600	
ホクリヨウ	1,200	914.00	1,096,800	貸付株式数 400 株
ショーボンドHD	14,200	5,813.00	82,544,600	
ミライト・ワン	34,500	1,771.00	61,099,500	
タマホーム	6,500	3,405.00	22,132,500	貸付株式数 2,600 株 (100 株)
サンヨーホームズ	1,000	707.00	707,000	貸付株式数 300 株
日本アクア	3,400	910.00	3,094,000	
ファーストコーポレーション	2,100	806.00	1,692,600	貸付株式数 200 株
ベステラ	1,700	953.00	1,620,100	貸付株式数 600 株
キャンディル	1,500	569.00	853,500	貸付株式数 700 株
住石ホールディングス	12,600	352.00	4,435,200	
日鉄鉱業	4,200	3,765.00	15,813,000	
三井松島HLDGS	4,700	2,685.00	12,619,500	貸付株式数 1,800 株
INPEX	385,400	1,557.50	600,260,500	
石油資源開発	12,100	4,335.00	52,453,500	
K&Oエナジーグループ	4,700	2,224.00	10,452,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	994.00	1,590,400	
第一カッター興業	2,700	1,245.00	3,361,500	貸付株式数 100 株
明豊ファシリティワークス	3,000	740.00	2,220,000	
安藤・間	60,400	1,038.00	62,695,200	
東急建設	29,700	712.00	21,146,400	
コムシスホールディングス	35,300	2,788.50	98,434,050	
ビーアールホールディングス	16,500	382.00	6,303,000	
高松コンストラクションGP	6,800	2,387.00	16,231,600	
東建コーポレーション	3,000	7,620.00	22,860,000	
ソネック	900	978.00	880,200	貸付株式数 200 株
ヤマウラ	5,300	1,177.00	6,238,100	貸付株式数 1,600 株
オリエンタル白石	37,500	299.00	11,212,500	
大成建設	68,200	4,568.00	311,537,600	
大林組	260,700	1,180.00	307,626,000	
清水建設	219,200	868.50	190,375,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
飛島建設	8,100	1,236.00	10,011,600	
長谷工コーポレーション	75,200	1,665.50	125,245,600	
松井建設	6,800	682.00	4,637,600	
銭高組	700	3,060.00	2,142,000	
鹿島建設	161,600	2,055.00	332,088,000	
不動テトラ	5,000	1,772.00	8,860,000	
大末建設	2,100	1,282.00	2,692,200	
鉄建建設	5,200	1,994.00	10,368,800	
西松建設	12,400	3,449.00	42,767,600	貸付株式数 1,000株
三井住友建設	58,800	365.00	21,462,000	貸付株式数 22,800株
大豊建設	3,000	3,840.00	11,520,000	貸付株式数 700株
佐田建設	3,600	446.00	1,605,600	
ナカノフドー建設	4,000	380.00	1,520,000	
奥村組	11,800	3,880.00	45,784,000	
東鉄工業	10,000	2,611.00	26,110,000	
イチケン	1,300	1,887.00	2,453,100	
富士ピー・エス	2,500	434.00	1,085,000	貸付株式数 500株
浅沼組	5,800	3,160.00	18,328,000	
戸田建設	89,700	795.60	71,365,320	
熊谷組	12,200	3,085.00	37,637,000	
北野建設	1,100	2,957.00	3,252,700	
植木組	1,600	1,294.00	2,070,400	
矢作建設	9,900	1,099.00	10,880,100	
ピーエス三菱	9,200	708.00	6,513,600	
日本ハウスHLDGS	14,500	383.00	5,553,500	
大東建託	26,800	13,590.00	364,212,000	
新日本建設	10,200	1,160.00	11,832,000	
東亜道路	2,900	4,125.00	11,962,500	
日本道路	1,500	8,830.00	13,245,000	
東亜建設	6,300	3,125.00	19,687,500	貸付株式数 2,400株
日本国土開発	21,800	583.00	12,709,400	
若築建設	3,200	3,225.00	10,320,000	
東洋建設	23,600	997.00	23,529,200	貸付株式数 9,400株
五洋建設	103,300	723.20	74,706,560	
世紀東急	9,400	1,309.00	12,304,600	
福田組	2,700	4,680.00	12,636,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,400	1,655.00	2,317,000	貸付株式数 200株
住友林業	55,900	3,198.00	178,768,200	
日本基礎技術	3,400	505.00	1,717,000	
巴コーポレーション	6,300	446.00	2,809,800	
大和ハウス	203,700	3,691.00	751,856,700	
ライト工業	13,500	1,950.00	26,325,000	
積水ハウス	221,000	2,794.50	617,584,500	
日特建設	7,000	989.00	6,923,000	
北陸電気工事	5,000	873.00	4,365,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユアテック	16,100	818.00	13,169,800	
日本リーテック	6,400	1,367.00	8,748,800	
四電工	3,100	2,086.00	6,466,600	
中電工	11,300	2,206.00	24,927,800	
関電工	39,900	1,072.00	42,772,800	
きんでん	51,300	1,877.00	96,290,100	貸付株式数 300株
東京エネシス	7,300	953.00	6,956,900	
トーエネック	2,400	3,645.00	8,748,000	
住友電設	6,900	2,820.00	19,458,000	
日本電設工業	12,000	1,906.00	22,872,000	
エクシオグループ	33,600	2,759.00	92,702,400	
新日本空調	4,000	2,232.00	8,928,000	貸付株式数 1,100株
日本工営	4,600	3,705.00	17,043,000	
九電工	17,700	3,812.00	67,472,400	
三機工業	16,200	1,486.00	24,073,200	
日揮ホールディングス	72,100	1,795.00	129,419,500	
中外炉工業	2,400	2,017.00	4,840,800	
ヤマト	4,700	905.00	4,253,500	
太平電業	4,500	4,175.00	18,787,500	
高砂熱学	17,600	2,420.00	42,592,000	
三晃金属	700	4,240.00	2,968,000	
NEC ネットズエスアイ	24,900	1,964.00	48,903,600	
朝日工業社	3,000	2,365.00	7,095,000	
明星工業	12,500	927.00	11,587,500	
大気社	8,400	3,790.00	31,836,000	
ダイダン	4,800	2,569.00	12,331,200	
日比谷総合設備	6,300	2,156.00	13,582,800	
ニッポン	19,700	1,811.00	35,676,700	
日清製粉G本社	67,700	1,789.00	121,115,300	
日東富士製粉	1,300	4,690.00	6,097,000	
昭和産業	6,400	2,641.00	16,902,400	
鳥越製粉	4,600	614.00	2,824,400	貸付株式数 300株
中部飼料	10,100	1,080.00	10,908,000	
フィード・ワン	10,700	723.00	7,736,100	
東洋精糖	1,100	1,425.00	1,567,500	
日本甜菜糖	4,300	1,820.00	7,826,000	
DM三井製糖ホールディ	7,300	2,539.00	18,534,700	
塩水港精糖	6,800	202.00	1,373,600	貸付株式数 1,500株
ウエルネオシュガー	3,800	1,985.00	7,543,000	貸付株式数 1,400株
LIFULL	26,200	253.00	6,628,600	
MIXI	17,400	2,743.00	47,728,200	
ジェイエイシーリクルート メント	6,900	2,353.00	16,235,700	
日本M&Aセンターホール デ	131,100	1,034.50	135,622,950	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
メンバーズ	2,200	1,549.00	3,407,800	貸付株式数	800株
中広	800	402.00	321,600	貸付株式数	400株
UTグループ	11,200	2,937.00	32,894,400		
アイティメディア	2,900	1,274.00	3,694,600	貸付株式数	1,100株
E・Jホールディングス	4,500	1,522.00	6,849,000	貸付株式数	1,400株
オープンアップグループ	22,900	1,999.00	45,777,100		
コシダカホールディングス	22,900	1,163.00	26,632,700	貸付株式数	9,100株
アルトナー	1,400	1,533.00	2,146,200		
パソナグループ	9,300	1,766.00	16,423,800		
CDS	1,500	1,780.00	2,670,000	貸付株式数	100株
リンクアンドモチベーション	22,000	428.00	9,416,000	貸付株式数	8,800株
エス・エム・エス	29,100	2,989.00	86,979,900		
サニーサイドアップG	1,800	694.00	1,249,200	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	84,300	2,750.00	231,825,000		
リニカル	3,400	775.00	2,635,000		
クックパッド	20,900	178.00	3,720,200	貸付株式数	1,700株
エスクリ	2,400	369.00	885,600	貸付株式数	1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディング	2,900	651.00	1,887,900	貸付株式数	1,300株
森永製菓	13,400	4,462.00	59,790,800		
中村屋	1,800	3,085.00	5,553,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	20,900	3,754.00	78,458,600		
名糖産業	2,900	1,627.00	4,718,300	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	4,000	2,232.00	8,928,000	貸付株式数	100株
不二家	5,000	2,503.00	12,515,000	貸付株式数	2,000株
山崎製パン	49,000	2,044.00	100,156,000		
第一屋製パン	1,100	393.00	432,300	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,400	3,720.00	8,928,000	貸付株式数	900株
亀田製菓	4,700	4,210.00	19,787,000		
寿スピリッツ	7,800	10,850.00	84,630,000		
カルビー	33,500	2,780.00	93,130,000		
森永乳業	13,300	5,074.00	67,484,200		
六甲バター	5,400	1,344.00	7,257,600	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	52,300	9,340.00	488,482,000		
明治ホールディングス	89,700	3,174.00	284,707,800		
雪印メグミルク	17,700	1,897.00	33,576,900		
プリマハム	9,800	2,172.00	21,285,600		
日本ハム	28,600	3,852.00	110,167,200		
林兼産業	1,700	486.00	826,200	貸付株式数	600株
丸大食品	7,400	1,490.00	11,026,000		
S Foods	8,100	3,160.00	25,596,000		
柿安本店	2,900	2,325.00	6,742,500	貸付株式数	1,000株
伊藤ハム米久HLDGS	55,900	707.00	39,521,300	貸付株式数	4,500株
学情	3,500	1,779.00	6,226,500	貸付株式数	300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スタジオアリス	3,800	2,160.00	8,208,000	貸付株式数 1,500株
クロスキャット	4,300	1,137.00	4,889,100	貸付株式数 1,600株
シミックホールディングス	3,700	2,013.00	7,448,100	貸付株式数 1,500株
エプロ	1,300	741.00	963,300	貸付株式数 600株
システナ	125,300	308.00	38,592,400	
N J S	1,700	2,561.00	4,353,700	貸付株式数 600株
デジタルアーツ	4,700	5,860.00	27,542,000	
日鉄ソリューションズ	12,700	4,190.00	53,213,000	
総合警備保障	28,400	3,926.00	111,498,400	
キューブシステム	4,400	1,179.00	5,187,600	貸付株式数 1,600株 (200株)
いちご	84,300	273.00	23,013,900	
日本駐車場開発	77,500	238.00	18,445,000	
コア	3,300	1,719.00	5,672,700	貸付株式数 600株
カカコム	56,100	2,076.00	116,463,600	
アイロムグループ	2,700	1,920.00	5,184,000	貸付株式数 1,000株
セントケア・ホールディング	4,900	760.00	3,724,000	
サイネックス	1,000	593.00	593,000	
ルネサンス	5,300	916.00	4,854,800	貸付株式数 2,100株
ディップ	13,400	3,530.00	47,302,000	貸付株式数 4,000株
S B Sホールディングス	6,600	3,140.00	20,724,000	
デジタルホールディングス	6,000	1,034.00	6,204,000	
新日本科学	8,100	2,329.00	18,864,900	貸付株式数 3,200株
キャリアデザインセンター	1,200	1,547.00	1,856,400	貸付株式数 400株
ベネフィット・ワン	35,400	1,649.50	58,392,300	
エムスリー	151,000	3,262.00	492,562,000	
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	472.00	1,793,600	貸付株式数 1,500株
プラス	700	1,227.00	858,900	
アウトソーシング	45,500	1,296.00	58,968,000	
ウェルネット	4,500	619.00	2,785,500	貸付株式数 1,800株
ワールドホールディングス	3,400	2,806.00	9,540,400	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	30,600	1,870.00	57,222,000	
博報堂DYHLDGS	97,400	1,508.50	146,927,900	貸付株式数 30,000株
ぐるなび	14,100	363.00	5,118,300	貸付株式数 5,500株
タカミヤ	10,400	498.00	5,179,200	
ジャパンベストレスキュー	3,800	695.00	2,641,000	
ファンコミュニケーションズ	15,000	399.00	5,985,000	
ライク	2,800	1,667.00	4,667,600	貸付株式数 1,000株
ビジネス・ブレークスルー	2,200	434.00	954,800	
エスプール	22,000	586.00	12,892,000	
WDBホールディングス	3,900	2,140.00	8,346,000	
手間いらず	1,300	3,985.00	5,180,500	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ティア	3,500	438.00	1,533,000	貸付株式数 1,100株
CDG	600	1,361.00	816,600	貸付株式数 200株
アドウェイズ	10,500	712.00	7,476,000	貸付株式数 4,300株
バリューコマース	5,700	1,427.00	8,133,900	
インフォマート	79,300	258.00	20,459,400	
サッポロホールディングス	24,100	3,752.00	90,423,200	
アサヒグループホールディングン	169,100	5,509.00	931,571,900	
麒麟HD	330,200	2,118.00	699,363,600	
宝ホールディングス	50,000	1,059.00	52,950,000	
オエノンホールディングス	21,900	386.00	8,453,400	
養命酒	2,400	1,838.00	4,411,200	貸付株式数 700株
コカ・コーラボトラーズJHD	57,300	1,590.00	91,107,000	
サントリー食品インター	51,500	5,310.00	273,465,000	
ダイドーグループHD	4,100	5,020.00	20,582,000	貸付株式数 1,600株
伊藤園	24,800	4,334.00	107,483,200	
キーコーヒー	8,200	2,060.00	16,892,000	
ユニカフェ	1,900	909.00	1,727,100	貸付株式数 700株
ジャパンフーズ	900	1,085.00	976,500	
日清オイリオグループ	10,300	3,365.00	34,659,500	
不二製油グループ	17,000	2,024.00	34,408,000	
かどや製油	700	3,440.00	2,408,000	貸付株式数 100株
J-オイルミルズ	7,500	1,578.00	11,835,000	
ローソン	19,500	6,187.00	120,646,500	
サンエー	6,000	4,555.00	27,330,000	貸付株式数 2,300株
カワチ薬品	6,100	2,188.00	13,346,800	
エービーシー・マート	11,500	7,905.00	90,907,500	
ハードオフコーポレーション	2,400	1,370.00	3,288,000	
高千穂交易	2,200	2,588.00	5,693,600	貸付株式数 1,000株
アスクル	16,300	1,838.00	29,959,400	貸付株式数 6,300株
ゲオホールディングス	7,700	1,613.00	12,420,100	
アダストリア	9,500	2,841.00	26,989,500	貸付株式数 3,600株
ジーフット	4,100	273.00	1,119,300	貸付株式数 1,700株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	516.00	412,800	
オルバヘルスケアHLDGS	900	1,878.00	1,690,200	貸付株式数 400株 (100株)
伊藤忠食品	1,800	5,200.00	9,360,000	
くら寿司	9,200	3,140.00	28,888,000	貸付株式数 3,600株
キャンドウ	2,800	2,409.00	6,745,200	貸付株式数 1,200株
エレマテック	7,100	1,753.00	12,446,300	
IKホールディングス	1,900	387.00	735,300	貸付株式数 900株
パルグループHLDGS	7,700	3,540.00	27,258,000	
エディオン	31,100	1,397.00	43,446,700	貸付株式数 12,400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
あらた	6,000	4,630.00	27,780,000	
サーラコーポレーション	16,500	747.00	12,325,500	貸付株式数 6,200株
ワッツ	3,000	699.00	2,097,000	貸付株式数 1,200株
トーメンデバイス	1,100	5,720.00	6,292,000	貸付株式数 400株
ハローズ	3,600	3,350.00	12,060,000	貸付株式数 700株
J Pホールディングス	22,000	354.00	7,788,000	貸付株式数 1,200株
フジオフードG本社	8,700	1,530.00	13,311,000	貸付株式数 3,400株 (100株)
あみやき亭	1,900	3,545.00	6,735,500	貸付株式数 600株
東京エレクトロデバイス	2,900	10,220.00	29,638,000	
ひらまつ	13,100	272.00	3,563,200	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	13,500	2,447.00	33,034,500	貸付株式数 5,400株
双日	78,400	2,859.00	224,145,600	
アルフレッサホールディン グス	78,900	2,188.50	172,672,650	
大黒天物産	2,400	4,940.00	11,856,000	貸付株式数 600株
ハニーズホールディングス	6,200	1,550.00	9,610,000	貸付株式数 2,100株
ファーマライズHD	1,300	612.00	795,600	貸付株式数 500株
キッコーマン	48,500	8,474.00	410,989,000	
味の素	176,700	5,663.00	1,000,652,100	
ブルドックソース	3,900	1,976.00	7,706,400	貸付株式数 1,500株
キューピー	39,300	2,261.00	88,857,300	
ハウス食品G本社	22,400	3,275.00	73,360,000	
カゴメ	34,100	3,330.00	113,553,000	貸付株式数 500株
焼津水産化工	2,200	803.00	1,766,600	
アリアケジャパン	6,400	4,992.00	31,948,800	
ピエトロ	800	1,804.00	1,443,200	貸付株式数 100株
エバラ食品工業	2,000	2,965.00	5,930,000	貸付株式数 200株
やまみ	500	1,372.00	686,000	貸付株式数 200株
ニチレイ	33,500	3,068.00	102,778,000	
横浜冷凍	21,400	1,137.00	24,331,800	貸付株式数 3,500株
東洋水産	37,000	6,330.00	234,210,000	
イトアンドHLDGS	3,100	2,169.00	6,723,900	貸付株式数 1,200株
大冷	700	1,919.00	1,343,300	
ヨシムラ・フード・HLD GS	4,600	816.00	3,753,600	貸付株式数 1,800株
日清食品HD	25,700	12,125.00	311,612,500	
永谷園ホールディングス	3,600	2,125.00	7,650,000	
一正蒲鉾	2,400	784.00	1,881,600	貸付株式数 1,000株
フジッコ	7,500	1,902.00	14,265,000	
ロックフィールド	8,200	1,469.00	12,045,800	貸付株式数 1,300株
日本たばこ産業	481,800	3,117.00	1,501,770,600	
ケンコーマヨネーズ	5,000	1,250.00	6,250,000	
わらべや日洋HD	5,400	2,259.00	12,198,600	
なとり	4,600	1,940.00	8,924,000	貸付株式数 200株
イフジ産業	1,000	1,019.00	1,019,000	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ファーマフーズ	10,500	1,801.00	18,910,500	貸付株式数 4,200株
北の達人コーポ	31,400	289.00	9,074,600	貸付株式数 12,500株 (1,100株)
ユーグレナ	47,300	898.00	42,475,400	貸付株式数 18,900株
紀文食品	5,700	1,012.00	5,768,400	貸付株式数 2,300株
ピクルスホールディングス	4,300	1,281.00	5,508,300	貸付株式数 1,600株
スター・マイカ・HLDGS	6,600	634.00	4,184,400	
SREホールディングス	3,600	3,535.00	12,726,000	貸付株式数 1,400株
ADワークスグループ	14,300	210.00	3,003,000	貸付株式数 2,800株
片倉工業	6,900	1,683.00	11,612,700	貸付株式数 2,600株
グンゼ	5,300	4,425.00	23,452,500	
ヒューリック	170,700	1,210.50	206,632,350	貸付株式数 53,400株
神栄	800	1,083.00	866,400	貸付株式数 300株
ラサ商事	2,800	1,335.00	3,738,000	貸付株式数 900株
アルペン	6,500	1,983.00	12,889,500	貸付株式数 2,600株
ハブ	2,000	740.00	1,480,000	貸付株式数 900株
ラクーンホールディングス	6,200	742.00	4,600,400	貸付株式数 2,400株
クオールホールディングス	10,800	1,679.00	18,133,200	貸付株式数 100株
アルコニックス	10,300	1,337.00	13,771,100	
神戸物産	60,800	3,951.00	240,220,800	貸付株式数 400株
ソリトンシステムズ	3,800	1,185.00	4,503,000	貸付株式数 1,400株
ジズホールディングス	4,700	3,060.00	14,382,000	貸付株式数 1,700株
ビックカメラ	41,800	1,070.00	44,726,000	貸付株式数 20,600株
DCMホールディングス	45,700	1,279.00	58,450,300	貸付株式数 18,200株
ペッパーフードサービス	18,600	133.00	2,473,800	貸付株式数 7,200株
ハイパー	1,100	442.00	486,200	貸付株式数 400株
MonotaRO	111,500	2,033.00	226,679,500	貸付株式数 17,700株
東京一番フーズ	1,400	495.00	693,000	貸付株式数 600株
DDグループ	3,900	1,300.00	5,070,000	貸付株式数 1,300株
あいホールディングス	12,600	2,330.00	29,358,000	
ディーブイエックス	1,700	926.00	1,574,200	貸付株式数 200株
きちりホールディングス	1,400	895.00	1,253,000	貸付株式数 700株
アークランドサービスHD	6,400	2,947.00	18,860,800	貸付株式数 2,300株
J. フロントリテイリング	97,800	1,413.50	138,240,300	
ドトール・日レスHD	13,900	2,046.00	28,439,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	47,700	7,860.00	374,922,000	
ブロンコビリー	4,200	2,886.00	12,121,200	貸付株式数 1,600株
ZOZO	52,000	2,928.50	152,282,000	
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,653.00	6,281,400	貸付株式数 1,600株
物語コーポレーション	13,100	3,145.00	41,199,500	貸付株式数 5,200株
三越伊勢丹HD	132,400	1,430.00	189,332,000	
東洋紡	32,200	1,007.00	32,425,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユニチカ	22,500	222.00	4,995,000	貸付株式数 4,600株
富士紡ホールディングス	2,900	3,050.00	8,845,000	
日清紡ホールディングス	61,100	1,095.50	66,935,050	
倉敷紡績	5,600	2,266.00	12,689,600	
ダイワボウHD	32,100	2,657.00	85,289,700	
シキボウ	3,200	974.00	3,116,800	
日東紡績	8,400	2,573.00	21,613,200	
トヨタ紡織	31,300	2,394.00	74,932,200	
マクニカホールディングス	18,600	5,170.00	96,162,000	
H a m e e	2,700	977.00	2,637,900	貸付株式数 1,100株
マーケットエンタープライズ	600	1,253.00	751,800	貸付株式数 200株
ラクト・ジャパン	3,000	1,968.00	5,904,000	貸付株式数 500株
ウエルシアHD	40,800	3,008.00	122,726,400	貸付株式数 15,500株
クリエイトSDH	13,000	3,450.00	44,850,000	貸付株式数 5,200株
グリムス	3,300	2,756.00	9,094,800	
バイタルKSKHD	11,500	935.00	10,752,500	
八洲電機	6,400	1,319.00	8,441,600	貸付株式数 1,900株
メディアスホールディングス	5,000	799.00	3,995,000	貸付株式数 2,000株
レスターホールディングス	7,500	2,363.00	17,722,500	
ジュテックHD	1,400	1,128.00	1,579,200	
丸善CHI HD	7,200	345.00	2,484,000	貸付株式数 2,800株 (300株)
大光	2,600	580.00	1,508,000	貸付株式数 1,200株 (100株)
OCHIホールディングス	1,400	1,229.00	1,720,600	貸付株式数 500株 (500株)
TOKAIホールディングス	38,800	871.00	33,794,800	
黒谷	1,700	593.00	1,008,100	貸付株式数 700株
ミサワ	1,100	615.00	676,500	
ティーライフ	800	1,372.00	1,097,600	貸付株式数 100株
C o m i n i x	1,200	780.00	936,000	貸付株式数 400株
エー・ピーホールディングス	1,300	752.00	977,600	貸付株式数 500株
三洋貿易	8,900	1,320.00	11,748,000	
チムニー	1,900	1,253.00	2,380,700	貸付株式数 700株
シュッピン	5,900	1,003.00	5,917,700	貸付株式数 2,300株
ビューティガレージ	1,200	3,660.00	4,392,000	貸付株式数 500株
オイシックス・ラ・大地	10,600	2,254.00	23,892,400	貸付株式数 4,200株
ウイン・パートナーズ	5,700	1,007.00	5,739,900	貸付株式数 1,500株
ネクステージ	17,900	2,550.00	45,645,000	貸付株式数 7,200株
ジョイフル本田	23,400	1,738.00	40,669,200	貸付株式数 9,300株
鳥貴族ホールディングス	2,900	2,227.00	6,458,300	貸付株式数 1,100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ホットランド	6,000	1,746.00	10,476,000	貸付株式数 2,400株 (2,300株)
すかいらくHD	107,500	1,860.00	199,950,000	貸付株式数 43,000株
SFPホールディングス	4,300	1,942.00	8,350,600	貸付株式数 1,700株
綿半ホールディングス	6,100	1,360.00	8,296,000	
日本毛織	19,600	1,010.00	19,796,000	貸付株式数 8,000株
ダイトウボウ	9,400	90.00	846,000	貸付株式数 5,500株
トーア紡コーポレーション	2,200	395.00	869,000	貸付株式数 500株
ダイドーリミテッド	8,300	244.00	2,025,200	貸付株式数 3,800株 (100株)
ヨシックスホールディングス	1,200	2,281.00	2,737,200	貸付株式数 100株
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	25,600	1,106.00	28,313,600	貸付株式数 9,600株
三栄建築設計	3,500	1,513.00	5,295,500	
野村不動産HLDGS	45,800	3,499.00	160,254,200	
三重交通グループHD	15,700	566.00	8,886,200	貸付株式数 4,000株
サムティ	11,600	2,165.00	25,114,000	貸付株式数 4,600株
地主	5,600	1,942.00	10,875,200	貸付株式数 2,200株
プレサンスコーポレーシ ョン	11,600	1,897.00	22,005,200	貸付株式数 900株
フィル・カンパニー	1,300	912.00	1,185,600	貸付株式数 500株
ハウスコム	900	902.00	811,800	
JPMC	3,700	1,110.00	4,107,000	
サンセイランディック	1,700	872.00	1,482,400	貸付株式数 600株
エストラスト	700	634.00	443,800	貸付株式数 200株
フージャースHD	11,300	947.00	10,701,100	
オープンハウスグループ	26,800	5,573.00	149,356,400	
東急不動産HD	220,100	786.60	173,130,660	
飯田GHD	64,100	2,394.50	153,487,450	貸付株式数 23,500株
イーグランド	900	1,467.00	1,320,300	貸付株式数 400株
帝国繊維	8,400	1,627.00	13,666,800	貸付株式数 3,200株
日本コークス工業	67,200	100.00	6,720,000	
ゴルフダイジェスト・オン	3,600	869.00	3,128,400	貸付株式数 1,500株
ミタチ産業	1,500	1,330.00	1,995,000	貸付株式数 600株
BEENOS	3,300	1,990.00	6,567,000	貸付株式数 1,700株
あさひ	6,600	1,267.00	8,362,200	
日本調剤	5,300	1,121.00	5,941,300	貸付株式数 2,100株
コスモス薬品	7,800	13,770.00	107,406,000	貸付株式数 100株
シップヘルスケアHD	28,300	2,424.50	68,613,350	貸付株式数 10,900株
トーエル	2,700	753.00	2,033,100	貸付株式数 1,300株
ソフトクリエイトHD	6,100	1,641.00	10,010,100	貸付株式数 100株
セブン&アイ・HLDGS	271,000	6,013.00	1,629,523,000	
クリエイト・レストラン ツ・ホール	59,100	1,011.00	59,750,100	貸付株式数 23,600株
明治電機工業	2,900	1,330.00	3,857,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ツルハホールディングス	16,500	9,903.00	163,399,500	貸付株式数 6,600株
デリカフーズHLDGS	2,400	588.00	1,411,200	貸付株式数 1,000株
スターティアホールディングス	1,200	1,186.00	1,423,200	貸付株式数 500株
サンマルクホールディングス	6,300	1,895.00	11,938,500	
フェリシモ	1,400	1,005.00	1,407,000	貸付株式数 500株
トリドールホールディングス	19,600	3,035.00	59,486,000	貸付株式数 7,800株
帝人	71,500	1,340.50	95,845,750	
東レ	498,800	771.70	384,923,960	
クラレ	118,400	1,333.00	157,827,200	
旭化成	464,900	966.40	449,279,360	
TOKYO BASE	8,100	460.00	3,726,000	貸付株式数 3,200株
稲葉製作所	4,000	1,482.00	5,928,000	貸付株式数 1,700株
宮地エンジニアリングG	2,100	3,960.00	8,316,000	貸付株式数 800株
トーカロ	21,100	1,396.00	29,455,600	
アルファCO	2,200	1,081.00	2,378,200	貸付株式数 800株
SUMCO	146,000	2,040.00	297,840,000	貸付株式数 22,500株
川田テクノロジーズ	1,800	5,180.00	9,324,000	
RS TECHNOLOGIES	5,100	3,235.00	16,498,500	
ジェイテックコーポレーション	800	2,667.00	2,133,600	
信和	3,300	729.00	2,405,700	貸付株式数 1,300株
ビーロット	3,900	641.00	2,499,900	貸付株式数 2,000株
ファーストブラザーズ	1,100	929.00	1,021,900	貸付株式数 500株
AND DOホールディングス	4,400	1,159.00	5,099,600	貸付株式数 1,700株
シーアールイー	4,100	1,322.00	5,420,200	貸付株式数 1,100株
プロパティエージェント	700	1,166.00	816,200	貸付株式数 200株
ケイアイスター不動産	3,500	4,840.00	16,940,000	貸付株式数 1,400株 (400株)
アグレ都市デザイン	1,000	1,507.00	1,507,000	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,800	4,735.00	8,523,000	
ロードスターキャピタル	4,200	1,590.00	6,678,000	貸付株式数 1,600株
テンポイノベーション	1,700	1,072.00	1,822,400	貸付株式数 400株
グローバルリンクマネジメント	1,100	1,287.00	1,415,700	貸付株式数 500株
フェイスネットワーク	1,600	1,341.00	2,145,600	貸付株式数 600株
住江織物	1,200	2,174.00	2,608,800	貸付株式数 400株
日本フエルト	3,200	413.00	1,321,600	貸付株式数 800株
イチカワ	700	1,336.00	935,200	貸付株式数 100株
エコナックホールディングス	10,200	97.00	989,400	貸付株式数 4,500株
日東製網	600	1,392.00	835,200	貸付株式数 100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
芦森工業	1,100	1,789.00	1,967,900	
アツギ	3,400	412.00	1,400,800	
ウイルプラスHLDGS	1,000	1,104.00	1,104,000	貸付株式数 500株
JMホールディングス	5,900	1,986.00	11,717,400	
コメダホールディングス	19,300	2,678.00	51,685,400	貸付株式数 7,300株
サツドラホールディングス	2,800	764.00	2,139,200	貸付株式数 1,300株
アレンザホールディングス	5,900	994.00	5,864,600	貸付株式数 2,200株
串カツ田中HLDGS	2,100	1,676.00	3,519,600	
バロックジャパン	5,100	838.00	4,273,800	貸付株式数 2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,000	7,189.00	50,323,000	
ダイニック	1,500	716.00	1,074,000	
共和レザー	3,300	529.00	1,745,700	
ピーバンドットコム	900	472.00	424,800	貸付株式数 300株
力の源HD	3,500	1,500.00	5,250,000	
FOOD&LIFE COMPANY	41,900	3,360.00	140,784,000	貸付株式数 17,200株
アセンテック	2,600	701.00	1,822,600	貸付株式数 900株
セーレン	14,400	2,300.00	33,120,000	貸付株式数 5,700株
ソトー	1,800	801.00	1,441,800	貸付株式数 1,100株
東海染工	600	1,115.00	669,000	貸付株式数 100株
小松マテーレ	10,800	661.00	7,138,800	貸付株式数 500株
ワコールホールディングス	14,300	2,950.00	42,185,000	
ホギメディカル	10,000	3,240.00	32,400,000	
クラウドディアHLDGS	1,300	669.00	869,700	貸付株式数 500株
T S Iホールディングス	25,100	669.00	16,791,900	
マツオカコーポレーション	1,600	1,105.00	1,768,000	貸付株式数 600株
ワールド	9,600	1,518.00	14,572,800	
T I S	81,500	3,855.00	314,182,500	
JNSホールディングス	2,600	426.00	1,107,600	貸付株式数 1,000株
グリー	20,000	689.00	13,780,000	
GMOペパボ	1,100	1,740.00	1,914,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	46,700	2,398.00	111,986,600	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	3,700	5,220.00	19,314,000	
ボルテージ	1,600	302.00	483,200	貸付株式数 800株
電算	700	1,616.00	1,131,200	貸付株式数 100株
AGS	2,400	704.00	1,689,600	貸付株式数 1,000株
ファインデックス	5,900	595.00	3,510,500	
ブレインパッド	5,600	1,015.00	5,684,000	貸付株式数 2,100株
KL a b	14,900	351.00	5,229,900	貸付株式数 5,900株
ポールトゥウィンホールディングン	12,700	961.00	12,204,700	
ネクソン	193,100	2,960.50	571,672,550	
アイスタイル	21,700	518.00	11,240,600	貸付株式数 8,600株
エムアップホールディングス	9,100	1,099.00	10,000,900	貸付株式数 3,600株 (3,400株)
エイチーム	4,400	743.00	3,269,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
エニグモ	9,500	393.00	3,733,500	
テクノスジャパン	4,800	598.00	2,870,400	貸付株式数 100株
e n i s h	4,400	918.00	4,039,200	貸付株式数 1,700株
コロプラ	28,900	685.00	19,796,500	
オルトプラス	4,400	227.00	998,800	貸付株式数 2,100株
ブロードリーフ	43,500	424.00	18,444,000	貸付株式数 2,000株
クロス・マーケティングG	3,500	740.00	2,590,000	貸付株式数 1,500株
デジタルハーツHLDGS	4,600	1,323.00	6,085,800	
システム情報	5,900	740.00	4,366,000	貸付株式数 800株
メディアドウ	3,000	1,435.00	4,305,000	
じげん	21,700	729.00	15,819,300	貸付株式数 700株
ブイキューブ	8,900	507.00	4,512,300	貸付株式数 3,500株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	503.00	653,900	貸付株式数 600株
サイバーリンクス	1,900	690.00	1,311,000	貸付株式数 1,000株
ディー・エル・イー	4,300	309.00	1,328,700	
フィックスターズ	8,400	1,413.00	11,869,200	
CARTA HOLDING GS	3,500	1,336.00	4,676,000	貸付株式数 1,400株
オプティム	6,100	1,054.00	6,429,400	貸付株式数 600株
セレス	3,000	1,046.00	3,138,000	貸付株式数 1,200株
SHIFT	5,000	25,810.00	129,050,000	
特種東海製紙	3,300	3,175.00	10,477,500	
ティーガイア	7,800	1,700.00	13,260,000	貸付株式数 1,300株
セック	800	3,220.00	2,576,000	
テクマトリックス	13,600	1,869.00	25,418,400	
プロシップ	3,300	1,427.00	4,709,100	貸付株式数 1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	21,800	2,814.50	61,356,100	貸付株式数 1,500株
GMOペイメントゲートウェイ	14,900	11,090.00	165,241,000	
ザッパラス	1,600	343.00	548,800	貸付株式数 1,000株
システムリサーチ	2,300	2,460.00	5,658,000	貸付株式数 200株
インターネットイニシアティブ	41,600	2,823.00	117,436,800	
さくらインターネット	8,400	675.00	5,670,000	貸付株式数 3,300株
ヴィンクス	1,700	1,453.00	2,470,100	
GMOグローバルサインHD	2,300	3,360.00	7,728,000	貸付株式数 900株
SRAホールディングス	3,800	3,135.00	11,913,000	
システムインテグレータ	1,700	426.00	724,200	貸付株式数 900株
朝日ネット	8,000	608.00	4,864,000	
eBASE	10,500	795.00	8,347,500	
アバントグループ	9,400	1,488.00	13,987,200	
アドソル日進	3,100	1,787.00	5,539,700	
ODKソリューションズ	1,300	579.00	752,700	貸付株式数 600株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
フリービット	3,900	1,623.00	6,329,700	
コムチュア	9,900	2,183.00	21,611,700	貸付株式数 800株
サイバーコム	900	1,539.00	1,385,100	貸付株式数 400株
アステリア	5,800	724.00	4,199,200	貸付株式数 2,300株
アイル	3,500	2,759.00	9,656,500	貸付株式数 1,500株
王子ホールディングス	310,100	547.90	169,903,790	
日本製紙	38,800	1,191.00	46,210,800	
三菱製紙	7,000	496.00	3,472,000	
北越コーポレーション	47,000	924.00	43,428,000	貸付株式数 18,800株
中越パルプ	2,300	1,255.00	2,886,500	貸付株式数 900株
巴川製紙	1,800	656.00	1,180,800	貸付株式数 700株
大王製紙	32,900	1,132.00	37,242,800	
阿波製紙	1,400	556.00	778,400	貸付株式数 600株
マークラインズ	4,000	2,469.00	9,876,000	
メディカル・データ・ビジ	11,100	715.00	7,936,500	貸付株式数 4,400株
gumi	11,000	717.00	7,887,000	貸付株式数 4,300株
ショーケース	1,300	355.00	461,500	貸付株式数 600株
モバイルファクトリー	1,200	906.00	1,087,200	貸付株式数 500株
テラスカイ	3,200	2,478.00	7,929,600	貸付株式数 1,200株
デジタル・インフォメーシ ョン	4,300	1,604.00	6,897,200	
P C Iホールディングス	2,200	1,034.00	2,274,800	貸付株式数 200株
アイビーシー	900	635.00	571,500	貸付株式数 400株
ネオジャパン	2,500	958.00	2,395,000	貸付株式数 900株
P R T I M E S	1,900	1,432.00	2,720,800	貸付株式数 400株
ラクス	35,300	2,321.50	81,948,950	
ランドコンピュータ	1,400	1,302.00	1,822,800	
ダブルスタンダード	3,000	2,497.00	7,491,000	
オープンドア	5,200	1,214.00	6,312,800	貸付株式数 2,000株
マイネット	1,900	335.00	636,500	貸付株式数 700株
アカツキ	3,500	2,120.00	7,420,000	
ベネフィットジャパン	300	1,224.00	367,200	貸付株式数 200株
U B I C O Mホールディン グス	2,300	1,918.00	4,411,400	貸付株式数 600株
カナミックネットワーク	8,000	450.00	3,600,000	
ノムラシステムコーポレー ション	5,400	117.00	631,800	貸付株式数 2,900株
レンゴー	67,800	851.00	57,697,800	
トーモク	4,300	1,909.00	8,208,700	
ザ・パック	5,500	3,010.00	16,555,000	貸付株式数 2,100株
チェンジホールディングス	18,300	2,098.00	38,393,400	
シンクロ・フード	3,700	682.00	2,523,400	貸付株式数 200株
オークネット	3,700	1,665.00	6,160,500	貸付株式数 1,500株
キャピタル・アセット・プ ラン	1,100	683.00	751,300	貸付株式数 500株
セグエグループ	1,600	1,111.00	1,777,600	貸付株式数 700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
エイトレッド	900	1,405.00	1,264,500	貸付株式数 400株
マクロミル	14,600	869.00	12,687,400	
ビーグリー	1,000	1,146.00	1,146,000	
オロ	2,200	2,411.00	5,304,200	貸付株式数 800株
ユーザーローカル	2,700	2,501.00	6,752,700	貸付株式数 1,000株
テモナ	1,300	255.00	331,500	貸付株式数 500株
ニーズウェル	3,200	708.00	2,265,600	貸付株式数 1,400株
マネーフォワード	18,000	6,279.00	113,022,000	貸付株式数 6,600株
サインポスト	2,200	499.00	1,097,800	貸付株式数 900株
レゾナック・ホールディング	71,900	2,245.00	161,415,500	
住友化学	552,300	428.10	236,439,630	
住友精化	3,100	4,190.00	12,989,000	
日産化学	35,300	6,283.00	221,789,900	
ラサ工業	2,900	2,060.00	5,974,000	
クレハ	6,400	8,440.00	54,016,000	
多木化学	2,900	4,345.00	12,600,500	貸付株式数 1,100株
テイカ	5,000	1,266.00	6,330,000	
石原産業	13,500	1,269.00	17,131,500	
片倉コープアグリ	1,200	1,246.00	1,495,200	貸付株式数 400株
日本曹達	8,000	4,710.00	37,680,000	
東ソー	99,400	1,653.50	164,357,900	
トクヤマ	24,000	2,233.50	53,604,000	
セントラル硝子	11,900	3,160.00	37,604,000	
東亜合成	37,300	1,263.50	47,128,550	
大阪ソーダ	4,500	4,280.00	19,260,000	
関東電化	14,400	881.00	12,686,400	
SUN ASTERISK	5,300	1,254.00	6,646,200	貸付株式数 600株
デンカ	27,100	2,617.00	70,920,700	
イビデン	43,100	7,548.00	325,318,800	
信越化学	618,800	4,527.00	2,801,307,600	
日本カーバイド	2,200	1,306.00	2,873,200	
電算システムHD	3,600	3,595.00	12,942,000	
堺化学	5,700	1,848.00	10,533,600	貸付株式数 1,700株
第一稀元素化学工	6,800	918.00	6,242,400	貸付株式数 800株
エア・ウォーター	70,200	1,843.00	129,378,600	
日本酸素HLDGS	72,200	3,033.00	218,982,600	
日本化学工業	2,500	1,836.00	4,590,000	
東邦アセチレン	1,200	1,302.00	1,562,400	
日本パーカライジング	36,900	1,062.00	39,187,800	
高压ガス	10,800	718.00	7,754,400	
チタン工業	700	1,386.00	970,200	貸付株式数 200株
四国化成ホールディング	8,800	1,480.00	13,024,000	
戸田工業	1,700	2,365.00	4,020,500	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	4,400	2,990.00	13,156,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
保土谷化学	2,100	3,230.00	6,783,000	貸付株式数 100株
日本触媒	11,300	5,345.00	60,398,500	
大日精化	5,200	1,902.00	9,890,400	
カネカ	17,000	3,893.00	66,181,000	貸付株式数 600株
協和キリン	90,100	2,756.00	248,315,600	
APPIER GROUP	28,200	1,497.00	42,215,400	
三菱瓦斯化学	55,600	2,067.50	114,953,000	
三井化学	61,400	3,712.00	227,916,800	
JSR	69,500	3,378.00	234,771,000	
東京応化工業	13,000	8,563.00	111,319,000	
大阪有機化学	5,600	2,588.00	14,492,800	
三菱ケミカルグループ	502,400	810.30	407,094,720	
KHネオケム	12,400	2,320.00	28,768,000	
ダイセル	109,500	1,213.50	132,878,250	
住友ベークライト	11,000	5,624.00	61,864,000	
積水化学	152,300	2,004.00	305,209,200	
日本ゼオン	44,700	1,506.00	67,318,200	貸付株式数 16,200株
アイカ工業	18,800	3,069.00	57,697,200	貸付株式数 1,000株
UBE	38,400	2,302.50	88,416,000	
積水樹脂	10,800	2,142.00	23,133,600	
タキロンシーアイ	16,300	525.00	8,557,500	
旭有機材	5,000	4,075.00	20,375,000	
ニチバン	4,600	1,854.00	8,528,400	
リケンテクノス	16,000	601.00	9,616,000	
大倉工業	3,500	2,045.00	7,157,500	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	10,400	406.00	4,222,400	
群栄化学	1,800	2,535.00	4,563,000	
タイガース ポリマー	2,600	552.00	1,435,200	
ミライアル	1,800	1,678.00	3,020,400	
ダイキアクシス	2,100	712.00	1,495,200	貸付株式数 800株
ダイキョーニシカワ	16,400	760.00	12,464,000	
竹本容器	2,000	803.00	1,606,000	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,800	1,949.00	7,406,200	
恵和	4,800	1,106.00	5,308,800	貸付株式数 1,900株
日本化薬	56,900	1,226.00	69,759,400	
カーリットホールディングス	6,700	741.00	4,964,700	貸付株式数 100株
ソルクシーズ	4,700	450.00	2,115,000	貸付株式数 2,300株
CLホールディングス	2,100	879.00	1,845,900	貸付株式数 800株
プレステージ・インター	32,200	634.00	20,414,800	
フェイス	1,600	504.00	806,400	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	9,300	1,125.00	10,462,500	
ハイマックス	2,300	1,417.00	3,259,100	
アミューズ	4,100	1,783.00	7,310,300	
野村総合研究所	148,500	3,657.00	543,064,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ドリームインキュベータ	2,300	2,764.00	6,357,200	貸付株式数 900株
サイバネットシステム	6,200	879.00	5,449,800	
クイック	5,800	2,012.00	11,669,600	
TAC	2,900	200.00	580,000	貸付株式数 900株
CEホールディングス	3,000	574.00	1,722,000	
日本システム技術	2,400	2,323.00	5,575,200	
電通グループ	75,100	4,632.00	347,863,200	
インテージホールディングス	8,400	1,623.00	13,633,200	
テイクアンドギヴニーズ	2,300	1,101.00	2,532,300	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	1,600	1,161.00	1,857,600	貸付株式数 700株
ぴあ	2,600	3,320.00	8,632,000	貸付株式数 1,000株
イオンファンタジー	3,300	3,645.00	12,028,500	貸付株式数 1,100株
ソースネクスト	37,900	206.00	7,807,400	貸付株式数 15,100株
シーティーエス	8,400	716.00	6,014,400	
ネクシィーズグループ	1,800	659.00	1,186,200	
インフォコム	9,600	2,282.00	21,907,200	
メディカルシステムネットワーク	6,800	375.00	2,550,000	
日本精化	4,200	2,600.00	10,920,000	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	6,900	4,035.00	27,841,500	
トリケミカル	9,900	2,626.00	25,997,400	
シンプレクスHD	12,700	2,398.00	30,454,600	
HEROZ	2,500	1,807.00	4,517,500	貸付株式数 1,000株
ラクスル	17,900	1,361.00	24,361,900	貸付株式数 8,300株
メルカリ	44,900	2,925.00	131,332,500	
I P S	2,400	2,326.00	5,582,400	貸付株式数 900株
F I G	6,700	280.00	1,876,000	貸付株式数 2,800株
システムサポート	2,900	1,905.00	5,524,500	貸付株式数 1,100株
ADEKA	26,000	2,538.50	66,001,000	
日油	23,000	6,122.00	140,806,000	貸付株式数 3,400株
ミヨシ油脂	2,000	985.00	1,970,000	
新日本理化	8,000	218.00	1,744,000	貸付株式数 3,200株 (100株)
ハリマ化成グループ	4,100	849.00	3,480,900	
イーソル	4,800	980.00	4,704,000	貸付株式数 1,800株
アルテリア・ネットワークス	6,900	1,967.00	13,572,300	
東海ソフト	900	1,013.00	911,700	貸付株式数 400株
ウイングアーク1ST	7,700	2,619.00	20,166,300	貸付株式数 100株
ヒト・コミュニケーションズHD	2,000	1,517.00	3,034,000	貸付株式数 800株
サーバーワークス	1,500	2,342.00	3,513,000	貸付株式数 600株
東名	400	2,144.00	857,600	貸付株式数 200株
ヴィッツ	600	1,365.00	819,000	
トビラシステムズ	1,400	1,028.00	1,439,200	貸付株式数 600株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
S a n s a n	24,400	1,790.00	43,676,000	
L i n k - U	1,400	1,049.00	1,468,600	
ギフトィ	8,100	1,989.00	16,110,900	貸付株式数 3,200株
花 王	181,300	5,024.00	910,851,200	
第一工業製薬	2,700	1,793.00	4,841,100	
石原ケミカル	3,400	1,624.00	5,521,600	
日華化学	2,300	846.00	1,945,800	貸付株式数 800株
ニイタカ	1,000	2,097.00	2,097,000	貸付株式数 500株
三洋化成	4,600	4,145.00	19,067,000	貸付株式数 300株
メドレー	10,000	5,150.00	51,500,000	
ベース	2,500	5,750.00	14,375,000	
JMDC	12,200	5,696.00	69,491,200	
武田薬品	659,700	4,497.00	2,966,670,900	
アステラス製薬	704,200	2,287.50	1,610,857,500	
住友ファーマ	55,300	648.00	35,834,400	
塩野義製薬	94,000	6,383.00	600,002,000	
わかもと製薬	5,400	230.00	1,242,000	貸付株式数 2,800株
日本新薬	17,600	6,556.00	115,385,600	
中外製薬	233,300	3,923.00	915,235,900	
科研製薬	12,800	3,628.00	46,438,400	貸付株式数 500株
エーザイ	90,700	9,800.00	888,860,000	
理研ビタミン	6,300	2,041.00	12,858,300	
ロート製薬	72,200	3,082.00	222,520,400	
小野薬品	143,800	2,757.00	396,456,600	貸付株式数 57,500株
久光製薬	16,600	3,630.00	60,258,000	貸付株式数 6,500株
有機合成薬品	4,200	295.00	1,239,000	貸付株式数 1,100株
持田製薬	8,600	3,355.00	28,853,000	貸付株式数 100株
参天製薬	135,800	1,295.00	175,861,000	
扶桑薬品	2,400	1,985.00	4,764,000	
日本ケミファ	600	1,828.00	1,096,800	貸付株式数 200株
ツムラ	23,500	2,816.00	66,176,000	
テ ル モ	228,600	4,444.00	1,015,898,400	
HUグループHD	22,400	2,736.00	61,286,400	
キッセイ薬品工業	11,500	2,913.00	33,499,500	貸付株式数 400株
生化学工業	14,200	759.00	10,777,800	
栄研化学	12,100	1,525.00	18,452,500	
鳥居薬品	4,000	3,550.00	14,200,000	
JCRファーマ	25,200	1,418.50	35,746,200	貸付株式数 9,900株
東和薬品	11,500	1,771.00	20,366,500	
富士製薬工業	5,500	1,145.00	6,297,500	
ゼリア新薬工業	10,300	2,400.00	24,720,000	
そーせいグループ	25,600	3,060.00	78,336,000	
第一三共	649,400	4,809.00	3,122,964,600	
杏林製薬	16,200	1,737.00	28,139,400	
大幸薬品	14,300	384.00	5,491,200	貸付株式数 5,300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダイト	5,200	2,358.00	12,261,600	
大塚ホールディングス	170,500	5,332.00	909,106,000	
大正製薬HD	16,600	5,274.00	87,548,400	
ペプチドリーム	36,100	2,437.50	87,993,750	
大日本塗料	9,100	889.00	8,089,900	貸付株式数 3,100株
日本ペイントHOLD	329,400	1,157.00	381,115,800	
関西ペイント	68,200	2,157.00	147,107,400	
神東塗料	4,800	130.00	624,000	貸付株式数 1,800株
中国塗料	12,200	1,098.00	13,395,600	
日本特殊塗料	3,700	1,008.00	3,729,600	
藤倉化成	10,000	423.00	4,230,000	
太陽ホールディングス	11,300	2,583.00	29,187,900	貸付株式数 2,800株
D I C	29,100	2,555.00	74,350,500	
サカタインクス	16,600	1,243.00	20,633,800	貸付株式数 4,700株
東洋インキSCホールディングン	14,600	2,172.00	31,711,200	
T&K TOKA	6,600	1,200.00	7,920,000	
アルプス技研	6,600	2,861.00	18,882,600	貸付株式数 1,000株
サニックス	12,300	318.00	3,911,400	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
日本空調サービス	8,200	737.00	6,043,400	貸付株式数 300株
オリエンタルランド	404,300	5,388.00	2,178,368,400	
フォーカスシステムズ	5,400	1,059.00	5,718,600	
ダスキン	17,000	3,142.00	53,414,000	
パーク24	57,000	2,163.00	123,291,000	
明光ネットワークジャパン	9,300	634.00	5,896,200	貸付株式数 200株
ファルコホールディングス	3,400	1,831.00	6,225,400	貸付株式数 400株
クレスコ	5,800	1,947.00	11,292,600	貸付株式数 100株
フジ・メディア・HD	71,600	1,369.50	98,056,200	
秀英予備校	1,300	407.00	529,100	貸付株式数 500株
田谷	1,000	460.00	460,000	貸付株式数 400株
ラウンドワン	63,900	655.00	41,854,500	貸付株式数 24,700株
リゾートトラスト	30,200	2,135.50	64,492,100	貸付株式数 6,300株
オービック	24,900	23,925.00	595,732,500	
ジャストシステム	10,700	4,300.00	46,010,000	
TDCソフト	6,300	1,567.00	9,872,100	貸付株式数 1,600株
Zホールディングス	1,060,800	359.10	380,933,280	
ビー・エム・エル	9,500	3,120.00	29,640,000	
トレンドマイクロ	43,100	7,035.00	303,208,500	
りらいあコミュニケーション	12,500	1,464.00	18,300,000	
IDホールディングス	5,000	1,143.00	5,715,000	
リソー教育	34,800	309.00	10,753,200	
日本オラル	14,300	11,060.00	158,158,000	
早稲田アカデミー	4,200	1,380.00	5,796,000	貸付株式数 1,600株
アルファシステムズ	2,300	3,550.00	8,165,000	貸付株式数 900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
フューチャー	18,500	1,780.00	32,930,000	貸付株式数 1,300株
CAC HOLDINGS	4,600	1,718.00	7,902,800	
SBテクノロジー	3,200	2,454.00	7,852,800	
トーセ	1,700	782.00	1,329,400	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	78,600	2,318.00	182,194,800	
オービックビジネスC	14,700	5,340.00	78,498,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	40,000	3,742.00	149,680,000	
アイティフォー	9,800	1,020.00	9,996,000	
東京個別指導学院	9,100	524.00	4,768,400	貸付株式数 3,600株
東計電算	1,000	6,470.00	6,470,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	168,800	1,044.00	176,227,200	
楽天グループ	458,300	575.00	263,522,500	貸付株式数 137,600株
エクスネット	800	1,002.00	801,600	貸付株式数 300株
クリーク・アンド・リバー社	4,500	2,051.00	9,229,500	
SBIグローバルアセット	12,500	494.00	6,175,000	
テー・オー・ダブリュー	15,000	325.00	4,875,000	貸付株式数 4,200株
大塚商会	42,200	5,489.00	231,635,800	
サイボウズ	10,300	2,482.00	25,564,600	貸付株式数 100株
山田コンサルティンググループ	3,900	1,757.00	6,852,300	貸付株式数 600株
セントラルスポーツ	2,900	2,451.00	7,107,900	貸付株式数 1,100株
バラカ	2,600	1,924.00	5,002,400	
電通国際情報サービス	9,100	5,260.00	47,866,000	
ACCESS	8,800	1,098.00	9,662,400	
デジタルガレージ	13,200	3,995.00	52,734,000	
イーエムシステムズ	12,400	883.00	10,949,200	
ウェザーニューズ	2,300	6,820.00	15,686,000	貸付株式数 100株
C I J	12,400	526.00	6,522,400	貸付株式数 100株
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,260.00	3,912,000	貸付株式数 600株
日本エンタープライズ	5,900	135.00	796,500	貸付株式数 2,800株
WOWOW	5,600	1,093.00	6,120,800	貸付株式数 700株
スカラ	6,900	792.00	5,464,800	
インテリジェントウェイブ	3,100	754.00	2,337,400	貸付株式数 1,500株
フルキャストホールディングス	7,300	2,385.00	17,410,500	
エン・ジャパン	13,800	2,495.00	34,431,000	貸付株式数 5,500株
あすか製薬HD	7,600	1,248.00	9,484,800	
サワイグループHD	17,000	3,339.00	56,763,000	
富士フイルムホールディングス	143,000	8,807.00	1,259,401,000	
コニカミノルタ	167,700	472.00	79,154,400	
資生堂	155,600	6,506.00	1,012,333,600	
ライオン	89,400	1,378.50	123,237,900	
高砂香料	5,000	2,619.00	13,095,000	
マンダム	16,100	1,477.00	23,779,700	
ミルボン	11,000	4,860.00	53,460,000	貸付株式数 2,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ファンケル	32,600	2,404.50	78,386,700	
コーセー	15,200	14,425.00	219,260,000	貸付株式数 5,700株
コタ	6,900	1,602.00	11,053,800	
シーボン	800	1,575.00	1,260,000	
ポーラ・オルビスHD	38,200	1,957.00	74,757,400	
ノエビアホールディングス	6,600	5,350.00	35,310,000	
アジュバンホールディング	1,400	923.00	1,292,200	貸付株式数 600株
新日本製薬	4,300	1,395.00	5,998,500	
アクシージア	3,800	1,212.00	4,605,600	貸付株式数 1,400株
エステー	5,800	1,523.00	8,833,400	
アグロカネショウ	3,000	1,629.00	4,887,000	貸付株式数 1,200株 (300株)
コニシ	12,400	2,153.00	26,697,200	
長谷川香料	14,200	3,200.00	45,440,000	
星光PMC	3,000	556.00	1,668,000	貸付株式数 100株
小林製薬	21,700	8,044.00	174,554,800	
荒川化学工業	6,300	988.00	6,224,400	
メック	6,100	3,280.00	20,008,000	貸付株式数 2,400株
日本高純度化学	1,900	2,688.00	5,107,200	
タカラバイオ	20,100	1,665.00	33,466,500	
JCU	8,300	3,610.00	29,963,000	
新田ゼラチン	3,600	748.00	2,692,800	貸付株式数 1,500株
OATアグリオ	2,400	1,849.00	4,437,600	貸付株式数 1,000株
デクセリアルズ	21,500	3,092.00	66,478,000	
アース製薬	6,700	5,090.00	34,103,000	貸付株式数 2,200株
北興化学	7,500	924.00	6,930,000	
大成ラミック	2,400	2,879.00	6,909,600	
クミアイ化学	29,600	969.00	28,682,400	
日本農薬	13,700	618.00	8,466,600	貸付株式数 1,100株
富士興産	1,400	1,396.00	1,954,400	
ニチレキ	8,800	1,712.00	15,065,600	
ユシロ化学	3,900	1,038.00	4,048,200	
ビービー・カストロール	2,200	884.00	1,944,800	
富士石油	15,200	263.00	3,997,600	貸付株式数 6,000株
MORESCO	1,900	1,139.00	2,164,100	貸付株式数 200株
出光興産	82,800	2,829.50	234,282,600	
ENEOSホールディングス	1,264,400	478.60	605,141,840	
コスモエネルギーHLDGS	29,500	4,084.00	120,478,000	
テスホールディングス	7,900	1,038.00	8,200,200	貸付株式数 2,600株
インフロニアHD	76,400	1,295.50	98,976,200	
横浜ゴム	42,400	3,055.00	129,532,000	
TOYO TIRE	42,800	1,763.50	75,477,800	
ブリヂストン	238,000	5,792.00	1,378,496,000	
住友ゴム	73,100	1,262.50	92,288,750	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
藤倉コンポジット	4,100	910.00	3,731,000	
オカモト	4,100	3,950.00	16,195,000	
アキレス	4,700	1,418.00	6,664,600	貸付株式数 500株
フコク	3,900	1,205.00	4,699,500	
ニッタ	7,600	3,065.00	23,294,000	
クリエートメディック	1,900	891.00	1,692,900	
住友理工	14,500	797.00	11,556,500	
三ツ星ベルト	10,900	4,050.00	44,145,000	
バンドー化学	11,800	1,283.00	15,139,400	
AGC	75,900	5,165.00	392,023,500	
日本板硝子	38,000	594.00	22,572,000	
石塚硝子	900	1,548.00	1,393,200	貸付株式数 500株
有沢製作所	12,100	1,086.00	13,140,600	貸付株式数 4,700株
日本山村硝子	2,200	845.00	1,859,000	
日本電気硝子	30,400	2,571.00	78,158,400	貸付株式数 5,500株
オハラ	3,500	1,287.00	4,504,500	貸付株式数 1,300株
住友大阪セメント	10,500	3,640.00	38,220,000	
太平洋セメント	47,500	2,520.00	119,700,000	
リソルホールディングス	500	4,725.00	2,362,500	貸付株式数 200株
日本ヒューム	6,500	759.00	4,933,500	
日本コンクリート	14,500	281.00	4,074,500	
三谷セキサン	3,100	5,140.00	15,934,000	
アジアパイルHD	11,600	604.00	7,006,400	
東海カーボン	62,500	1,227.00	76,687,500	貸付株式数 25,000株
日本カーボン	4,300	4,470.00	19,221,000	
東洋炭素	4,700	5,190.00	24,393,000	
ノリタケ	3,700	5,020.00	18,574,000	
TOTO	49,200	4,559.00	224,302,800	
日本碍子	86,700	1,741.00	150,944,700	
日本特殊陶業	56,700	2,647.00	150,084,900	
ダントーホールディングス	4,100	690.00	2,829,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	2,800	19,620.00	54,936,000	
品川リフラクトリーズ	2,100	4,910.00	10,311,000	
黒崎播磨	1,500	6,830.00	10,245,000	
ヨータイ	4,000	1,416.00	5,664,000	
東京窯業	5,300	319.00	1,690,700	貸付株式数 1,800株
ニッカトー	2,600	595.00	1,547,000	貸付株式数 700株
フジミインコーポレーテッド	5,900	9,360.00	55,224,000	貸付株式数 2,300株
クニミネ工業	1,700	928.00	1,577,600	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,049.00	1,153,900	
ニチアス	18,800	2,800.00	52,640,000	
日本製鉄	343,400	2,857.00	981,093,800	
神戸製鋼所	154,200	1,196.00	184,423,200	貸付株式数 1,500株
中山製鋼所	15,800	796.00	12,576,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
合同製鐵	3,800	3,295.00	12,521,000	
J F Eホールディングス	204,900	1,824.50	373,840,050	
東京製鐵	21,500	1,379.00	29,648,500	
共英製鋼	8,700	1,922.00	16,721,400	
大和工業	12,600	5,786.00	72,903,600	
東京鐵鋼	3,600	2,716.00	9,777,600	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,500	1,377.00	4,819,500	貸付株式数 1,200株
淀川製鋼所	8,700	3,060.00	26,622,000	
中部鋼板	6,300	1,821.00	11,472,300	
丸一鋼管	23,300	3,213.00	74,862,900	
モリ工業	1,400	3,290.00	4,606,000	
大同特殊鋼	9,700	5,356.00	51,953,200	
日本高周波	2,000	326.00	652,000	貸付株式数 900株
日本冶金工	5,600	4,040.00	22,624,000	
山陽特殊製鋼	7,600	2,642.00	20,079,200	
愛知製鋼	4,400	2,732.00	12,020,800	
日本金属	1,300	878.00	1,141,400	貸付株式数 400株
大平洋金属	5,400	1,569.00	8,472,600	
新日本電工	45,700	276.00	12,613,200	
栗本鉄工所	3,600	1,973.00	7,102,800	
虹 技	700	1,202.00	841,400	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	600	1,057.00	634,200	貸付株式数 300株
日本製鋼所	20,700	3,018.00	62,472,600	
三菱製鋼	4,800	1,223.00	5,870,400	
日亜鋼業	6,000	313.00	1,878,000	
日本精線	1,000	4,475.00	4,475,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	4,100	607.00	2,488,700	貸付株式数 1,900株
大紀アルミニウム	10,900	1,318.00	14,366,200	
日本軽金属HD	20,700	1,369.00	28,338,300	
三井金属	22,300	3,184.00	71,003,200	
東邦亜鉛	4,500	1,681.00	7,564,500	
三菱マテリアル	51,200	2,440.50	124,953,600	
住友鋳山	88,900	4,520.00	401,828,000	
DOWAホールディングス	17,200	4,318.00	74,269,600	貸付株式数 4,400株
古河機金	11,200	1,482.00	16,598,400	
エス・サイエンス	35,500	24.00	852,000	貸付株式数 15,200株
大阪チタニウム	11,300	3,035.00	34,295,500	貸付株式数 4,400株
東邦チタニウム	13,900	1,962.00	27,271,800	貸付株式数 5,500株
U A C J	10,700	2,630.00	28,141,000	
CKサンエツ	1,800	4,185.00	7,533,000	貸付株式数 100株
古河電工	25,500	2,439.50	62,207,250	
住友電工	264,800	1,697.50	449,498,000	
フジクラ	82,200	1,167.50	95,968,500	
SWCC	8,600	1,915.00	16,469,000	
タツタ電線	15,600	716.00	11,169,600	貸付株式数 900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
カナレ電気	900	1,346.00	1,211,400	貸付株式数 300株
平河ヒューテック	4,400	1,403.00	6,173,200	貸付株式数 1,600株
いよぎんホールディング	87,100	760.90	66,274,390	貸付株式数 5,800株
しずおかフィナンシャル	165,400	1,045.50	172,925,700	
ちゅうぎんフィナンシャ	61,600	874.00	53,838,400	
楽天銀行	24,800	1,891.00	46,896,800	
リョービ	8,200	1,644.00	13,480,800	
アーレステイ	6,600	606.00	3,999,600	
アサヒHD	31,000	1,958.00	60,698,000	
東洋製罐グループHD	45,700	2,136.00	97,615,200	
ホッカンホールディング	4,100	1,346.00	5,518,600	貸付株式数 1,400株
コナ	4,300	885.00	3,805,500	
横河ブリッジHLDGS	9,600	2,331.00	22,377,600	
駒井ハルテック	1,000	1,730.00	1,730,000	
高田機工	500	2,726.00	1,363,000	
三和ホールディング	70,600	1,729.00	122,067,400	
文化シヤッター	22,100	1,122.00	24,796,200	貸付株式数 8,900株
三協立山	8,800	656.00	5,772,800	
アルインコ	5,800	985.00	5,713,000	貸付株式数 1,600株
東洋シヤッター	1,400	574.00	803,600	貸付株式数 300株
LIXIL	111,700	1,854.00	207,091,800	
日本フィルコン	3,900	456.00	1,778,400	
ノーリツ	11,300	1,775.00	20,057,500	
長府製作所	7,700	2,400.00	18,480,000	
リンナイ	41,700	3,048.00	127,101,600	
ユニプレス	13,300	1,018.00	13,539,400	貸付株式数 1,500株
ダイニチ工業	3,000	699.00	2,097,000	
日東精工	11,100	597.00	6,626,700	
三洋工業	700	1,858.00	1,300,600	貸付株式数 200株
岡部	12,300	782.00	9,618,600	貸付株式数 3,100株
ジーテクト	8,500	1,369.00	11,636,500	
東プレ	13,500	1,441.00	19,453,500	
高周波熱錬	11,800	918.00	10,832,400	貸付株式数 2,600株
東京製綱	4,500	1,066.00	4,797,000	
サンコール	5,300	505.00	2,676,500	
モリテックスチル	4,400	265.00	1,166,000	貸付株式数 2,300株
パイオラックス	10,600	1,952.00	20,691,200	
エイチワン	7,900	648.00	5,119,200	
日本発条	67,800	978.40	66,335,520	
中央発条	5,700	696.00	3,967,200	
アドバネクス	700	990.00	693,000	貸付株式数 400株
三浦工業	31,300	3,904.00	122,195,200	貸付株式数 100株
タクマ	23,100	1,467.00	33,887,700	
テクノプロ・ホールディング	45,200	3,272.00	147,894,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
アトラグループ	1,400	181.00	253,400	貸付株式数	600株
インターワークス	1,500	346.00	519,000	貸付株式数	800株
アイ・アールジャパンHD	4,000	1,640.00	6,560,000	貸付株式数	1,300株
Ke e P e r 技研	4,700	5,040.00	23,688,000	貸付株式数	1,800株
ファーストロジック	700	905.00	633,500	貸付株式数	200株
三機サービス	900	1,035.00	931,500	貸付株式数	500株
G u n o s y	6,100	626.00	3,818,600	貸付株式数	2,400株
デザインワン・ジャパン	1,500	173.00	259,500	貸付株式数	200株
イー・ガーディアン	2,900	1,997.00	5,791,300	貸付株式数	1,100株
リブセンス	2,800	253.00	708,400	貸付株式数	1,300株
ジャパンマテリアル	23,400	2,258.00	52,837,200		
ベクトル	12,000	1,345.00	16,140,000		
ウチヤマホールディングス	2,500	308.00	770,000	貸付株式数	200株
チャームケアコーポレーション	6,400	1,212.00	7,756,800	貸付株式数	2,500株
キャリアリンク	2,800	2,827.00	7,915,600	貸付株式数	1,100株
I B J	4,700	673.00	3,163,100	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,800	1,631.00	6,197,800	貸付株式数	400株
バリューHR	6,700	1,451.00	9,721,700	貸付株式数	2,600株
M&Aキャピタルパートナー	6,200	3,115.00	19,313,000		
ライドオンエクスプレスHD	2,700	1,018.00	2,748,600	貸付株式数	900株
E R I ホールディングス	1,500	1,334.00	2,001,000		
アビスト	900	3,100.00	2,790,000	貸付株式数	400株
シグマクシス・ホールディング	11,600	1,215.00	14,094,000		
ウィルグループ	6,400	1,053.00	6,739,200		
エスクローAJ	6,200	143.00	886,600	貸付株式数	2,900株
メドピア	6,700	1,088.00	7,289,600	貸付株式数	2,600株
レアジョブ	1,100	1,026.00	1,128,600	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	565,600	4,486.00	2,537,281,600		
エラン	10,100	854.00	8,625,400		
ツガミ	16,700	1,394.00	23,279,800		
オークマ	7,500	7,081.00	53,107,500		
芝浦機械	7,500	4,750.00	35,625,000		
アマダ	119,800	1,383.00	165,683,400		
アイダエンジニア	15,400	906.00	13,952,400		
TAKISAWA	1,500	1,241.00	1,861,500	貸付株式数	600株
FUJI	32,600	2,374.00	77,392,400	貸付株式数	1,600株
牧野フライス	8,300	5,380.00	44,654,000	貸付株式数	3,300株
オーエスジー	35,800	1,996.00	71,456,800		
ダイジェット	600	865.00	519,000	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	21,000	812.00	17,052,000		
DMG森精機	45,500	2,463.50	112,089,250	貸付株式数	17,700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ソディック	20,700	715.00	14,800,500	
ディスコ	36,100	21,005.00	758,280,500	
日東工器	3,600	1,979.00	7,124,400	
日進工具	6,300	1,153.00	7,263,900	
パンチ工業	5,300	497.00	2,634,100	貸付株式数 2,000 株
富士ダイス	2,700	689.00	1,860,300	貸付株式数 1,200 株
土木管理総合試験	2,500	334.00	835,000	貸付株式数 100 株
日本郵政	919,300	1,009.00	927,573,700	
ベルシステム24HLDGS	10,200	1,403.00	14,310,600	
鎌倉新書	8,700	844.00	7,342,800	貸付株式数 3,400 株 (1,300 株)
SMN	1,400	455.00	637,000	
一蔵	800	571.00	456,800	貸付株式数 400 株
グローバルキッズCOMP	1,100	689.00	757,900	
エアトリ	5,600	2,664.00	14,918,400	貸付株式数 2,200 株
アトラエ	4,500	823.00	3,703,500	
ストライク	3,200	3,515.00	11,248,000	
ソラスト	21,000	627.00	13,167,000	
セラク	2,300	1,534.00	3,528,200	貸付株式数 1,000 株
インソース	16,600	1,333.00	22,127,800	
豊田自動織機	54,300	9,156.00	497,170,800	
豊和工業	3,200	790.00	2,528,000	貸付株式数 1,200 株
石川製作所	1,500	1,318.00	1,977,000	貸付株式数 700 株
東洋機械金属	4,000	631.00	2,524,000	
津田駒工業	1,100	454.00	499,400	貸付株式数 500 株
エンシュウ	1,200	686.00	823,200	貸付株式数 600 株
島精機製作所	11,900	1,783.00	21,217,700	
オプトラン	11,100	2,363.00	26,229,300	
NCホールディングス	1,200	2,224.00	2,668,800	
イワキポンプ	5,000	1,311.00	6,555,000	
フリュー	7,900	1,089.00	8,603,100	貸付株式数 3,000 株
ヤマシンフィルタ	17,900	321.00	5,745,900	貸付株式数 1,300 株
日阪製作所	7,300	881.00	6,431,300	
やまびこ	12,300	1,477.00	18,167,100	
野村マイクロ・サイエンス	2,500	6,340.00	15,850,000	
平田機工	3,600	7,450.00	26,820,000	
PEGASUS	8,300	546.00	4,531,800	貸付株式数 100 株
マルマエ	3,300	1,720.00	5,676,000	貸付株式数 1,400 株 (900 株)
タツモ	4,100	1,950.00	7,995,000	
ナブテスコ	47,100	3,281.00	154,535,100	
三井海洋開発	9,400	1,427.00	13,413,800	
レオン自動機	7,900	1,461.00	11,541,900	
SMC	24,300	81,080.00	1,970,244,000	
ホソカワミクロン	5,300	2,850.00	15,105,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユニオンツール	3,300	3,280.00	10,824,000	
オイレス工業	10,500	1,913.00	20,086,500	貸付株式数 4,000 株
日精エーエスビー	3,000	4,030.00	12,090,000	
サトーホールディングス	10,700	1,952.00	20,886,400	
技研製作所	7,100	2,000.00	14,200,000	貸付株式数 1,300 株
日本エアーテック	3,800	1,199.00	4,556,200	貸付株式数 1,200 株
カワタ	1,700	945.00	1,606,500	
日精樹脂工業	5,600	955.00	5,348,000	
オカダアイヨン	1,800	1,912.00	3,441,600	貸付株式数 800 株
ワイエイシイホールディングス	2,500	3,290.00	8,225,000	貸付株式数 1,100 株
小松製作所	351,700	3,519.00	1,237,632,300	
住友重機械	44,400	3,232.00	143,500,800	
日立建機	29,900	3,749.00	112,095,100	
日工	11,100	635.00	7,048,500	
巴工業	3,200	2,449.00	7,836,800	貸付株式数 1,200 株
井関農機	7,000	1,202.00	8,414,000	
TOWA	7,700	2,441.00	18,795,700	
丸山製作所	1,000	1,804.00	1,804,000	貸付株式数 100 株
北川鉄工所	3,000	1,221.00	3,663,000	
シンニッタン	6,400	238.00	1,523,200	貸付株式数 1,900 株
ローツェ	3,900	11,440.00	44,616,000	貸付株式数 1,500 株
タカキタ	1,600	435.00	696,000	貸付株式数 800 株
クボタ	397,200	2,034.00	807,904,800	
荏原実業	3,600	3,120.00	11,232,000	
東洋エンジニア	9,600	551.00	5,289,600	
三菱化工機	2,400	2,514.00	6,033,600	
月島ホールディングス	10,100	1,181.00	11,928,100	
帝国電機製作所	5,300	2,372.00	12,571,600	
東京機械	1,400	473.00	662,200	
新東工業	15,200	1,109.00	16,856,800	
渋谷工業	7,000	2,601.00	18,207,000	
アイチ コーポレーション	10,500	837.00	8,788,500	
小森コーポレーション	17,400	917.00	15,955,800	
鶴見製作所	5,700	2,510.00	14,307,000	
日本ギア工業	1,900	392.00	744,800	貸付株式数 800 株
酒井重工業	900	4,470.00	4,023,000	
荏原製作所	30,700	6,541.00	200,808,700	
石井鉄工所	700	2,526.00	1,768,200	貸付株式数 200 株
西島製作所	6,500	1,608.00	10,452,000	
北越工業	7,500	1,252.00	9,390,000	
ダイキン工業	89,600	28,915.00	2,590,784,000	
オルガノ	10,300	3,855.00	39,706,500	
トーヨーカネツ	2,900	3,490.00	10,121,000	
栗田工業	42,000	5,871.00	246,582,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
椿本チェーン	10,600	3,470.00	36,782,000	
大同工業	2,300	718.00	1,651,400	貸付株式数 900株
日機装	17,300	888.00	15,362,400	
木村化工機	5,700	731.00	4,166,700	貸付株式数 2,200株
レイズネクスト	10,500	1,381.00	14,500,500	
アネスト岩田	12,800	1,081.00	13,836,800	貸付株式数 100株
ダイフク	116,100	2,975.00	345,397,500	
サムコ	2,000	5,550.00	11,100,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	2,700	1,127.00	3,042,900	貸付株式数 1,000株
油研工業	900	1,982.00	1,783,800	
タダノ	39,600	1,079.50	42,748,200	
フジテック	26,300	3,699.00	97,283,700	貸付株式数 10,200株
CKD	20,800	2,296.00	47,756,800	
平和	25,000	2,405.00	60,125,000	
理想科学工業	6,700	2,331.00	15,617,700	
SANKYO	14,800	6,056.00	89,628,800	
日本金銭機械	8,200	1,134.00	9,298,800	貸付株式数 3,300株
マースグループHLDGS	4,400	3,250.00	14,300,000	
フクシマガリレイ	5,500	5,460.00	30,030,000	
オーイズミ	2,200	488.00	1,073,600	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,100	3,050.00	12,505,000	貸付株式数 1,600株
竹内製作所	13,600	3,985.00	54,196,000	
アマノ	21,300	3,014.00	64,198,200	
JUKI	11,600	579.00	6,716,400	
サンデン	8,700	191.00	1,661,700	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	7,600	595.00	4,522,000	
ブラザー工業	100,300	2,164.50	217,099,350	
マックス	9,200	2,335.00	21,482,000	
モリタホールディングス	13,000	1,541.00	20,033,000	
グローリー	18,000	2,784.00	50,112,000	
新晃工業	7,600	2,005.00	15,238,000	
大和冷機工業	11,500	1,401.00	16,111,500	貸付株式数 3,200株
セガサミーホールディングス	60,300	2,816.50	169,834,950	
日本ピストンリング	2,000	1,395.00	2,790,000	
リケン	3,000	2,766.00	8,298,000	
TPR	8,600	1,474.00	12,676,400	
ツバキ・ナカシマ	18,500	860.00	15,910,000	貸付株式数 7,000株
ホシザキ	48,300	5,199.00	251,111,700	
大豊工業	6,500	833.00	5,414,500	
日本精工	137,900	854.50	117,835,550	
NTN	148,000	291.20	43,097,600	貸付株式数 42,500株
ジェイテクト	66,800	1,199.00	80,093,200	
不二越	5,500	3,940.00	21,670,000	
ミネベアミツミ	130,600	2,753.50	359,607,100	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本トムソン	18,400	575.00	10,580,000	
T H K	43,300	3,082.00	133,450,600	
ユーシン精機	5,900	709.00	4,183,100	
前澤給装工業	5,300	1,119.00	5,930,700	貸付株式数 1,000 株
イーグル工業	8,300	1,532.00	12,715,600	
前澤工業	3,300	757.00	2,498,100	
日本ピラー工業	7,000	4,340.00	30,380,000	
キッツ	27,600	1,064.00	29,366,400	
日立	365,000	8,553.00	3,121,845,000	
東芝	144,500	4,527.00	654,151,500	
三菱電機	775,800	1,953.50	1,515,525,300	
富士電機	45,600	6,119.00	279,026,400	
東洋電機製造	1,900	966.00	1,835,400	
安川電機	88,900	6,399.00	568,871,100	
シンフォニアテクノロジー	8,300	1,663.00	13,802,900	
明電舎	11,400	1,899.00	21,648,600	
オリジン	1,300	1,245.00	1,618,500	
山洋電気	3,200	7,490.00	23,968,000	
デンヨー	5,700	1,894.00	10,795,800	
PHCホールディングス	10,500	1,492.00	15,666,000	
ソシオネクスト	10,300	18,730.00	192,919,000	
ベイカレントコンサルティング	60,500	5,571.00	337,045,500	
ORCHESTRA HLDGS	1,600	1,270.00	2,032,000	
アイモバイル	3,400	1,322.00	4,494,800	貸付株式数 1,500 株
キャリアインデックス	2,000	291.00	582,000	貸付株式数 200 株
MS-Japan	1,900	1,010.00	1,919,000	貸付株式数 900 株
船場	1,000	722.00	722,000	貸付株式数 200 株
ジャパニエレベーターSHD	27,200	1,943.00	52,849,600	
フルテック	800	1,078.00	862,400	
グリーンズ	2,000	1,377.00	2,754,000	
ツナググループHLDGS	1,700	600.00	1,020,000	
GAMEWITH	1,800	398.00	716,400	貸付株式数 800 株
MS&CONSULTING	700	606.00	424,200	貸付株式数 300 株
ウェルビー	5,600	516.00	2,889,600	貸付株式数 2,200 株
エル・ディー・エス	1,000	3,410.00	3,410,000	貸付株式数 300 株
ミダックホールディングス	4,600	1,796.00	8,261,600	貸付株式数 1,800 株
日総工産	5,700	882.00	5,027,400	貸付株式数 900 株
キュービーネットHLDGS	3,600	1,536.00	5,529,600	
RPAホールディングス	10,300	389.00	4,006,700	
三桜工業	11,300	734.00	8,294,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
マキタ	93,400	3,922.00	366,314,800	
東芝テック	11,200	4,325.00	48,440,000	
芝浦メカトロニクス	1,400	17,850.00	24,990,000	貸付株式数 200株
マブチモーター	18,600	3,907.00	72,670,200	
ニデック	182,600	7,400.00	1,351,240,000	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,500	553.00	3,041,500	
トレックス・セミコンダクター	3,500	2,225.00	7,787,500	貸付株式数 1,400株
東光高岳	4,500	2,051.00	9,229,500	
ダブル・スコープ	24,600	1,113.00	27,379,800	貸付株式数 9,800株
宮越ホールディングス	3,300	771.00	2,544,300	貸付株式数 1,100株
ダイヘン	6,800	5,350.00	36,380,000	
ヤーマン	13,000	1,163.00	15,119,000	貸付株式数 5,000株
JVCケンウッド	68,400	502.00	34,336,800	
ミマキエンジニアリング	7,100	758.00	5,381,800	
IPEX	4,200	1,381.00	5,800,200	貸付株式数 1,300株
大崎電気	17,800	548.00	9,754,400	
オムロン	68,800	8,975.00	617,480,000	
日東工業	10,100	3,480.00	35,148,000	
IDEC	11,100	3,265.00	36,241,500	
正興電機製作所	2,200	977.00	2,149,400	貸付株式数 300株
不二電機工業	1,200	1,130.00	1,356,000	貸付株式数 600株 (100株)
ジーエス・ユアサコーポ	24,600	2,578.50	63,431,100	
サクサホールディングス	1,200	1,850.00	2,220,000	
メルコホールディングス	1,900	3,175.00	6,032,500	
テクノメディカ	1,800	1,902.00	3,423,600	貸付株式数 500株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,500	829.00	2,072,500	貸付株式数 1,000株
日本電気	106,200	6,849.00	727,363,800	
富士通	74,800	19,285.00	1,442,518,000	
沖電気	33,900	818.00	27,730,200	
岩崎通信機	2,500	826.00	2,065,000	
電気興業	3,000	2,260.00	6,780,000	
サンケン電気	7,000	11,240.00	78,680,000	
ナカヨ	900	1,093.00	983,700	貸付株式数 400株
アイホン	4,600	2,252.00	10,359,200	
ルネサスエレクトロニクス	489,800	2,485.00	1,217,153,000	
セイコーエプソン	96,300	2,216.50	213,448,950	貸付株式数 38,500株
ワコム	57,100	724.00	41,340,400	貸付株式数 22,600株
アルバック	17,800	5,789.00	103,044,200	
アクセル	2,200	1,614.00	3,550,800	
EIZO	5,500	4,790.00	26,345,000	
ジャパンディスプレイ	61,700	39.00	2,406,300	
日本信号	17,100	1,060.00	18,126,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
京三製作所	15,700	434.00	6,813,800	
能美防災	10,100	1,810.00	18,281,000	
ホーチキ	5,600	1,739.00	9,738,400	
星和電機	2,300	483.00	1,110,900	貸付株式数 1,000 株
エレコム	17,900	1,554.00	27,816,600	
パナソニック ホールディング	886,700	1,604.00	1,422,266,800	
シャープ	90,400	802.00	72,500,800	貸付株式数 36,100 株
アンリツ	52,900	1,215.00	64,273,500	
富士通ゼネラル	21,300	3,280.00	69,864,000	
ソニーグループ	525,800	13,860.00	7,287,588,000	※
T D K	118,900	5,529.00	657,398,100	
帝国通信工業	3,400	1,550.00	5,270,000	
タムラ製作所	32,200	707.00	22,765,400	貸付株式数 1,500 株
アルプスアルパイン	67,000	1,242.00	83,214,000	
池上通信機	1,800	613.00	1,103,400	貸付株式数 700 株
日本電波工業	9,000	1,356.00	12,204,000	貸付株式数 3,600 株
鈴木	4,000	927.00	3,708,000	
メイコー	8,200	2,545.00	20,869,000	
日本トリム	1,700	2,856.00	4,855,200	
ローランド ディー. ジー.	4,100	3,305.00	13,550,500	
フオスター電機	6,900	993.00	6,851,700	
S M K	1,800	2,333.00	4,199,400	
ヨコオ	6,000	1,776.00	10,656,000	
ティアック	8,900	117.00	1,041,300	貸付株式数 1,800 株
ホシデン	17,500	1,755.00	30,712,500	
ヒロセ電機	12,400	19,560.00	242,544,000	
日本航空電子	15,400	2,674.00	41,179,600	貸付株式数 6,100 株
T O A	8,500	857.00	7,284,500	
マクセル	15,200	1,492.00	22,678,400	
古野電気	9,800	1,024.00	10,035,200	
スミダコーポレーション	6,900	1,348.00	9,301,200	貸付株式数 2,700 株
アイコム	2,900	2,940.00	8,526,000	貸付株式数 1,000 株
リオン	3,100	1,864.00	5,778,400	
横河電機	82,100	2,772.00	227,581,200	
新電元工業	2,900	3,310.00	9,599,000	
アズビル	51,900	4,653.00	241,490,700	
東亜ディーケーケー	2,700	821.00	2,216,700	貸付株式数 1,500 株
日本光電工業	34,300	3,775.00	129,482,500	
チノール	3,100	2,324.00	7,204,400	貸付株式数 1,100 株
共和電業	5,400	347.00	1,873,800	
日本電子材料	4,900	1,627.00	7,972,300	
堀場製作所	16,600	7,850.00	130,310,000	
アドバンテスト	58,600	18,330.00	1,074,138,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
小野測器	2,100	438.00	919,800	
エスペック	5,900	2,219.00	13,092,100	
キーエンス	74,400	71,890.00	5,348,616,000	※
日置電機	3,900	9,110.00	35,529,000	
シスメックス	64,100	9,930.00	636,513,000	
日本マイクロニクス	12,200	1,777.00	21,679,400	
メガチップス	6,100	3,550.00	21,655,000	
OBARA GROUP	4,100	4,050.00	16,605,000	貸付株式数 1,600 株
IMAGICA GROUP	6,200	570.00	3,534,000	貸付株式数 2,400 株
澤藤電機	700	1,203.00	842,100	貸付株式数 300 株
デンソー	153,300	9,114.00	1,397,176,200	
原田工業	2,500	801.00	2,002,500	貸付株式数 700 株
コーセル	8,900	1,140.00	10,146,000	
イリソ電子工業	6,800	4,305.00	29,274,000	貸付株式数 2,700 株
オプテックスグループ	13,600	2,014.00	27,390,400	
千代田インテグレ	2,600	2,376.00	6,177,600	
レーザーテック	34,100	21,480.00	732,468,000	
スタンレー電気	52,900	2,963.00	156,742,700	
ウシオ電機	37,800	1,941.00	73,369,800	
岡谷電機	4,500	274.00	1,233,000	貸付株式数 1,900 株
ヘリオステクノH	5,300	652.00	3,455,600	貸付株式数 2,300 株
エノモト	1,500	1,678.00	2,517,000	貸付株式数 600 株
日本セラミック	7,600	2,558.00	19,440,800	
遠藤照明	2,600	1,185.00	3,081,000	
古河電池	5,500	1,070.00	5,885,000	貸付株式数 2,000 株
双信電機	2,300	362.00	832,600	貸付株式数 900 株
山一電機	6,500	2,168.00	14,092,000	
図 研	6,500	3,710.00	24,115,000	
日本電子	18,600	4,942.00	91,921,200	貸付株式数 7,400 株
カ シ オ	55,400	1,201.50	66,563,100	貸付株式数 22,100 株
ファナック	364,800	5,027.00	1,833,849,600	
日本シイエムケイ	15,800	497.00	7,852,600	
エンプラス	2,200	5,600.00	12,320,000	
大真空	9,100	651.00	5,924,100	貸付株式数 3,600 株
ロ ー ム	34,400	12,180.00	418,992,000	
浜松ホトニクス	59,600	7,223.00	430,490,800	
三井ハイテック	7,700	9,410.00	72,457,000	貸付株式数 3,000 株
新光電気工業	26,300	5,622.00	147,858,600	
京 セ ラ	115,500	8,000.00	924,000,000	
協栄産業	600	2,018.00	1,210,800	貸付株式数 200 株
太陽誘電	36,200	4,518.00	163,551,600	
村田製作所	225,400	8,532.00	1,923,112,800	
双葉電子工業	14,200	503.00	7,142,600	
日東電工	54,100	10,365.00	560,746,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北陸電気工業	2,200	1,193.00	2,624,600	
東海理化電機	21,000	1,972.00	41,412,000	
ニチコン	15,200	1,339.00	20,352,800	
日本ケミコン	7,300	1,389.00	10,139,700	
K O A	11,300	1,726.00	19,503,800	貸付株式数 3,800 株
三井E&S	21,700	488.00	10,589,600	
日立造船	61,500	842.00	51,783,000	貸付株式数 3,500 株
三菱重工業	131,300	6,249.00	820,493,700	
川崎重工業	56,000	3,235.00	181,160,000	
I H I	47,300	3,445.00	162,948,500	
名村造船所	14,800	518.00	7,666,400	貸付株式数 7,200 株
サノヤスホールディングス	7,700	131.00	1,008,700	貸付株式数 3,600 株
スプリックス	1,700	807.00	1,371,900	貸付株式数 100 株 (100 株)
マネジメントソリューションズ	4,200	2,996.00	12,583,200	貸付株式数 1,400 株
プロレド・パートナーズ	1,900	518.00	984,200	貸付株式数 700 株
AND FACTORY	1,700	391.00	664,700	貸付株式数 600 株
テノ・ホールディングス	700	699.00	489,300	貸付株式数 300 株
フロンティア・マネジメント	2,600	1,153.00	2,997,800	
ピアラ	1,000	513.00	513,000	貸付株式数 400 株
コプロ・ホールディングス	1,000	1,948.00	1,948,000	貸付株式数 100 株
ギークス	800	774.00	619,200	貸付株式数 500 株
アンビスホールディングス	8,200	3,110.00	25,502,000	
カーブスホールディングス	20,900	716.00	14,964,400	貸付株式数 9,200 株
フォーラムエンジニアリング	4,500	1,163.00	5,233,500	
FAST FITNESS JAP	2,600	1,226.00	3,187,600	
日本車輛	2,900	2,019.00	5,855,100	貸付株式数 300 株
三菱ロジスネクスト	11,900	1,198.00	14,256,200	
近畿車輛	800	1,440.00	1,152,000	貸付株式数 300 株
一家ホールディングス	1,400	609.00	852,600	貸付株式数 600 株
フルサト・マルカHD	7,800	2,390.00	18,642,000	貸付株式数 1,500 株
ヤマエグループHD	4,400	2,601.00	11,444,400	
ジャパクラフトホールディング	1,800	557.00	1,002,600	貸付株式数 900 株
F P G	24,800	1,133.00	28,098,400	貸付株式数 2,700 株
島根銀行	2,000	471.00	942,000	貸付株式数 800 株
じもとホールディングス	5,000	378.00	1,890,000	貸付株式数 1,600 株
全国保証	19,100	5,106.00	97,524,600	貸付株式数 3,800 株
めぶきフィナンシャルG	363,200	343.50	124,759,200	
ジャパンインベストメントA	6,000	1,085.00	6,510,000	貸付株式数 2,400 株
東京きらぼしFG	9,400	3,185.00	29,939,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
九州フィナンシャルG	128,800	529.10	68,148,080	
かんぽ生命保険	88,900	2,127.50	189,134,750	
ゆうちょ銀行	205,100	1,063.50	218,123,850	貸付株式数 1,700 株
あんしん保証	2,800	314.00	879,200	貸付株式数 1,100 株
富山第一銀行	24,300	696.00	16,912,800	貸付株式数 8,800 株
コンコルディア・フィナンシャル	392,800	555.90	218,357,520	
ジェイリース	1,900	2,006.00	3,811,400	
西日本フィナンシャルHD	45,400	1,154.00	52,391,600	
イントラスト	2,200	897.00	1,973,400	
日本モーゲージサービス	3,100	541.00	1,677,100	貸付株式数 1,200 株
C a s a	2,200	880.00	1,936,000	貸付株式数 700 株
アルヒ	9,000	973.00	8,757,000	貸付株式数 3,600 株
プレミアグループ	12,300	1,606.00	19,753,800	
日産自動車	1,055,800	546.20	576,677,960	
いすゞ自動車	216,100	1,702.50	367,910,250	
トヨタ自動車	4,081,100	2,028.50	8,278,511,350	
日野自動車	95,800	627.80	60,143,240	
三菱自動車工業	289,900	481.90	139,702,810	貸付株式数 110,600 株
エフテック	4,000	811.00	3,244,000	
レシップホールディングス	2,300	490.00	1,127,000	貸付株式数 1,100 株
GMB	1,100	2,559.00	2,814,900	貸付株式数 400 株
ファルテック	900	609.00	548,100	貸付株式数 200 株
武蔵精密工業	18,200	1,772.00	32,250,400	貸付株式数 2,400 株
日産車体	13,100	857.00	11,226,700	貸付株式数 5,100 株
新明和工業	23,300	1,264.00	29,451,200	
極東開発工業	12,300	1,643.00	20,208,900	
トピー工業	6,000	2,024.00	12,144,000	
ティラド	1,900	1,789.00	3,399,100	
タチエス	11,800	1,475.00	17,405,000	
N O K	28,900	1,929.00	55,748,100	貸付株式数 11,500 株
フタバ産業	19,900	469.00	9,333,100	
K Y B	7,200	4,525.00	32,580,000	
市光工業	10,700	518.00	5,542,600	
大同メタル工業	14,500	488.00	7,076,000	
プレス工業	33,200	578.00	19,189,600	
ミクニ	6,600	397.00	2,620,200	
太平洋工業	17,000	1,219.00	20,723,000	
河西工業	7,700	157.00	1,208,900	貸付株式数 3,400 株
アイシン	57,300	4,165.00	238,654,500	
マ ツ ダ	245,800	1,278.00	314,132,400	
今仙電機製作所	3,700	640.00	2,368,000	
本田技研	604,200	4,185.00	2,528,577,000	※
スズキ	136,500	4,827.00	658,885,500	
SUBARU	235,200	2,530.50	595,173,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
安永	2,500	921.00	2,302,500	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	116,800	3,701.00	432,276,800	
小糸製作所	89,400	2,742.00	245,134,800	貸付株式数 11,100株
TBK	5,700	339.00	1,932,300	
エクセディ	12,200	2,181.00	26,608,200	
ミツバ	13,900	714.00	9,924,600	
豊田合成	21,700	2,347.00	50,929,900	
愛三工業	12,300	1,007.00	12,386,100	
盟和産業	800	959.00	767,200	貸付株式数 300株
日本プラスト	4,500	431.00	1,939,500	貸付株式数 500株
ヨロズ	7,000	819.00	5,733,000	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	13,200	1,747.00	23,060,400	
新家工業	1,300	2,208.00	2,870,400	
シマノ	30,400	23,210.00	705,584,000	
テイ・エス テック	34,000	1,830.00	62,220,000	
33FG	6,500	1,542.00	10,023,000	
第四北越フィナンシャルG	11,500	3,045.00	35,017,500	
ひろぎんHLDGS	95,500	770.20	73,554,100	
マーキュリアホールディングス	3,300	716.00	2,362,800	貸付株式数 1,300株
おきなわFG	7,000	2,164.00	15,148,000	
ダイレクトマーケティングミクス	9,200	974.00	8,960,800	
ポピンズ	1,100	1,595.00	1,754,500	
LITALICO	5,900	2,516.00	14,844,400	
十六FG	9,500	3,185.00	30,257,500	
北國FHD	8,200	4,630.00	37,966,000	貸付株式数 2,600株
ネットプロHD	24,200	358.00	8,663,600	貸付株式数 9,600株
プロクレアホールディングス	9,000	2,160.00	19,440,000	
あいちフィナンシャルグル	10,200	2,212.00	22,562,400	
ジャムコ	3,100	1,460.00	4,526,000	貸付株式数 1,800株
小野建	7,700	1,521.00	11,711,700	
はるやまHLDGS	2,600	478.00	1,242,800	貸付株式数 1,100株
南陽	1,200	2,131.00	2,557,200	貸付株式数 500株
ノジマ	25,700	1,386.00	35,620,200	
佐鳥電機	3,800	1,648.00	6,262,400	貸付株式数 1,100株
カップ・クリエイト	12,400	1,508.00	18,699,200	貸付株式数 4,900株
エコートレーディング	1,200	784.00	940,800	
伯東	4,500	4,960.00	22,320,000	貸付株式数 1,300株
コンドーテック	6,000	1,094.00	6,564,000	貸付株式数 2,200株
中山福	3,200	335.00	1,072,000	
ライトオン	4,600	566.00	2,603,600	貸付株式数 1,900株
ナガイレーベン	9,900	2,128.00	21,067,200	貸付株式数 200株
三菱食品	7,300	3,610.00	26,353,000	
良品計画	85,800	1,394.00	119,605,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
パリミキホールディングス	7,600	322.00	2,447,200	貸付株式数 300株
松田産業	6,000	2,128.00	12,768,000	
第一興商	30,400	2,506.50	76,197,600	
メディパルHD	75,200	2,263.50	170,215,200	
アドヴァングループ	7,500	963.00	7,222,500	
S P K	3,500	1,717.00	6,009,500	
萩原電気HLDGS	3,000	3,045.00	9,135,000	
アルビス	2,600	2,374.00	6,172,400	
アズワン	11,200	5,570.00	62,384,000	
スズデン	2,700	2,220.00	5,994,000	
尾家産業	1,400	1,193.00	1,670,200	貸付株式数 500株
シモジマ	5,400	1,099.00	5,934,600	貸付株式数 1,700株
ドウシシャ	8,300	2,166.00	17,977,800	
小津産業	1,400	1,625.00	2,275,000	貸付株式数 600株
コナカ	6,700	358.00	2,398,600	
高速	4,100	2,005.00	8,220,500	
ハウス ローゼ	800	1,602.00	1,281,600	
G-7ホールディングス	9,800	1,299.00	12,730,200	
たけびし	3,000	1,646.00	4,938,000	
イオン北海道	11,600	844.00	9,790,400	貸付株式数 4,600株
コジマ	13,000	552.00	7,176,000	貸付株式数 5,900株
ヒマラヤ	1,900	938.00	1,782,200	貸付株式数 900株
コーナン商事	10,600	3,535.00	37,471,000	
ネットワンシステムズ	27,800	3,361.00	93,435,800	
エコス	2,900	1,871.00	5,425,900	貸付株式数 1,000株
ワタミ	9,500	917.00	8,711,500	貸付株式数 2,500株
マルシェ	2,000	258.00	516,000	貸付株式数 800株
リックス	1,300	2,774.00	3,606,200	
システムソフト	25,700	76.00	1,953,200	貸付株式数 4,700株
パンパシフィックHD	158,800	2,535.00	402,558,000	
丸文	7,000	1,231.00	8,617,000	
西松屋チェーン	17,400	1,657.00	28,831,800	貸付株式数 5,600株
ゼンショーホールディングス	43,000	6,000.00	258,000,000	
ハピネット	6,700	2,007.00	13,446,900	
幸楽苑ホールディングス	5,100	1,034.00	5,273,400	貸付株式数 900株
ハークスレイ	2,100	653.00	1,371,300	
橋本総業HLDGS	3,100	1,113.00	3,450,300	貸付株式数 1,100株
日本ライフライン	23,000	1,048.00	24,104,000	
サイゼリヤ	11,600	3,560.00	41,296,000	貸付株式数 3,700株
タカショー	6,800	684.00	4,651,200	貸付株式数 2,600株
V Tホールディングス	29,900	508.00	15,189,200	
アルゴグラフィックス	6,800	4,180.00	28,424,000	貸付株式数 100株
魚力	2,400	2,167.00	5,200,800	貸付株式数 800株
I DOM	23,800	840.00	19,992,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本エム・ディ・エム	4,400	949.00	4,175,600	
ポプラ	1,700	206.00	350,200	貸付株式数 700株
フジ・コーポレーション	4,400	1,394.00	6,133,600	
ユナイテッドアローズ	8,400	2,351.00	19,748,400	貸付株式数 1,000株
進和	4,800	2,117.00	10,161,600	貸付株式数 1,500株
エスケイジャパン	1,500	540.00	810,000	
ダイトロン	3,100	2,920.00	9,052,000	
ハイデイ日高	11,700	2,332.00	27,284,400	貸付株式数 3,000株
シークス	11,200	1,511.00	16,923,200	貸付株式数 4,100株
YU-WA CREAT I ON H	3,600	196.00	705,600	貸付株式数 500株
コロナイド	36,200	2,028.00	73,413,600	貸付株式数 14,500株
ピーシーデポコーポ	8,700	479.00	4,167,300	
田中商事	1,700	606.00	1,030,200	貸付株式数 300株
オーハシテクニカ	3,800	1,549.00	5,886,200	
老番屋	6,200	5,390.00	33,418,000	貸付株式数 2,400株
白銅	2,800	2,343.00	6,560,400	貸付株式数 1,000株
トップカルチャー	2,000	187.00	374,000	貸付株式数 800株
PLANT	1,400	699.00	978,600	貸付株式数 400株
スギホールディングス	15,800	5,951.00	94,025,800	
ダイコー通産	600	1,117.00	670,200	貸付株式数 200株
薬王堂ホールディングス	4,400	2,566.00	11,290,400	
島津製作所	90,500	4,505.00	407,702,500	
J M S	6,900	537.00	3,705,300	
クボテック	1,300	212.00	275,600	貸付株式数 700株
長野計器	5,400	1,895.00	10,233,000	
ブイ・テクノロジー	3,600	2,604.00	9,374,400	
スター精密	14,200	1,862.00	26,440,400	
東京計器	5,700	1,253.00	7,142,100	貸付株式数 2,200株
愛知時計	2,900	1,591.00	4,613,900	
インターアクション	3,500	1,430.00	5,005,000	貸付株式数 1,200株
オーバル	5,100	387.00	1,973,700	貸付株式数 2,200株
東京精密	16,300	6,290.00	102,527,000	
マニー	29,700	1,717.50	51,009,750	貸付株式数 10,300株
ニコン	107,500	1,595.50	171,516,250	
トプコン	39,100	1,971.00	77,066,100	
オリンパス	457,500	2,212.50	1,012,218,750	
理研計器	4,600	5,010.00	23,046,000	貸付株式数 2,100株
S C R E E Nホールディン グス	12,700	15,050.00	191,135,000	
キヤノン電子	8,200	1,911.00	15,670,200	
タムロン	5,600	3,600.00	20,160,000	
HOYA	158,700	18,320.00	2,907,384,000	
シード	2,900	560.00	1,624,000	貸付株式数 1,500株
ノーリツ鋼機	7,000	2,194.00	15,358,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
A&Dホロンホールディングス	10,800	1,694.00	18,295,200	
朝日インテック	83,000	2,872.00	238,376,000	貸付株式数 31,600株
キヤノン	407,800	3,567.00	1,454,622,600	
リコー	186,400	1,203.00	224,239,200	
シチズン時計	81,700	893.00	72,958,100	貸付株式数 32,600株
リズム	1,800	1,639.00	2,950,200	貸付株式数 800株
大研医器	4,300	518.00	2,227,400	貸付株式数 600株
メニコン	25,500	2,682.00	68,391,000	
シンシア	500	570.00	285,000	貸付株式数 200株
KYORITSU	8,500	145.00	1,232,500	
中本パックス	1,700	1,597.00	2,714,900	貸付株式数 100株
スノーピーク	12,700	1,882.00	23,901,400	貸付株式数 5,000株 (100株)
パラマウントベッドHD	17,200	2,380.00	40,936,000	
トランザクション	4,900	1,696.00	8,310,400	貸付株式数 1,000株
粧美堂	1,600	378.00	604,800	貸付株式数 600株
ニホンフラッシュ	7,000	977.00	6,839,000	
前田工織	6,300	3,030.00	19,089,000	貸付株式数 2,400株
永大産業	6,100	209.00	1,274,900	貸付株式数 1,200株
アートネイチャー	7,600	751.00	5,707,600	
バンダイナムコHLDGS	203,600	3,420.00	696,312,000	
アイフィスジャパン	1,600	613.00	980,800	貸付株式数 400株
SHOEI	16,800	2,649.00	44,503,200	
フランスベッドHLDGS	9,200	1,043.00	9,595,600	貸付株式数 3,400株
マーベラス	12,100	668.00	8,082,800	
パイロットコーポレーション	11,600	4,566.00	52,965,600	
萩原工業	5,000	1,263.00	6,315,000	貸付株式数 1,900株
エイベックス	12,700	1,511.00	19,189,700	貸付株式数 4,500株
フジシールインターナショナル	15,000	1,525.00	22,875,000	
タカラトミー	34,200	1,705.00	58,311,000	
広済堂ホールディングス	3,900	2,392.00	9,328,800	貸付株式数 1,700株
エステールホールディングス	1,300	613.00	796,900	貸付株式数 700株
レック	10,600	837.00	8,872,200	貸付株式数 1,200株
タカノ	2,100	741.00	1,556,100	貸付株式数 1,000株
三光合成	9,400	535.00	5,029,000	
プロネクサス	6,200	968.00	6,001,600	
ホクシン	4,400	133.00	585,200	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,900	1,188.00	2,257,200	貸付株式数 700株
大建工業	4,500	2,244.00	10,098,000	
きもと	8,400	189.00	1,587,600	
凸版印刷	97,200	3,068.00	298,209,600	
大日本印刷	81,200	4,041.00	328,129,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
共同印刷	2,100	2,862.00	6,010,200	
N I S S H A	14,100	1,610.00	22,701,000	
光村印刷	500	1,175.00	587,500	貸付株式数 200株
藤森工業	5,900	3,365.00	19,853,500	
ヴィア・ホールディングス	9,500	88.00	836,000	貸付株式数 3,500株
TAKARA & COMPANY	4,800	2,236.00	10,732,800	
前澤化成工業	4,800	1,611.00	7,732,800	貸付株式数 1,900株
未来工業	2,700	2,440.00	6,588,000	
アシックス	68,600	3,903.00	267,745,800	
ツ ツ ミ	1,300	2,094.00	2,722,200	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	1,700	567.00	963,900	貸付株式数 1,200株
ジェイ エス ピー	5,200	1,665.00	8,658,000	貸付株式数 1,400株
ニ チ ハ	9,300	2,952.00	27,453,600	
ローランド	5,500	4,155.00	22,852,500	
エフピコ	14,100	2,956.00	41,679,600	
小松ウオール工業	2,700	2,482.00	6,701,400	
ヤマハ	46,900	5,690.00	266,861,000	
河合楽器	2,000	3,140.00	6,280,000	
クリナップ	8,300	673.00	5,585,900	
ピジョン	47,300	2,071.00	97,958,300	貸付株式数 300株
天馬	6,300	2,601.00	16,386,300	
キングジム	6,600	911.00	6,012,600	貸付株式数 2,600株
象印マホービン	22,200	1,714.00	38,050,800	貸付株式数 6,700株
リンテック	14,900	2,253.00	33,569,700	
信越ポリマー	13,800	1,408.00	19,430,400	
東 リ	13,000	304.00	3,952,000	貸付株式数 5,000株
イトーキ	15,200	880.00	13,376,000	
任 天 堂	469,200	6,083.00	2,854,143,600	
三菱鉛筆	10,600	1,688.00	17,892,800	
松 風	3,400	2,216.00	7,534,400	貸付株式数 1,200株
タカラスタANDARD	13,700	1,779.00	24,372,300	
コ ク ヨ	35,800	1,926.50	68,968,700	
ナカバヤシ	8,000	479.00	3,832,000	貸付株式数 600株
ニ フ コ	26,900	3,861.00	103,860,900	
立川ブラインド	3,500	1,258.00	4,403,000	
グローブライド	6,000	2,207.00	13,242,000	
オカムラ	22,400	1,791.00	40,118,400	
バルカー	6,200	3,665.00	22,723,000	
MUTOHホールディングス	800	1,717.00	1,373,600	
伊 藤 忠	484,600	5,056.00	2,450,137,600	
丸 紅	613,700	2,095.00	1,285,701,500	
スクロール	11,700	913.00	10,682,100	貸付株式数 1,600株
高 島	1,000	3,420.00	3,420,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,777.00	12,083,600	貸付株式数 2,500株
三陽商会	2,200	1,607.00	3,535,400	貸付株式数 500株
長瀬産業	36,000	2,357.00	84,852,000	
ナイガイ	1,900	262.00	497,800	貸付株式数 900株
蝶理	4,200	2,621.00	11,008,200	
豊田通商	68,900	6,557.00	451,777,300	
オンワードホールディングス	48,300	382.00	18,450,600	
三共生興	11,300	553.00	6,248,900	
兼松	30,500	1,853.00	56,516,500	
美津濃	7,400	3,630.00	26,862,000	
ツカモトコーポレーション	900	1,292.00	1,162,800	貸付株式数 400株
ルックホールディングス	1,700	2,336.00	3,971,200	貸付株式数 800株
三井物産	558,100	4,711.00	2,629,209,100	
日本紙パルプ	4,200	4,935.00	20,727,000	
東京エレクトロン	157,300	19,420.00	3,054,766,000	
カメイ	8,400	1,424.00	11,961,600	
東都水産	300	6,610.00	1,983,000	
OUGホールディングス	900	2,416.00	2,174,400	貸付株式数 100株
スターゼン	6,000	2,337.00	14,022,000	
セイコーグループ	11,500	2,679.00	30,808,500	貸付株式数 700株
山善	21,200	1,050.00	22,260,000	
椿本興業	1,300	3,925.00	5,102,500	貸付株式数 500株
住友商事	487,000	2,753.50	1,340,954,500	
B I P R O G Y	27,400	3,454.00	94,639,600	
内田洋行	3,200	5,320.00	17,024,000	
三菱商事	486,400	5,987.00	2,912,076,800	
第一実業	2,800	5,950.00	16,660,000	
キャノンマーケティングJPN	18,200	3,557.00	64,737,400	
西華産業	3,100	1,974.00	6,119,400	
佐藤商事	5,500	1,391.00	7,650,500	
菱洋エレクトロ	6,700	3,225.00	21,607,500	貸付株式数 1,500株
東京産業	7,200	835.00	6,012,000	
ユアサ商事	7,100	4,375.00	31,062,500	
神鋼商事	2,000	5,450.00	10,900,000	
トルク	3,200	217.00	694,400	
阪和興業	14,100	4,305.00	60,700,500	
正栄食品	5,200	3,990.00	20,748,000	貸付株式数 1,900株
カナデン	5,200	1,214.00	6,312,800	貸付株式数 2,200株
RYODEN	6,300	1,957.00	12,329,100	貸付株式数 2,400株
ニプロ	62,000	1,022.50	63,395,000	貸付株式数 24,800株
岩谷産業	17,900	7,051.00	126,212,900	
ナイス	2,500	1,403.00	3,507,500	
ニチモウ	800	3,550.00	2,840,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極東貿易	4,700	1,583.00	7,440,100	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	13,600	447.00	6,079,200	貸付株式数 5,100株
三愛オブリ	20,800	1,464.00	30,451,200	
稲畑産業	15,900	3,010.00	47,859,000	
G S I クレオス	4,600	1,852.00	8,519,200	貸付株式数 1,800株
明和産業	10,500	674.00	7,077,000	貸付株式数 2,400株
クワザワホールディングス	1,900	437.00	830,300	貸付株式数 1,000株
ゴールドウイン	13,200	12,665.00	167,178,000	
ユニ・チャーム	155,300	5,532.00	859,119,600	
デサント	12,800	3,995.00	51,136,000	
キング	2,500	553.00	1,382,500	貸付株式数 200株
ワキタ	14,500	1,307.00	18,951,500	
ヤマトインターナショナル	4,600	271.00	1,246,600	貸付株式数 2,300株
東邦ホールディングス	19,600	2,715.50	53,223,800	貸付株式数 7,800株
サンゲツ	19,700	2,466.00	48,580,200	
ミツウロコグループ	10,000	1,338.00	13,380,000	
シナネンホールディングス	2,500	3,760.00	9,400,000	
伊藤忠エネクス	19,500	1,188.00	23,166,000	
サンリオ	22,300	5,972.00	133,175,600	
サンワテクノス	4,000	2,229.00	8,916,000	
リョーサン	8,300	4,005.00	33,241,500	
新光商事	10,600	1,134.00	12,020,400	
トーホー	3,400	2,364.00	8,037,600	貸付株式数 1,300株
三信電気	3,200	2,057.00	6,582,400	
東陽テクニカ	8,000	1,347.00	10,776,000	
モスフードサービス	11,600	3,130.00	36,308,000	貸付株式数 1,300株
加賀電子	6,400	5,330.00	34,112,000	
三益半導体	5,900	3,015.00	17,788,500	
都築電気	3,900	1,777.00	6,930,300	
ソーダニツカ	4,500	778.00	3,501,000	貸付株式数 100株
立花エレテック	5,700	2,233.00	12,728,100	貸付株式数 2,000株
木曽路	11,900	2,376.00	28,274,400	貸付株式数 4,700株
S R S ホールディングス	13,000	954.00	12,402,000	貸付株式数 5,200株
千趣会	14,500	414.00	6,003,000	貸付株式数 5,800株
タカキュー	4,200	76.00	319,200	貸付株式数 2,100株
リテールパートナーズ	11,700	1,599.00	18,708,300	貸付株式数 4,600株
ケーヨー	12,700	813.00	10,325,100	
上新電機	7,000	1,939.00	13,573,000	
日本瓦斯	42,100	1,949.50	82,073,950	貸付株式数 900株
ロイヤルホールディングス	15,200	2,742.00	41,678,400	貸付株式数 6,000株
東天紅	500	777.00	388,500	貸付株式数 100株
いなげや	7,600	1,533.00	11,650,800	貸付株式数 2,900株
チョダ	7,500	853.00	6,397,500	貸付株式数 1,300株
ライフコーポレーション	6,900	2,916.00	20,120,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
リンガーハット	10,100	2,434.00	24,583,400	貸付株式数	4,000株 (200株)
MrMaxHD	11,000	613.00	6,743,000		
テンアライド	6,900	253.00	1,745,700	貸付株式数	3,100株
AOKIホールディングス	14,600	856.00	12,497,600		
オークワ	12,600	854.00	10,760,400	貸付株式数	500株
コメリ	12,100	2,925.00	35,392,500		
青山商事	16,800	1,301.00	21,856,800	貸付株式数	100株
しまむら	9,200	12,630.00	116,196,000		
はせがわ	2,900	339.00	983,100		
高島屋	59,300	1,888.50	111,988,050	貸付株式数	23,700株
松屋	13,300	1,183.00	15,733,900	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	38,300	1,488.00	56,990,400	貸付株式数	3,200株
近鉄百貨店	3,400	2,512.00	8,540,800	貸付株式数	900株
丸井グループ	58,000	2,474.50	143,521,000		
クレディセゾン	46,400	2,015.50	93,519,200		
アクシアルリテイリング	5,400	3,410.00	18,414,000	貸付株式数	1,700株
井筒屋	2,900	308.00	893,200	貸付株式数	1,300株
イオン	266,600	2,818.50	751,412,100		
イズミ	12,000	3,257.00	39,084,000	貸付株式数	1,300株
フオーバル	3,100	1,075.00	3,332,500	貸付株式数	800株
平和堂	13,100	2,125.00	27,837,500	貸付株式数	5,200株
フジ	12,100	1,790.00	21,659,000	貸付株式数	3,300株
ヤオコー	8,900	7,103.00	63,216,700	貸付株式数	1,200株
ゼビオホールディングス	10,700	1,146.00	12,262,200		
ケーズホールディングス	55,600	1,238.50	68,860,600		
PALTAC	12,400	5,100.00	63,240,000		
三谷産業	13,700	313.00	4,288,100		
OLYMPICグループ	2,300	542.00	1,246,600	貸付株式数	900株
日産東京販売HD	7,800	327.00	2,550,600		
SBI新生銀行	17,100	2,815.50	48,145,050		
あおぞら銀行	46,000	2,596.00	119,416,000	貸付株式数	18,400株
三菱UFJフィナンシャルG	4,584,300	975.20	4,470,609,360	※	
りそなホールディングス	925,200	660.70	611,279,640		
三井住友トラストHD	133,000	5,084.00	676,172,000		
三井住友フィナンシャルG	534,900	5,778.00	3,090,652,200	※	
千葉銀行	204,000	893.30	182,233,200		
群馬銀行	142,000	522.00	74,124,000		
武蔵野銀行	9,400	2,204.00	20,717,600		
千葉興業銀行	13,300	557.00	7,408,100		
筑波銀行	32,100	202.00	6,484,200		
七十七銀行	23,400	2,452.00	57,376,800		
秋田銀行	4,900	1,689.00	8,276,100		
山形銀行	8,100	1,103.00	8,934,300		

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
岩手銀行	5,000	2,087.00	10,435,000	
東邦銀行	57,900	230.00	13,317,000	
東北銀行	2,800	995.00	2,786,000	
ふくおかフィナンシャルG	58,400	2,662.50	155,490,000	
スルガ銀行	63,000	523.00	32,949,000	
八十二銀行	159,172	605.10	96,314,977	貸付株式数 24,300 株
山梨中央銀行	7,500	1,158.00	8,685,000	
大垣共立銀行	14,000	1,843.00	25,802,000	
福井銀行	6,500	1,447.00	9,405,500	
清水銀行	2,900	1,436.00	4,164,400	
富山銀行	900	1,679.00	1,511,100	貸付株式数 400 株
滋賀銀行	12,200	2,777.00	33,879,400	
南都銀行	11,000	2,436.00	26,796,000	
百五銀行	68,900	414.00	28,524,600	
京都銀行	23,200	6,715.00	155,788,000	
紀陽銀行	26,200	1,553.00	40,688,600	貸付株式数 6,000 株
ほくほくフィナンシャルG	46,500	1,118.00	51,987,000	
山陰合同銀行	45,800	784.00	35,907,200	
鳥取銀行	1,800	1,153.00	2,075,400	
百十四銀行	6,700	1,774.00	11,885,800	
四国銀行	11,600	854.00	9,906,400	
阿波銀行	10,300	2,041.00	21,022,300	
大分銀行	4,400	2,102.00	9,248,800	
宮崎銀行	4,800	2,286.00	10,972,800	
佐賀銀行	4,300	1,636.00	7,034,800	
琉球銀行	16,800	933.00	15,674,400	
セブン銀行	262,200	282.00	73,940,400	
みずほフィナンシャルG	1,058,600	2,129.50	2,254,288,700	
高知銀行	1,900	666.00	1,265,400	貸付株式数 200 株
山口フィナンシャルG	80,800	930.00	75,144,000	
芙蓉総合リース	6,700	10,370.00	69,479,000	
みずほリース	10,900	4,300.00	46,870,000	
東京センチュリー	13,700	5,214.00	71,431,800	
SBIホールディングス	106,000	2,673.50	283,391,000	
日本証券金融	26,900	1,179.00	31,715,100	
アイフル	121,200	336.00	40,723,200	
日本アジア投資	4,500	235.00	1,057,500	
名古屋銀行	4,800	3,380.00	16,224,000	
北洋銀行	110,900	277.00	30,719,300	
大光銀行	1,700	1,054.00	1,791,800	貸付株式数 600 株
愛媛銀行	9,900	806.00	7,979,400	
トマト銀行	1,900	1,015.00	1,928,500	貸付株式数 500 株
京葉銀行	33,500	528.00	17,688,000	
栃木銀行	33,600	255.00	8,568,000	
北日本銀行	2,600	1,995.00	5,187,000	貸付株式数 300 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
東和銀行	13,400	526.00	7,048,400	
福島銀行	5,900	211.00	1,244,900	
大東銀行	2,200	628.00	1,381,600	貸付株式数 500株
リコーリース	6,900	3,955.00	27,289,500	
イオンフィナンシャルサー ビス	42,000	1,241.00	52,122,000	
アコム	130,600	330.80	43,202,480	
ジャックス	7,800	4,615.00	35,997,000	
オリコ	19,100	1,073.00	20,494,300	
オリックス	480,500	2,474.00	1,188,757,000	
三菱HCキャピタル	285,400	771.90	220,300,260	
ジャフコグループ	24,400	1,748.00	42,651,200	
九州リースサービス	2,700	806.00	2,176,200	貸付株式数 1,200株
トモニホールディングス	59,200	375.00	22,200,000	
大和証券G本社	523,400	662.00	346,490,800	
野村ホールディングス	1,348,100	511.60	689,687,960	
岡三証券グループ	64,300	457.00	29,385,100	貸付株式数 24,900株
丸三証券	24,400	413.00	10,077,200	貸付株式数 1,600株
東洋証券	24,300	281.00	6,828,300	
東海東京HD	79,700	358.00	28,532,600	
光世証券	1,300	423.00	549,900	貸付株式数 200株
水戸証券	19,600	294.00	5,762,400	
いちよし証券	13,500	581.00	7,843,500	
松井証券	43,200	792.00	34,214,400	
SOMP Oホールディング ス	125,600	6,023.00	756,488,800	
日本取引所グループ	205,700	2,362.50	485,966,250	
マネックスG	78,900	510.00	40,239,000	
極東証券	9,100	604.00	5,496,400	貸付株式数 300株
岩井コスモホールディング	8,300	1,359.00	11,279,700	
アイザワ証券グループ	10,600	754.00	7,992,400	貸付株式数 200株
フィデアホール	7,600	1,321.00	10,039,600	
池田泉州HD	93,700	232.00	21,738,400	
アニコムホールディング ス	24,900	616.00	15,338,400	
MS&AD	149,000	4,921.00	733,229,000	
マネーパートナーズGP	5,900	256.00	1,510,400	
スパークス・グループ	8,200	1,416.00	11,611,200	
小林洋行	2,400	235.00	564,000	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	357,600	2,537.00	907,231,200	
東京海上HD	723,500	3,213.00	2,324,605,500	
アドバンテッジリスクマネ	2,700	584.00	1,576,800	貸付株式数 200株
イー・ギャランティ	11,900	1,999.00	23,788,100	
アサックス	2,600	623.00	1,619,800	貸付株式数 1,300株
NECキャピタルソリュー ション	3,600	2,949.00	10,616,400	貸付株式数 1,300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
T&Dホールディングス	196,400	1,991.50	391,130,600	
アドバンスクリエイト	4,200	1,125.00	4,725,000	貸付株式数 1,300株
三井不動産	316,300	2,817.50	891,175,250	
三菱地所	441,700	1,681.00	742,497,700	
平和不動産	11,900	3,755.00	44,684,500	
東京建物	69,800	1,828.00	127,594,400	
京阪神ビルディング	12,300	1,238.00	15,227,400	
住友不動産	132,300	3,639.00	481,439,700	
太平洋興発	2,100	728.00	1,528,800	貸付株式数 800株
テーオーシー	13,200	634.00	8,368,800	
東京楽天地	1,200	4,225.00	5,070,000	貸付株式数 400株
スターツコーポレーション	10,500	2,778.00	29,169,000	
フジ住宅	10,200	687.00	7,007,400	
空港施設	8,800	546.00	4,804,800	
明和地所	2,700	903.00	2,438,100	
ゴールドクレスト	7,000	1,760.00	12,320,000	
リログループ	42,500	2,071.00	88,017,500	
エスリード	3,400	2,563.00	8,714,200	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	11,700	461.00	5,393,700	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	16,400	807.00	13,234,800	貸付株式数 4,900株
MIRARTHホールディング	37,000	430.00	15,910,000	
AVANTIA	3,200	831.00	2,659,200	貸付株式数 1,100株
イオンモール	37,900	1,801.50	68,276,850	
毎日コムネット	2,100	753.00	1,581,300	貸付株式数 900株
ファースト住建	2,300	1,097.00	2,523,100	貸付株式数 1,100株
ランド	442,400	8.00	3,539,200	貸付株式数 176,900株
カチタス	19,700	2,505.00	49,348,500	貸付株式数 7,800株
東祥	5,300	1,169.00	6,195,700	貸付株式数 2,000株
トーセイ	12,200	1,714.00	20,910,800	貸付株式数 3,600株
穴吹興産	1,100	2,240.00	2,464,000	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	12,200	1,366.00	16,665,200	
インテリックス	1,400	554.00	775,600	貸付株式数 500株
ランドビジネス	2,100	248.00	520,800	
サンネクスタグループ	1,700	1,012.00	1,720,400	貸付株式数 900株
グランディハウス	4,800	552.00	2,649,600	
東武鉄道	81,600	3,746.00	305,673,600	
相鉄ホールディングス	24,600	2,612.50	64,267,500	
東急	208,400	1,823.50	380,017,400	
京浜急行	84,300	1,320.00	111,276,000	
小田急電鉄	112,700	2,020.00	227,654,000	
京王電鉄	39,300	4,927.00	193,631,100	
京成電鉄	47,900	5,556.00	266,132,400	
富士急行	9,200	5,250.00	48,300,000	貸付株式数 1,000株
東日本旅客鉄道	126,100	7,805.00	984,210,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
西日本旅客鉄道	94,900	5,899.00	559,815,100	
東海旅客鉄道	57,300	17,200.00	985,560,000	
西武ホールディングス	89,900	1,479.50	133,007,050	
鴻池運輸	12,700	1,510.00	19,177,000	
西日本鉄道	19,900	2,414.00	48,038,600	
ハマキョウレックス	5,800	3,610.00	20,938,000	
サカイ引越センター	3,500	4,680.00	16,380,000	
近鉄グループHLDGS	74,200	4,816.00	357,347,200	
阪急阪神HLDGS	98,900	4,505.00	445,544,500	
南海電鉄	35,500	3,214.00	114,097,000	
京阪ホールディングス	40,900	3,604.00	147,403,600	
神戸電鉄	2,000	3,050.00	6,100,000	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	82,000	2,353.00	192,946,000	
山陽電鉄	5,600	2,221.00	12,437,600	貸付株式数 1,800株
アルプス物流	5,900	1,343.00	7,923,700	貸付株式数 2,200株
トランコム	2,200	6,760.00	14,872,000	
ヤマトホールディングス	95,000	2,597.50	246,762,500	
山 九	18,900	4,902.00	92,647,800	
日 新	5,600	2,459.00	13,770,400	
丸 運	2,800	237.00	663,600	貸付株式数 1,400株
丸全昭和運輸	4,600	3,825.00	17,595,000	
センコーグループHLDGS	39,300	936.00	36,784,800	貸付株式数 3,500株
トナミホールディングス	1,600	4,310.00	6,896,000	
ニッコンホールディングス	23,800	2,677.50	63,724,500	
日石輸送	600	2,676.00	1,605,600	
福山通運	5,600	3,280.00	18,368,000	
セイノーホールディングス	46,200	1,606.00	74,197,200	貸付株式数 6,500株
エスライン	1,600	784.00	1,254,400	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,100	3,165.00	6,646,500	
AZ-COM丸和ホールディング	17,900	2,094.00	37,482,600	貸付株式数 7,100株
C&Fロジホールディングス	7,100	1,244.00	8,832,400	貸付株式数 800株
日本郵船	198,500	3,089.00	613,166,500	
商船三井	130,800	3,255.00	425,754,000	貸付株式数 51,600株
川崎汽船	55,700	3,258.00	181,470,600	貸付株式数 21,800株
NSユニテッド海運	4,000	3,335.00	13,340,000	貸付株式数 1,600株
明治海運	5,600	550.00	3,080,000	貸付株式数 2,500株
飯野海運	27,200	818.00	22,249,600	貸付株式数 3,700株
共栄タンカー	1,000	837.00	837,000	貸付株式数 300株
九州旅客鉄道	52,500	3,013.00	158,182,500	
SGホールディングス	142,400	2,131.00	303,454,400	
NIPPON EXPRESS	27,700	8,143.00	225,561,100	
日本航空	182,200	2,748.50	500,776,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ANAホールディングス	201,900	3,130.00	631,947,000	
ビーウィズ	1,900	1,859.00	3,532,100	貸付株式数 500株
パスコ	1,100	1,653.00	1,818,300	
TREホールディングス	16,100	1,084.00	17,452,400	
人・夢・技術グループ	2,900	1,480.00	4,292,000	
西本WISMETTACHD	2,000	4,470.00	8,940,000	貸付株式数 700株
シルバーライフ	1,500	1,303.00	1,954,500	貸付株式数 700株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	500	2,060.00	1,030,000	
GENKY DRUG STORES	3,400	4,360.00	14,824,000	貸付株式数 1,300株
コア商事HLDGS	4,400	702.00	3,088,800	貸付株式数 200株
KPPグループホールディングン	18,300	579.00	10,595,700	貸付株式数 7,200株
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	944.00	944,000	貸付株式数 600株
ブックオフGHD	4,000	1,250.00	5,000,000	貸付株式数 1,700株
ギフトホールディングス	1,700	5,160.00	8,772,000	貸付株式数 600株
三菱倉庫	15,900	3,472.00	55,204,800	
三井倉庫HOLD	6,900	3,435.00	23,701,500	貸付株式数 800株
住友倉庫	20,000	2,281.00	45,620,000	貸付株式数 7,900株
渋沢倉庫	3,000	2,357.00	7,071,000	
ヤマタネ	3,500	1,624.00	5,684,000	
東陽倉庫	7,600	263.00	1,998,800	
乾汽船	9,400	1,330.00	12,502,000	貸付株式数 3,700株
日本トランスシティ	14,900	611.00	9,103,900	
ケイヒン	1,000	1,692.00	1,692,000	
中央倉庫	3,600	1,046.00	3,765,600	貸付株式数 1,400株
川西倉庫	1,000	1,009.00	1,009,000	貸付株式数 200株
安田倉庫	5,100	966.00	4,926,600	
ファイズホールディングス	1,100	1,249.00	1,373,900	貸付株式数 400株
大栄環境	19,400	2,130.00	41,322,000	
日本管財ホールディングク	8,000	2,654.00	21,232,000	
東洋埠頭	1,700	1,302.00	2,213,400	
上組	35,600	3,180.00	113,208,000	
サンリツ	1,300	701.00	911,300	貸付株式数 300株
キムラユニティー	2,700	1,139.00	3,075,300	貸付株式数 400株
キューソー流通システム	3,500	957.00	3,349,500	貸付株式数 1,400株
東海運	3,300	282.00	930,600	貸付株式数 1,400株
エーアイテイー	4,700	1,684.00	7,914,800	貸付株式数 100株
内外トランスライン	2,700	2,448.00	6,609,600	貸付株式数 900株
ショーエイコーポ	1,700	554.00	941,800	貸付株式数 800株
日本コンセプト	2,300	1,652.00	3,799,600	
TBSホールディングス	38,200	2,322.00	88,700,400	
日本テレビHLD S	66,000	1,299.00	85,734,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
朝日放送グループHD	7,000	647.00	4,529,000	貸付株式数 2,800株
テレビ朝日HD	18,100	1,536.00	27,801,600	
スカパーJ S A T H D	66,100	546.00	36,090,600	
テレビ東京HD	5,400	2,791.00	15,071,400	
日本BS放送	2,100	897.00	1,883,700	貸付株式数 800株
ビジョン	9,800	1,794.00	17,581,200	
スマートバリュー	1,400	389.00	544,600	貸付株式数 600株
USEN-NEXT HL DGS	8,400	3,370.00	28,308,000	貸付株式数 2,500株
ワイヤレスゲート	2,500	223.00	557,500	貸付株式数 1,100株
日本通信	68,800	256.00	17,612,800	
クロップス	900	1,042.00	937,800	
日本電信電話	955,100	4,064.00	3,881,526,400	
KDDI	576,000	4,392.00	2,529,792,000	
ソフトバンク	1,197,700	1,508.50	1,806,730,450	
光通信	8,800	21,205.00	186,604,000	
エムティーアイ	5,100	628.00	3,202,800	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	27,500	2,643.50	72,696,250	
ファイバーゲート	4,000	1,324.00	5,296,000	貸付株式数 1,500株
アイドママーケティング コム	1,300	277.00	360,100	貸付株式数 600株
KADOKAWA	39,400	3,357.00	132,265,800	
学研ホールディングス	12,400	876.00	10,862,400	貸付株式数 2,600株
ゼンリン	12,700	894.00	11,353,800	
昭文社ホールディングス	2,500	300.00	750,000	貸付株式数 100株
インプレスホールディング ス	5,000	209.00	1,045,000	貸付株式数 2,100株
東京電力HD	670,000	503.00	337,010,000	貸付株式数 255,600株
中部電力	273,900	1,678.50	459,741,150	
関西電力	287,000	1,615.00	463,505,000	
中国電力	118,400	856.50	101,409,600	
北陸電力	70,200	730.30	51,267,060	
東北電力	181,700	825.70	150,029,690	
四国電力	63,400	941.10	59,665,740	
九州電力	171,300	871.90	149,356,470	
北海道電力	71,800	575.20	41,299,360	
沖縄電力	17,400	1,145.00	19,923,000	
電源開発	56,000	2,075.00	116,200,000	
エフオン	4,800	553.00	2,654,400	
イーレックス	13,200	1,228.00	16,209,600	貸付株式数 100株
レノバ	19,800	1,649.00	32,650,200	貸付株式数 7,900株
東京瓦斯	157,100	3,065.00	481,511,500	
大阪瓦斯	150,600	2,232.00	336,139,200	
東邦瓦斯	29,300	2,499.50	73,235,350	
北海道瓦斯	4,400	2,099.00	9,235,600	貸付株式数 1,400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
広島ガス	15,700	360.00	5,652,000	貸付株式数 600株
西部ガスHLDGS	7,000	2,049.00	14,343,000	貸付株式数 200株
静岡ガス	16,900	1,215.00	20,533,500	貸付株式数 6,800株
メタウォーター	9,300	1,768.00	16,442,400	
アイネット	4,500	1,494.00	6,723,000	
松竹	4,300	11,870.00	51,041,000	
東宝	46,700	5,638.00	263,294,600	
エイチ・アイ・エス	20,000	1,949.00	38,980,000	貸付株式数 7,800株
東映	2,100	18,340.00	38,514,000	
ラックランド	3,200	3,360.00	10,752,000	貸付株式数 1,200株
NTTデータ	233,900	2,042.50	477,740,750	
共立メンテナンス	13,100	5,395.00	70,674,500	貸付株式数 5,200株
イチネンホールディングス	8,100	1,293.00	10,473,300	
建設技術研究所	3,900	3,435.00	13,396,500	
スペース	5,500	1,032.00	5,676,000	
アインホールディングス	10,800	5,086.00	54,928,800	貸付株式数 4,200株
燦ホールディングス	3,300	2,211.00	7,296,300	
ピー・シー・エー	4,300	1,291.00	5,551,300	貸付株式数 500株
スバル興業	400	9,590.00	3,836,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,200	1,125.00	2,475,000	貸付株式数 1,000株
タナベコンサルティンググループ	2,300	877.00	2,017,100	
ビジネスB太田昭和	3,200	2,285.00	7,312,000	貸付株式数 600株
ナガワ	2,000	6,590.00	13,180,000	貸付株式数 600株
東京都競馬	6,400	4,115.00	26,336,000	貸付株式数 2,400株
常磐興産	2,100	1,225.00	2,572,500	貸付株式数 1,000株
カナモト	14,000	2,151.00	30,114,000	
DTS	15,900	3,595.00	57,160,500	
スクウェア・エニックス・HD	37,500	6,338.00	237,675,000	
シーイーシー	10,500	1,495.00	15,697,500	
カプコン	74,100	5,796.00	429,483,600	貸付株式数 16,700株
ニシオホールディングス	7,100	3,270.00	23,217,000	貸付株式数 1,500株
アイ・エス・ビー	3,800	1,593.00	6,053,400	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティーG	32,600	25.00	815,000	貸付株式数 15,600株
日本空港ビルデング	25,900	6,604.00	171,043,600	
トランス・コスモス	9,500	3,395.00	32,252,500	貸付株式数 3,200株
乃村工藝社	33,300	937.00	31,202,100	
ジャステック	4,600	1,281.00	5,892,600	貸付株式数 1,500株
SCSK	60,800	2,268.50	137,924,800	
藤田観光	3,400	3,705.00	12,597,000	貸付株式数 1,300株
KNT-CTホールディングス	4,600	1,411.00	6,490,600	貸付株式数 1,800株
トーカイ	6,800	1,849.00	12,573,200	
白洋舎	800	2,596.00	2,076,800	貸付株式数 300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
セコム	77,800	9,313.00	724,551,400	
NSW	2,900	2,404.00	6,971,600	
セントラル警備保障	4,100	2,855.00	11,705,500	貸付株式数 1,300株
アイネス	5,200	1,473.00	7,659,600	
丹青社	14,800	804.00	11,899,200	
メイテック	29,800	2,387.00	71,132,600	
TKC	11,900	3,790.00	45,101,000	
富士ソフト	8,400	9,020.00	75,768,000	貸付株式数 400株
応用地質	7,100	1,907.00	13,539,700	
船井総研ホールディング	15,900	2,720.00	43,248,000	
NSD	26,600	2,780.00	73,948,000	
進学会ホールディングス	1,900	292.00	554,800	貸付株式数 900株
丸紅建材リース	500	2,109.00	1,054,500	
オオバ	3,700	740.00	2,738,000	貸付株式数 500株
コナミグループ	31,900	7,697.00	245,534,300	貸付株式数 12,700株
いであ	1,300	1,661.00	2,159,300	貸付株式数 600株
学究社	3,000	2,183.00	6,549,000	
ベネッセホールディングス	28,500	1,872.00	53,352,000	
イオンディライト	8,500	3,015.00	25,627,500	貸付株式数 3,200株
ナック	3,400	967.00	3,287,800	貸付株式数 1,200株
福井コンピュータHLDS	5,200	2,816.00	14,643,200	
ダイセキ	15,600	3,750.00	58,500,000	
ステップ	2,800	1,811.00	5,070,800	貸付株式数 200株
日鉄物産	5,200	9,280.00	48,256,000	
泉州電業	3,900	3,400.00	13,260,000	貸付株式数 1,400株
元気寿司	2,200	3,310.00	7,282,000	貸付株式数 800株
トラスコ中山	16,500	2,194.00	36,201,000	
ヤマダホールディングス	322,400	422.90	136,342,960	貸付株式数 97,400株
オートバックスセブン	27,400	1,504.50	41,223,300	
モリト	5,600	1,011.00	5,661,600	
アーケランズ	11,500	1,577.00	18,135,500	
ニトリホールディングス	31,800	17,185.00	546,483,000	
グルメ杵屋	6,400	1,056.00	6,758,400	貸付株式数 2,500株
愛眼	4,500	176.00	792,000	貸付株式数 2,700株
ケーユーホールディングス	4,600	1,259.00	5,791,400	
吉野家ホールディングス	30,800	2,596.50	79,972,200	貸付株式数 12,300株
加藤産業	9,700	3,940.00	38,218,000	
北恵	1,400	733.00	1,026,200	貸付株式数 500株
イノテック	5,000	1,557.00	7,785,000	
イエローハット	13,900	1,839.00	25,562,100	
松屋フーズHLDGS	3,700	4,130.00	15,281,000	貸付株式数 1,200株
JBCホールディングス	5,400	2,335.00	12,609,000	
JKホールディングス	6,000	969.00	5,814,000	
サガミホールディングス	12,600	1,263.00	15,913,800	貸付株式数 1,500株
日伝	4,700	2,209.00	10,382,300	貸付株式数 1,800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
関西フードマーケット	7,100	1,506.00	10,692,600	貸付株式数 100株
ミロク情報サービス	6,800	1,540.00	10,472,000	貸付株式数 1,800株
北沢産業	3,200	357.00	1,142,400	貸付株式数 1,400株
杉本商事	3,500	2,033.00	7,115,500	貸付株式数 400株
因幡電機産業	20,400	3,190.00	65,076,000	
王将フードサービス	5,200	6,390.00	33,228,000	貸付株式数 1,800株
ミニストップ	5,700	1,442.00	8,219,400	貸付株式数 2,200株
アークス	14,400	2,415.00	34,776,000	貸付株式数 4,100株
バローホールディングス	15,000	1,924.00	28,860,000	
東 テ ク	2,600	4,195.00	10,907,000	
ミスミグループ本社	118,700	3,188.00	378,415,600	
アルテック	3,400	257.00	873,800	貸付株式数 800株
ベ ル ク	3,900	6,090.00	23,751,000	
大 庄	3,300	1,110.00	3,663,000	貸付株式数 1,400株
タキヒヨー	1,500	959.00	1,438,500	貸付株式数 700株
ファーストリテイリング	35,400	34,160.00	1,209,264,000	
ソフトバンクグループ	367,700	6,022.00	2,214,289,400	
蔵王産業	1,000	2,242.00	2,242,000	貸付株式数 100株
スズケン	23,000	3,693.00	84,939,000	
サンドラッグ	29,900	4,103.00	122,679,700	
サックスパーホールディング	7,500	1,011.00	7,582,500	
ジェコス	4,700	841.00	3,952,700	
ヤマザワ	1,100	1,243.00	1,367,300	貸付株式数 400株
や ま や	1,300	2,665.00	3,464,500	貸付株式数 600株
グローセル	7,400	404.00	2,989,600	貸付株式数 600株
バルーナ	18,900	689.00	13,022,100	
合計			235,920,131,577	

(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。

ソニーグループ	20,000株
キーエンス	5,000株
本田技研	30,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000株
三井住友フィナンシャルG	30,000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

	2022年6月6日現在 金額(円)	2023年6月5日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,785,323,632	784,015,541
コール・ローン	2,859,391,174	5,690,886,574
株式	258,776,639,198	327,359,557,109
投資証券	6,825,418,951	7,257,163,279
派生商品評価勘定	183,753,161	625,902,486
未収入金	59,346,882	193,360,845
未収配当金	401,762,924	502,849,758
差入委託証拠金	4,355,430,192	6,119,865,130
流動資産合計	275,247,066,114	348,533,600,722
資産合計	275,247,066,114	348,533,600,722
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	97,190,351	11,405,787
未払金	491,234,462	170,226,669
未払解約金	33,560,500	238,776,100
その他未払費用	189	-
流動負債合計	621,985,502	420,408,556
負債合計	621,985,502	420,408,556
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	65,219,352,126	73,305,284,321
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	209,405,728,486	274,807,907,845
元本等合計	274,625,080,612	348,113,192,166
純資産合計	274,625,080,612	348,113,192,166
負債純資産合計	275,247,066,114	348,533,600,722

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 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。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。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。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。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>

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
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	2022 年 6 月 6 日現在	2023 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	2021 年 6 月 8 日	2022 年 6 月 7 日
期首元本額	58,182,794,639 円	65,219,352,126 円
期中追加設定元本額	13,258,685,462 円	13,276,965,835 円
期中一部解約元本額	6,222,127,975 円	5,191,033,640 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスV A	349,068,733 円	294,614,706 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	3,751,596 円	2,700,422 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	45,554,421 円	33,702,693 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	7,085,384 円	5,352,543 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	205,400,687 円	150,034,208 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)	52,416,335 円	87,595,091 円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	-円	105,598,925 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)	510,901,757 円	628,464,988 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)	2,693,828,278 円	3,545,008,347 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)	636,825,515 円	598,060,561 円

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
D-I's 外国株式インデックス	17,598,341 円	18,214,545 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	42,109,081 円	49,601,005 円
iFree 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	5,032,009,377 円	6,838,207,767 円
iFree 8資産バランス	1,256,810,253 円	1,473,361,115 円
iFree 年金バランス	220,052,668 円	285,687,220 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	160,733 円
DCダイワ外国株式インデックス	41,251,827,650 円	45,285,958,135 円
ダイワ・ライフ・バランス30	528,041,544 円	530,080,997 円
ダイワ・ライフ・バランス50	988,869,306 円	1,054,132,356 円
ダイワ・ライフ・バランス70	798,656,593 円	921,363,577 円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,825,240,470 円	1,948,055,233 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	12,623,928 円	12,522,141 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	11,303,219 円	12,720,324 円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,007,956,945 円	1,735,073,784 円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,932,349 円	2,074,276 円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,153,578 円	2,254,312 円
ダイワつみたてインデックスバランス70	4,254,951 円	5,627,914 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)	246,407 円	5,028,864 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	81,384,880 円	66,467,884 円
ダイワ世界バランスファンド60VA	153,275,360 円	40,358,122 円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,330,992,536 円	1,086,845,160 円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	68,880,810 円	58,861,714 円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	188,669,046 円	160,746,206 円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,063,368,930 円	1,270,278,248 円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	385,242,890 円	419,653,362 円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)	1,570,304,135 円	1,544,600,019 円

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,779,529,325 円	2,938,348,326 円
ダイワライフスタイル25	11,267,821 円	10,050,870 円
ダイワライフスタイル50	44,106,095 円	43,338,052 円
ダイワライフスタイル75	35,810,932 円	34,479,576 円
計	65,219,352,126 円	73,305,284,321 円
2. 期末日における受益権の総数	65,219,352,126 口	73,305,284,321 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用してしております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

区分	2023年6月5日現在
	(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	2022年6月6日現在	2023年6月5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	△29,993,463,493	21,845,872,690
投資証券	△550,957,982	△267,067,608
合計	△30,544,421,475	21,578,805,082

(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	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	8,633,026,393	-	8,683,393,283	50,366,890	13,027,055,445	-	13,587,168,704	560,113,259
合計	8,633,026,393	-	8,683,393,283	50,366,890	13,027,055,445	-	13,587,168,704	560,113,259

(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	2022年6月6日現在				2023年6月5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	2,573,465,390	-	2,609,661,310	36,195,920	5,725,440,370	-	5,779,823,810	54,383,440
アメリカ・ドル	772,485,000	-	784,039,800	11,554,800	3,006,153,860	-	3,026,854,880	20,701,020
イギリス・ポンド	211,045,900	-	212,047,290	1,001,390	345,030,080	-	346,964,200	1,934,120
オーストラリア・ドル	305,737,740	-	310,782,120	5,044,380	441,188,160	-	451,376,240	10,188,080
カナダ・ドル	254,487,500	-	259,509,750	5,022,250	643,298,790	-	654,772,230	11,473,440
スイス・フラン	268,806,800	-	271,902,400	3,095,600	518,741,400	-	522,870,700	4,129,300
ユーロ	760,902,450	-	771,379,950	10,477,500	771,028,080	-	776,985,560	5,957,480
合計	2,573,465,390	-	2,609,661,310	36,195,920	5,725,440,370	-	5,779,823,810	54,383,440

(注) 1. 時価の算定方法

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

- ① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額	4.2108円	4.7488円
(1万口当たり純資産額)	(42,108円)	(47,488円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,500	153.250	842,875.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	14,100	217.240	3,063,084.000	
	FIRST SOLAR INC	4,700	206.740	971,678.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,300	163.260	1,355,058.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,200	103.700	642,940.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,000	128.340	385,020.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	33.040	697,144.000	
	ABBOTT LABORATORIES	80,866	104.200	8,426,237.200	
	HOWMET AEROSPACE INC	18,283	45.130	825,111.790	
	VERISK ANALYTICS INC	7,100	221.370	1,571,727.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	16,000	58.940	943,040.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	27,700	77.570	2,148,689.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,100	497.250	1,044,225.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27,600	55.380	1,528,488.000	
	QORVO INC	4,620	98.040	452,944.800	
	AFLAC INC	26,800	66.600	1,784,880.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,600	164.040	918,624.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,900	82.830	654,357.000	
	ADOBE INC	21,320	436.370	9,303,408.400	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,900	62.910	559,899.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,400	365.440	1,973,376.000	
	GARMIN LTD	7,100	106.470	755,937.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,300	281.040	2,894,712.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,000	198.850	6,164,350.000	
	WR BERKLEY CORP	9,842	57.650	567,391.300	
	AUTOZONE INC	920	2,381.230	2,190,731.600	
	DOLLAR TREE INC	10,271	133.610	1,372,308.310	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	53,100	7.230	383,913.000	
	CELANESE CORP	4,950	114.690	567,715.500	
	DR HORTON INC	14,916	112.020	1,670,890.320	
	DENTSPLY SIRONA INC	9,600	38.790	372,384.000	
	AUTODESK INC	10,000	204.240	2,042,400.000	
	MOODY'S CORP	7,700	326.990	2,517,823.000	
	DEVON ENERGY CORP	30,600	48.530	1,485,018.000	
	ALBEMARLE CORP	5,500	208.360	1,145,980.000	
	ATMOS ENERGY CORP	6,700	114.520	767,284.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	11,700	51.980	608,166.000	
	CITIGROUP INC	90,673	46.320	4,199,973.360	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,300	216.520	4,178,836.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	24,000	83.450	2,002,800.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,630	303.190	494,199.700		
HESS CORP	12,900	133.670	1,724,343.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DAVITA INC	2,750	98.740	271,535.000	
	DANAHER CORP	32,350	234.620	7,589,957.000	
	FORTIVE CORP	16,500	67.270	1,109,955.000	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	26,100	107.980	2,818,278.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,400	71.970	1,828,038.000	
	BUNGE LTD	7,000	92.280	645,960.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	14,695	126.270	1,855,537.650	
	APPLE INC	737,400	180.950	133,432,530.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,400	109.090	1,352,716.000	
	BOEING CO/THE	26,500	213.320	5,652,980.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,315	100.580	735,742.700	
	BECTON DICKINSON AND CO	13,199	251.790	3,323,376.210	
	LEIDOS HOLDINGS INC	6,100	81.490	497,089.000	
	NISOURCE INC	19,300	26.760	516,468.000	
	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,500	97.670	537,185.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,571	42.740	1,605,784.540	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	195,604	34.580	6,763,986.320	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	60,550	329.480	19,950,014.000	
	ANSYS INC	4,000	325.000	1,300,000.000	
	TRUIST FINANCIAL CORP	61,917	32.080	1,986,297.360	
	BLACKSTONE GROUP INC/THE	32,900	89.000	2,928,100.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	97,900	65.660	6,428,114.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	136,470	140.470	19,169,940.900	
	T ROWE PRICE GROUP INC	10,500	110.920	1,164,660.000	
	LKQ CORP	12,500	53.750	671,875.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,412	64.050	923,088.600	
	CADENCE DESIGN SYS INC	12,700	229.690	2,917,063.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,900	313.200	1,534,680.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	10,200	166.120	1,694,424.000	
	SERVICENOW INC	9,500	548.180	5,207,710.000	
	CATERPILLAR INC	24,000	226.630	5,439,120.000	
	BROWN & BROWN INC	11,300	63.790	720,827.000	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	11,700	40.940	478,998.000	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	2,400	200.680	481,632.000	
	CMS ENERGY CORP	13,600	58.360	793,696.000	
	MOSAIC CO/THE	15,400	33.080	509,432.000	
	DELTA AIR LINES INC	7,300	37.010	270,173.000	
	CORNING INC	37,500	31.510	1,181,625.000	
	CISCO SYSTEMS INC	190,750	50.020	9,541,315.000	
	MORGAN STANLEY	58,352	84.350	4,921,991.200	
	DECKERS OUTDOOR CORP	1,300	476.780	619,814.000	
	MSCI INC	3,700	478.760	1,771,412.000	
	FAIR ISAAC CORP	1,200	790.840	949,008.000	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	1,500	298.230	447,345.000	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,500	56.610	594,405.000	
	BROADCOM INC	19,412	812.000	15,762,544.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	2,200	217.220	477,884.000	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	128.410	398,071.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,800	193.670	1,123,286.000	
	ARAMARK	10,600	39.700	420,820.000	
	DTE ENERGY COMPANY	9,600	108.880	1,045,248.000	
	CENTENE CORP	25,507	66.460	1,695,195.220	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,800	135.180	648,864.000	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	22,100	27.790	614,159.000	
	DARLING INGREDIENTS INC	7,500	64.060	480,450.000	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,000	205.680	2,056,800.000	
	GARTNER INC	3,750	345.010	1,293,787.500	
	SPLUNK INC	7,400	102.880	761,312.000	
	DOMINION ENERGY INC	38,941	49.860	1,941,598.260	
	MONSTER BEVERAGE CORP	36,600	59.480	2,176,968.000	
	SMITH (A. O.) CORP	5,700	68.410	389,937.000	
	DEERE & CO	13,100	371.070	4,861,017.000	
	QUANTA SERVICES INC	6,800	180.080	1,224,544.000	
	POOL CORP	1,800	326.360	587,448.000	
	GLOBAL PAYMENTS INC	12,384	100.390	1,243,229.760	
	VMWARE INC-CLASS A	11,000	137.910	1,517,010.000	
	BURLINGTON STORES INC	3,000	150.980	452,940.000	
	NASDAQ INC	16,000	56.330	901,280.000	
	VAIL RESORTS INC	1,900	252.190	479,161.000	
	TARGA RESOURCES CORP	9,800	71.490	700,602.000	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,400	116.660	396,644.000	
	WESTLAKE CORP	1,800	113.010	203,418.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	16,100	91.760	1,477,336.000	
	COGNEX CORP	7,900	56.870	449,273.000	
	WEBSTER FINANCIAL CORP	7,900	38.470	303,913.000	
	TELEFLEX INC	2,200	236.470	520,234.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,900	172.590	673,101.000	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,500	343.730	1,203,055.000	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,000	372.360	372,360.000	
	CATALENT INC	8,400	37.720	316,848.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,800	195.000	1,326,000.000	
	MOLINA HEALTHCARE INC	2,700	287.170	775,359.000	
	CARLISLE COS INC	2,400	225.930	542,232.000	
	IDEX CORP	3,500	209.100	731,850.000	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	36,800	76.050	2,798,640.000	
	ROLLINS INC	11,607	40.630	471,592.410	
	AECOM	6,200	81.000	502,200.000	
	WATSCO INC	1,600	340.760	545,216.000	
	GRACO INC	8,000	79.800	638,400.000	
	AMETEK INC	10,700	150.680	1,612,276.000	
	TORO CO	4,900	102.040	499,996.000	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	11,400	93.810	1,069,434.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,550	56.930	429,821.500	
	HEICO CORP	2,000	162.000	324,000.000	
	GENERAC HOLDINGS INC	2,800	114.780	321,384.000	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,800	398.810	717,858.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,100	89.920	1,088,032.000	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	2,000	397.690	795,380.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	20,660	512.590	10,590,109.400	
	EPAM SYSTEMS INC	2,700	259.650	701,055.000	
	RPM INTERNATIONAL INC	5,900	83.730	494,007.000	
	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,800	241.690	676,732.000	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,300	2,062.230	2,680,899.000	
	UGI CORP	9,500	28.060	266,570.000	
	CUMMINS INC	6,600	217.800	1,437,480.000	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	35,600	80.500	2,865,800.000	
	CDW CORP/DE	6,300	174.220	1,097,586.000	
	COSTAR GROUP INC	18,900	81.880	1,547,532.000	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,600	319.670	1,470,482.000	
	MERCADOLIBRE INC	2,090	1,270.670	2,655,700.300	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,400	152.740	519,316.000	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,416	142.800	1,773,004.800	
	DEXCOM INC	18,100	122.570	2,218,517.000	
	NORDSON CORP	2,390	227.220	543,055.800	
	COPART INC	20,000	88.030	1,760,600.000	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,000	131.350	1,050,800.000	
	SEAGEN INC	6,500	195.380	1,269,970.000	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	3,400	302.000	1,026,800.000	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,700	202.770	750,249.000	
	TRANSDIGM GROUP INC	2,590	793.820	2,055,993.800	
	BIO-TECHNE CORP	7,320	83.000	607,560.000	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,600	92.320	424,672.000	
	HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,400	99.930	939,342.000	
	KINDER MORGAN INC	94,181	16.750	1,577,531.750	
	HCA HEALTHCARE INC	10,200	274.260	2,797,452.000	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,800	281.510	506,718.000	
	COTERRA ENERGY INC	35,500	23.900	848,450.000	
	T-MOBILE US INC	28,327	131.190	3,716,219.130	
	ZILLOW GROUP INC - C	7,150	46.680	333,762.000	
	COCA-COLA CO/THE	191,450	61.160	11,709,082.000	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,100	63.480	641,148.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	113.960	837,606.000	
	FRANKLIN RESOURCES INC	14,000	25.020	350,280.000	
	CSX CORP	95,400	31.920	3,045,168.000	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,100	216.980	889,618.000	
	EXPEDIA GROUP INC	6,825	103.270	704,817.750	
	AMAZON.COM INC	430,200	124.250	53,452,350.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,100	85.340	2,398,054.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EXXON MOBIL CORP	188,905	105.760	19,978,592.800	
	AES CORP	31,200	20.190	629,928.000	
	EVEREST RE GROUP LTD	2,000	343.130	686,260.000	
	EOG RESOURCES INC	27,400	111.920	3,066,608.000	
	EQT CORP	16,900	36.550	617,695.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,300	93.510	682,623.000	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	1,298.030	649,015.000	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	8,100	174.520	1,413,612.000	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,800	118.220	1,631,436.000	
	FORD MOTOR CO	183,023	12.390	2,267,654.970	
	EXACT SCIENCES CORP	8,300	83.840	695,872.000	
	LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,137	16.230	115,833.510	
	ENTEGRIS INC	7,000	108.390	758,730.000	
	AERCAP HOLDINGS NV	8,200	59.070	484,374.000	
	FORTINET INC	31,000	68.130	2,112,030.000	
	MARKEL CORP	600	1,362.180	817,308.000	
	NEXTERA ENERGY INC	94,280	73.850	6,962,578.000	
	MASIMO CORP	2,300	163.300	375,590.000	
	FREEMPORT-MCMORAN INC	66,608	37.190	2,477,151.520	
	INSULET CORP	3,200	281.030	899,296.000	
	US BANCORP	71,700	31.740	2,275,758.000	
	UNITED RENTALS INC	3,200	361.600	1,157,120.000	
	F5 NETWORKS INC	2,800	146.750	410,900.000	
	FASTENAL CO	26,600	55.370	1,472,842.000	
	FISERV INC	29,133	113.900	3,318,248.700	
	GENERAL ELECTRIC CO	50,806	105.800	5,375,274.800	
	AXON ENTERPRISE INC	3,200	193.250	618,400.000	
	PAYLOCITY HOLDING CORP	1,900	181.350	344,565.000	
	GENERAL MOTORS CO	64,600	34.280	2,214,488.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	10,900	209.090	2,279,081.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,550	323.650	5,032,757.500	
	FIRST HORIZON CORP	23,900	11.040	263,856.000	
	ALPHABET INC-CL A	277,400	124.670	34,583,458.000	
	ALPHABET INC-CL C	249,940	125.230	31,299,986.200	
	OWENS CORNING	4,300	113.520	488,136.000	
	GENERAL MILLS INC	27,300	84.590	2,309,307.000	
	FIRSTENERGY CORP	25,318	37.700	954,488.600	
	GENUINE PARTS CO	6,650	153.350	1,019,777.500	
	FIFTH THIRD BANCORP	31,200	25.950	809,640.000	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,850	182.220	1,612,647.000	
	HALLIBURTON CO	42,000	31.640	1,328,880.000	
	REPLIGEN CORP	2,500	167.260	418,150.000	
	HOME DEPOT INC	47,150	295.940	13,953,571.000	
	ASSURANT INC	2,450	123.430	302,403.500	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	67,200	10.890	731,808.000	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,910	207.480	396,286.800	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HERSHEY CO/THE	6,900	260.910	1,800,279.000	
	HUMANA INC	5,800	520.780	3,020,524.000	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,100	181.600	2,197,360.000	
	HENRY SCHEIN INC	6,100	74.420	453,962.000	
	HP INC	47,300	30.550	1,445,015.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	60,400	15.240	920,496.000	
	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,328	28.200	206,649.600	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,200	71.860	661,112.000	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,400	70.900	1,233,660.000	
	KRAFT HEINZ CO/THE	37,303	38.510	1,436,538.530	
	ENPHASE ENERGY INC	6,400	181.860	1,163,904.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,300	132.420	5,601,366.000	
	HUBBELL INC	2,500	294.490	736,225.000	
	INTERNATIONAL PAPER CO	15,300	30.380	464,814.000	
	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	5,900	64.310	379,429.000	
	ZOETIS INC	21,500	171.880	3,695,420.000	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,699	173.010	1,851,033.990	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	79.550	540,940.000	
	CHENIERE ENERGY INC	11,400	145.770	1,661,778.000	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	115.080	264,684.000	
	ALLEGION PLC	4,050	109.270	442,543.500	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,800	118.970	808,996.000	
	LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	17.080	221,578.840	
	WASTE CONNECTIONS INC	12,037	139.490	1,679,041.130	
	JUNIPER NETWORKS INC	15,000	30.970	464,550.000	
	JM SMUCKER CO/THE	5,000	148.980	744,900.000	
	JOHNSON & JOHNSON	121,000	156.970	18,993,370.000	
	ABBVIE INC	82,172	136.870	11,246,881.640	
	HOLOGIC INC	11,500	79.060	909,190.000	
	KIMBERLY-CLARK CORP	15,700	136.090	2,136,613.000	
	KROGER CO	31,800	45.920	1,460,256.000	
	KLA CORP	6,400	458.060	2,931,584.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	10,700	454.490	4,863,043.000	
	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,300	234.840	774,972.000	
	BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	37.710	395,955.000	
	LOWE'S COS INC	27,700	209.810	5,811,737.000	
	ELI LILLY & CO	37,585	442.330	16,624,973.050	
	LAM RESEARCH CORP	6,280	613.670	3,853,847.600	
	LOEWS CORP	9,100	58.020	527,982.000	
	MCDONALD'S CORP	34,050	289.910	9,871,435.500	
	3M CO	25,690	102.530	2,633,995.700	
	META PLATFORMS INC CLASS A	103,100	272.610	28,106,091.000	
	S&P GLOBAL INC	15,339	376.030	5,767,924.170	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,900	415.080	1,203,732.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,620	291.060	762,577.200	
	ALCOA CORP	8,000	34.940	279,520.000	
	PHILLIPS 66	21,400	97.030	2,076,442.000	
	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,100	183.900	1,305,690.000	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	40.710	653,395.500	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,700	88.460	1,034,982.000	
	METLIFE INC	30,600	52.970	1,620,882.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	39,900	60.180	2,401,182.000	
	ARISTA NETWORKS INC	12,200	162.500	1,982,500.000	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,798	282.730	2,204,728.540	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,000	1,332.660	1,332,660.000	
	BAKER HUGHES CO	47,223	29.580	1,396,856.340	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	5,300	292.840	1,552,052.000	
	MERCK & CO. INC.	118,221	112.520	13,302,226.920	
	DUPONT DE NEMOURS INC	22,551	72.370	1,632,015.870	
	MASCO CORP	10,300	51.470	530,141.000	
	M & T BANK CORP	7,799	125.590	979,476.410	
	MARSH & MCLENNAN COS	23,070	176.400	4,069,548.000	
	BLACK KNIGHT INC	7,350	57.310	421,228.500	
	HEICO CORP-CLASS A	3,420	128.790	440,461.800	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,302	177.220	2,180,160.440	
	WORKDAY INC-CLASS A	9,500	213.500	2,028,250.000	
	BLOCK INC CLASS A	25,212	63.460	1,599,953.520	
	TRANSUNION	9,000	74.460	670,140.000	
	VISTRA CORP	17,600	24.720	435,072.000	
	NOVOCURE LTD	4,350	79.520	345,912.000	
	NETAPP INC	9,800	70.980	695,604.000	
	NIKE INC -CL B	57,200	107.780	6,165,016.000	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	10,600	215.870	2,288,222.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,500	77.200	1,968,600.000	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,605	94.350	906,231.750	
	ALLY FINANCIAL INC	14,200	28.220	400,724.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	6,700	443.830	2,973,661.000	
	APTIV PLC	12,600	93.690	1,180,494.000	
	NEWMONT CORP	37,011	42.090	1,557,792.990	
	MCKESSON CORP	6,400	390.160	2,497,024.000	
	XYLEM INC	11,300	105.060	1,187,178.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	72,300	91.780	6,635,694.000	
	NUCOR CORP	11,700	141.290	1,653,093.000	
	GODADDY INC - CLASS A	7,000	75.730	530,110.000	
	EVERGY INC	10,750	57.730	620,597.500	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	59.690	2,001,047.560	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,250	217.710	272,137.500	
	OKTA INC	7,200	73.830	531,576.000	
	LIBERTY BROADBAND-C	5,600	74.530	417,368.000	
	WIX.COM LTD	2,610	76.540	199,769.400	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	16,800	25.750	432,600.000	
	KKR & CO INC	28,200	53.630	1,512,366.000	
	PAYCHEX INC	15,100	110.250	1,664,775.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	895.340	2,596,486.000	
	ALTRIA GROUP INC	83,200	45.330	3,771,456.000	
	P G & E CORP	84,500	16.650	1,406,925.000	
	PFIZER INC	263,013	38.360	10,089,178.680	
	CIGNA CORP	13,900	257.030	3,572,717.000	
	DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	47.270	557,833.270	
	XCEL ENERGY INC	25,600	63.140	1,616,384.000	
	STERIS PLC	4,600	205.470	945,162.000	
	SEA LTD-ADR	18,000	59.390	1,069,020.000	
	FOX CORP - CLASS B	6,533	29.840	194,944.720	
	FOX CORP - CLASS A	13,699	31.870	436,587.130	
	STRYKER CORP	15,880	278.300	4,419,404.000	
	DOW INC	33,018	51.610	1,704,058.980	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,100	70.360	358,836.000	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,000	67.090	737,990.000	
	PARKER HANNIFIN CORP	6,000	340.730	2,044,380.000	
	UBER TECHNOLOGIES INC	85,300	39.730	3,388,969.000	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,900	205.670	2,241,803.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	109,867	146.520	16,097,712.840	
	EXELON CORP	46,322	39.690	1,838,520.180	
	INGERSOLL-RAND INC	18,908	61.360	1,160,194.880	
	NVR INC	150	5,711.000	856,650.000	
	CONOCOPHILLIPS	56,702	102.350	5,803,449.700	
	TWILIO INC - A	8,300	67.150	557,345.000	
	DOCUSIGN INC	9,400	57.470	540,218.000	
	PAYCOM SOFTWARE INC	2,500	293.320	733,300.000	
	CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,800	64.910	441,388.000	
	PEPSICO INC	64,200	184.060	11,816,652.000	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,020	149.310	301,606.200	
	DROPBOX INC-CLASS A	12,100	23.680	286,528.000	
	MONGODB INC	3,300	376.300	1,241,790.000	
	SNAP INC - A	49,700	10.410	517,377.000	
	CORTEVA INC	33,168	55.920	1,854,754.560	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,100	83.040	1,419,984.000	
	AMCOR PLC	69,300	9.970	690,921.000	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,400	151.320	1,573,728.000	
	ROKU INC	5,500	60.140	330,770.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,100	145.790	1,326,689.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	29,400	311.390	9,154,866.000	
	PENTAIR PLC	7,475	58.500	437,287.500	
	QUALCOMM INC	51,900	115.620	6,000,678.000	
	INVESCO LTD	15,200	15.260	231,952.000	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	2,750	67.560	185,790.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,100	69.470	771,117.000	
	DATADOG INC - CLASS A	11,600	98.770	1,145,732.000	
	PINTEREST INC- CLASS A	27,700	23.470	650,119.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,000	739.950	3,699,750.000	
	REPUBLIC SERVICES INC	10,300	144.500	1,488,350.000	
	BOOKING HOLDINGS INC	1,800	2,625.650	4,726,170.000	
	ROSS STORES INC	15,800	103.300	1,632,140.000	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	4,230	128.080	541,778.400	
	RESMED INC	6,800	220.640	1,500,352.000	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	5,230	135.560	708,978.800	
	ROBERT HALF INTL INC	4,900	69.880	342,412.000	
	MODERNA INC	15,300	130.510	1,996,803.000	
	HUBSPOT INC	2,180	524.140	1,142,625.200	
	REVVITY INC	5,900	115.220	679,798.000	
	CARRIER GLOBAL CORP	38,887	43.440	1,689,251.280	
	OTIS WORLDWIDE CORP	19,238	85.600	1,646,772.800	
	BILL HOLDINGS INC	4,500	107.460	483,570.000	
	AVANTOR INC	31,500	20.020	630,630.000	
	CARLYLE GROUP INC/THE	10,200	28.790	293,658.000	
	DYNATRACE INC	10,100	52.620	531,462.000	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	20,700	74.240	1,536,768.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	43,485	18.060	785,339.100	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	13,200	26.450	349,140.000	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	17,600	33.420	588,192.000	
	MATCH GROUP INC	12,600	38.970	491,022.000	
	CHEVRON CORP	83,718	156.260	13,081,774.680	
	ZSCALER INC	4,100	142.390	583,799.000	
	EDISON INTERNATIONAL	17,800	66.680	1,186,904.000	
	ETSY INC	5,700	85.010	484,557.000	
	TESLA INC	133,350	213.970	28,532,899.500	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	12,200	175.210	2,137,562.000	
	GEN DIGITAL INC	26,700	17.990	480,333.000	
	UNITY SOFTWARE INC	11,300	31.000	350,300.000	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	7,102	80.730	573,344.460	
	SYNOPSIS INC	7,100	449.360	3,190,456.000	
	CHEWY INC - CLASS A	4,350	35.510	154,468.500	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,700	70.640	897,128.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,005	329.320	1,648,246.600	
	VIATRIS INC	55,821	9.330	520,809.930	
	DOORDASH INC - A	11,950	67.880	811,166.000	
	ROBLOX CORP -CLASS A	19,700	40.340	794,698.000	
	AIRBNB INC-CLASS A	19,300	118.060	2,278,558.000	
	CBRE GROUP INC - A	14,500	77.130	1,118,385.000	
	SOUTHERN CO/THE	50,800	69.450	3,528,060.000	
	SYSCO CORP	23,600	72.640	1,714,304.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	10,803	175.130	1,891,929.390	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	38.980	113,042.000	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	5,300	58.520	310,156.000	
	STEEL DYNAMICS INC	8,150	97.710	796,336.500	
	SCHLUMBERGER LTD	66,152	46.770	3,093,929.040	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	42.940	300,580.000	
	AT&T INC	332,091	15.210	5,051,104.110	
	APA CORP	14,400	33.680	484,992.000	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	6,950	30.070	208,986.500	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,100	86.830	1,745,283.000	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,000	44.860	448,600.000	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,400	240.830	2,745,462.000	
	SEMPRA ENERGY	14,700	144.570	2,125,179.000	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	49.960	524,580.000	
	CLARIVATE PLC	17,500	8.010	140,175.000	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	84,100	14.520	1,221,132.000	
	UIPATH INC - CLASS A	17,500	18.240	319,200.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,850	62.210	550,558.500	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,800	64.550	503,490.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,300	175.230	7,412,229.000	
	SALESFORCE.COM INC	46,566	213.030	9,919,954.980	
	WESTROCK CO	11,900	28.860	343,434.000	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	18,609	69.700	1,297,047.300	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	32,034	62.390	1,998,601.260	
	TERADYNE INC	7,300	103.220	753,506.000	
	UNION PACIFIC CORP	28,380	198.660	5,637,970.800	
	MARATHON OIL CORP	29,900	23.260	695,474.000	
	MARATHON PETROLEUM CORP	22,188	108.910	2,416,495.080	
	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	68,079	96.080	6,541,030.320	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	33,700	170.140	5,733,718.000	
	IQVIA HOLDINGS INC	8,704	201.370	1,752,724.480	
	AMEREN CORPORATION	12,200	81.170	990,274.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	43,466	499.580	21,714,744.280	
	TOAST INC CLASS A	14,400	21.070	303,408.000	
	VERISIGN INC	4,400	226.970	998,668.000	
	LUCID GROUP INC	30,500	6.600	201,300.000	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO)	30,900	14.480	447,432.000	
	VALERO ENERGY CORP	17,642	109.270	1,927,741.340	
	ULTA BEAUTY INC	2,300	422.400	971,520.000	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,688	35.140	410,716.320	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	135.460	383,351.800	
	ELEVANCE HEALTH INC	11,100	471.020	5,228,322.000	
	WALT DISNEY CO/THE	85,062	90.770	7,721,077.740	
	WELLS FARGO & CO	175,222	41.240	7,226,155.280	
	WASTE MANAGEMENT INC	18,900	164.960	3,117,744.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WILLIAMS COS INC	56,800	30.230	1,717,064.000	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,100	211.190	1,077,069.000	
	WHIRLPOOL CORP	2,400	135.690	325,656.000	
	WALMART INC	69,000	148.820	10,268,580.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,800	129.810	1,272,138.000	
	WYNN RESORTS LTD	4,800	100.350	481,680.000	
	GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	92,000	3.020	277,840.000	
	WABTEC CORP	8,411	97.920	823,605.120	
	TJX COMPANIES INC	53,700	78.110	4,194,507.000	
	WATERS CORP	2,700	258.770	698,679.000	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,400	278.010	667,224.000	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,200	31.190	1,066,698.000	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,963	224.530	1,114,342.390	
	WESTERN DIGITAL CORP	14,900	40.240	599,576.000	
	WEC ENERGY GROUP INC	14,700	87.080	1,280,076.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	23,200	61.040	1,416,128.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	75,750	228.790	17,330,842.500	
	PPL CORP	34,300	26.520	909,636.000	
	CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	15,324	87.540	1,341,462.960	
	PULTEGROUP INC	10,350	69.380	718,083.000	
	WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	107,753	11.750	1,266,097.750	
	PPG INDUSTRIES INC	11,000	139.580	1,535,380.000	
	NORTHERN TRUST CORP	9,700	75.180	729,246.000	
	FERGUSON PLC	9,600	147.760	1,418,496.000	
	NVIDIA CORP	115,080	393.270	45,257,511.600	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	18,613	123.580	2,300,194.540	
	ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,400	165.500	231,700.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	13,200	51.340	677,688.000	
	NETFLIX INC	20,690	400.470	8,285,724.300	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,900	520.140	9,310,506.000	
	NRG ENERGY INC	10,550	33.300	351,315.000	
	GLOBE LIFE INC	4,255	107.040	455,455.200	
	TEXTRON INC	9,400	64.050	602,070.000	
	NEWS CORP - CLASS A	17,887	18.800	336,275.600	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,372.000	480,200.000	
	OMNICOM GROUP	9,300	91.320	849,276.000	
	JACOBS SOLUTIONS INC	5,920	114.990	680,740.800	
	ORACLE CORP	75,533	105.890	7,998,189.370	
	MASTERCARD INC - A	39,600	373.730	14,799,708.000	
	ONEOK INC	20,800	58.740	1,221,792.000	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	5,000	458.860	2,294,300.000	
	U HAUL NON VOTING SERIES N	4,600	49.360	227,056.000	
	ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	7,400	89.290	660,746.000	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,200	79.630	414,076.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HF SINCLAIR CORP	7,300	43.260	315,798.000	
	OVINTIV INC	11,300	35.590	402,167.000	
	YUM! BRANDS INC	13,000	134.530	1,748,890.000	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,900	137.520	1,086,408.000	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,800	63.870	562,056.000	
	BANK OF AMERICA CORP	335,301	28.710	9,626,491.710	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,200	397.420	874,324.000	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,800	93.360	821,568.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	29,500	168.560	4,972,520.000	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	16,935	79.970	1,354,291.950	
	LINDE PLC	22,846	360.470	8,235,297.620	
	ANALOG DEVICES INC	23,591	179.800	4,241,661.800	
	ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	14,100	20.500	289,050.000	
	MONDAYCOM LTD	900	175.000	157,500.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	75,027	117.860	8,842,682.220	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	33,872	55.200	1,869,734.400	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,300	105.120	767,376.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,700	86.230	922,661.000	
	AVERY DENNISON CORP	3,830	166.330	637,043.900	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,700	63.760	1,511,112.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	26,900	82.810	2,227,589.000	
	AON PLC-CLASS A	9,600	313.800	3,012,480.000	
	AMGEN INC	24,900	218.070	5,429,943.000	
	EATON CORP PLC	18,536	186.480	3,456,593.280	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,700	245.420	1,889,734.000	
	APPLIED MATERIALS INC	39,300	134.630	5,290,959.000	
	CME GROUP INC	16,800	185.300	3,113,040.000	
	ECOLAB INC	11,900	173.100	2,059,890.000	
	EQUIFAX INC	5,700	213.650	1,217,805.000	
	GILEAD SCIENCES INC	58,200	77.890	4,533,198.000	
	KEURIG DR PEPPER INC	42,900	31.450	1,349,205.000	
	HORMEL FOODS CORP	14,000	40.770	570,780.000	
	STATE STREET CORP	16,713	71.550	1,195,815.150	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	70,140	54.370	3,813,511.800	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	23,600	41.330	975,388.000	
	CAMPBELL SOUP CO	9,400	51.470	483,818.000	
	CROWN HOLDINGS INC	5,580	80.370	448,464.600	
	CARDINAL HEALTH INC	12,100	84.590	1,023,539.000	
	FEDEX CORP	11,200	221.740	2,483,488.000	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,754	110.490	1,961,639.460	
	FMC CORP	5,850	107.070	626,359.500	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,913	80.050	953,635.650	
	INTEL CORP	194,400	31.310	6,086,664.000	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,000	38.670	696,060.000	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,450	70.550	1,019,447.500	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WOLFSPEED INC	5,800	49.060	284,548.000	
	ILLINOIS TOOL WORKS	14,200	229.180	3,254,356.000	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	3.580	138,188.000	
	ILLUMINA INC	7,400	207.310	1,534,094.000	
	SEALED AIR CORP	6,700	39.720	266,124.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	16,300	312.180	5,088,534.000	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,850	124.030	601,545.500	
	SNAP-ON INC	2,500	259.710	649,275.000	
	CARMAX INC	7,400	74.660	552,484.000	
	DUKE ENERGY CORP	35,928	89.680	3,222,023.040	
	TARGET CORP	21,400	133.220	2,850,908.000	
	DOVER CORP	6,400	139.860	895,104.000	
	WW GRAINGER INC	2,100	677.770	1,423,317.000	
	CINTAS CORP	4,300	481.560	2,070,708.000	
	CONAGRA BRANDS INC	22,200	35.130	779,886.000	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,800	113.270	770,236.000	
	CLOROX COMPANY	5,800	161.370	935,946.000	
	ENTERGY CORP	9,900	99.440	984,456.000	
	MICROSOFT CORP	329,400	335.400	110,480,760.000	
	INCYTE CORP	8,600	62.540	537,844.000	
	CVS HEALTH CORP	59,669	69.990	4,176,233.310	
	MEDTRONIC PLC	61,998	83.760	5,192,952.480	
	MICRON TECHNOLOGY INC	51,000	69.170	3,527,670.000	
	BLACKROCK INC	7,000	681.860	4,773,020.000	
	CENTERPOINT ENERGY INC	29,300	28.600	837,980.000	
	HASBRO INC	6,000	60.020	360,120.000	
	KELLOGG CO	12,800	67.390	862,592.000	
	KEYCORP	43,100	10.280	443,068.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	63,511	74.270	4,716,961.970	
	COOPER COS INC/THE	2,300	356.470	819,881.000	
	CHUBB LTD	19,299	192.360	3,712,355.640	
	ARROW ELECTRONICS INC	2,900	128.790	373,491.000	
	ALLSTATE CORP	12,300	110.080	1,353,984.000	
	EBAY INC	24,900	44.390	1,105,311.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	49,650	63.960	3,175,614.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,500	82.570	454,135.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,800	188.290	2,033,532.000	
	TRIMBLE INC	11,500	49.560	569,940.000	
	LENNAR CORP-A	11,800	112.000	1,321,600.000	
	LEAR CORP	2,800	131.060	366,968.000	
	PROGRESSIVE CORP	27,300	129.500	3,535,350.000	
	PACCAR INC	24,255	73.300	1,777,891.500	
	BIOGEN INC	6,700	300.200	2,011,340.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,900	470.830	1,836,237.000	
	STARBUCKS CORP	53,500	99.500	5,323,250.000	
	PTC INC	5,200	137.930	717,236.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EVERSOURCE ENERGY	16,200	70.010	1,134,162.000	
	INTUIT INC	13,080	430.490	5,630,809.200	
	BORGWARNER INC	10,600	47.680	505,408.000	
	BEST BUY CO INC	9,250	73.210	677,192.500	
	BALL CORP	14,604	54.440	795,041.760	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	51.820	3,471,784.540	
	ELECTRONIC ARTS INC	12,800	127.670	1,634,176.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,200	202.730	1,256,926.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,000	333.780	4,005,360.000	
	VF CORP	14,700	18.120	266,364.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	27,125	15.400	417,725.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	96.680	241,700.000	
	CARNIVAL CORP	46,800	12.180	570,024.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	23,100	15.050	347,655.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	196,190	39.190	7,688,686.100	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	48.440	421,428.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	53,500	4.310	230,585.000	
	アメリカ・ドル 小計				1,729,467,790.650 (242,436,794,894)
イギリス・ポンド	SHELL PLC	315,129	22.900	7,216,454.100	
	HALEON PLC	231,333	3.272	756,921.570	
	WISE PLC CLASS A	30,273	6.060	183,454.380	
	BP PLC	816,509	4.743	3,873,110.440	
	UNILEVER PLC	115,022	40.565	4,665,867.430	
	BARCLAYS PLC	707,553	1.567	1,109,160.080	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	381,060	1.500	571,590.000	
	PRUDENTIAL PLC	125,414	11.530	1,446,023.420	
	NATWEST GROUP PLC	262,737	2.650	696,253.050	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,388	18.045	151,361.460	
	BAE SYSTEMS PLC	139,042	9.424	1,310,331.800	
	AVIVA PLC	127,014	4.091	519,614.270	
	GSK	186,614	13.676	2,552,133.060	
	INFORMA PLC	62,995	7.048	443,988.760	
	AUTO TRADER GROUP PLC	41,019	6.170	253,087.230	
	DCC PLC	4,301	47.520	204,383.520	
	OCADO GROUP PLC	23,827	3.582	85,348.310	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,270	111.800	365,586.000	
	HALMA PLC	16,864	24.620	415,191.680	
	ENTAIN PLC	26,861	13.280	356,714.080	
	JD SPORTS FASHION PLC	112,804	1.569	176,989.470	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	32,680	5.670	185,295.600	
	M&G PLC	104,504	2.040	213,188.160	
	ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	21.780	199,090.980	
	RELX PLC	86,625	25.660	2,222,797.500	
	DIAGEO PLC	102,628	33.725	3,461,129.300	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	RIO TINTO PLC	51,279	50.700	2,599,845.300	
	STANDARD CHARTERED PLC	108,504	6.640	720,466.560	
	TESCO PLC	333,384	2.624	874,799.610	
	SMITH & NEPHEW PLC	39,859	12.090	481,895.310	
	GLENCORE PLC	487,397	4.339	2,114,815.580	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,095	8.172	123,356.340	
	SMITHS GROUP PLC	15,383	16.190	249,050.770	
	PEARSON PLC	28,363	8.206	232,746.770	
	SAINSBURY (J) PLC	78,274	2.785	217,993.090	
	NEXT PLC	5,620	65.020	365,412.400	
	TAYLOR WIMPEY PLC	157,039	1.180	185,384.530	
	WHITBREAD PLC	9,218	33.740	311,015.320	
	BUNZL PLC	15,410	31.560	486,339.600	
	VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.756	866,411.220	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,203	62.300	386,446.900	
	KINGFISHER PLC	85,779	2.389	204,926.030	
	WPP PLC	48,968	8.790	430,428.720	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,105	10.365	322,403.320	
	SEVERN TRENT PLC	11,475	27.060	310,513.500	
	RENTOKIL INITIAL PLC	114,775	6.482	743,971.550	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	32,621	63.080	2,057,732.680	
	ST JAMES' S PLACE PLC	24,174	11.535	278,847.090	
	SCHRODERS PLC	39,815	4.633	184,462.890	
	SSE PLC	49,692	18.680	928,246.560	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	43,245	4.818	208,354.410	
	ASTRAZENECA PLC	70,592	117.480	8,293,148.160	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	272,067	2.360	642,078.120	
	3I GROUP PLC	44,331	19.600	868,887.600	
	ASHTED GROUP PLC	19,973	51.120	1,021,019.760	
	SAGE GROUP PLC/THE	46,665	8.722	407,012.130	
	NATIONAL GRID PLC	167,557	10.550	1,767,726.350	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,016,079	0.454	1,370,657.100	
	IMPERIAL BRANDS PLC	39,967	17.310	691,828.770	
	CENTRICA PLC	279,988	1.204	337,245.540	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,918	40.440	198,883.920	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	96,741	25.705	2,486,727.400	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,800	18.695	295,381.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	910,010	6.027	5,484,630.270	
	ANGLO AMERICAN PLC	57,876	24.180	1,399,441.680	
	MONDI PLC	22,149	12.910	285,943.590	
	COMPASS GROUP PLC	79,435	22.070	1,753,130.450	
	PERSIMMON PLC	13,915	12.525	174,285.370	
	BT GROUP PLC	345,300	1.436	496,023.450	
	COCA-COLA HBC AG-DI	10,136	23.890	242,149.040	
	BURBERRY GROUP PLC	17,053	21.860	372,778.580	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,005	54.020	432,430.100	
	INTERTEK GROUP PLC	7,169	42.680	305,972.920	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,564	84.940	1,576,826.160	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,361	18.030	132,718.830	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,779	23.740	232,153.460	
	ANTOFAGASTA PLC	17,513	14.565	255,076.840	
	ABRDN PLC	90,862	2.035	184,904.170	
	EXPERIAN PLC	41,857	28.980	1,213,015.860	
イギリス・ポンド 小計				82,443,008.320 (14,364,869,770)	
イスラエル・シ ュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	60,911	18.240	1,111,016.640	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	199.500	364,287.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,051	143.200	723,303.200	
	ICL GROUP LTD	38,090	20.850	794,176.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,310	739.000	968,090.000	
	BANK HAPOALIM BM	62,536	30.380	1,899,843.680	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	76,017	27.020	2,053,979.340	
	NICE LTD	3,128	769.000	2,405,432.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7,598	122.400	929,995.200	
イスラエル・シュケル 小計				11,250,123.560 (421,016,750)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	95,515	4.990	476,619.850	
	TELSTRA GROUP LTD	176,757	4.340	767,125.380	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	131,029	22.770	2,983,530.330	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	116,553	3.580	417,259.740	
	BHP GROUP LTD	220,895	43.250	9,553,708.750	
	SOUTH32 LTD	194,263	3.930	763,453.590	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	82,795	34.550	2,860,567.250	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	73,842	19.690	1,453,948.980	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	136,792	25.790	3,527,865.680	
	WESTPAC BANKING CORP	153,058	20.540	3,143,811.320	
	SANTOS LTD	144,925	7.440	1,078,242.000	
	RIO TINTO LTD	16,187	110.150	1,782,998.050	
	ORIGIN ENERGY LTD	75,281	8.370	630,101.970	
	AURIZON HOLDINGS LTD	75,100	3.590	269,609.000	
	PILBARA MINERALS LTD	113,184	4.470	505,932.480	
	XERO LTD	6,302	111.870	705,004.740	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	32.770	340,414.760	
	COLES GROUP LTD	58,509	17.820	1,042,630.380	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,381	76.630	565,606.030	
	IDP EDUCATION LTD	11,169	21.750	242,925.750	
IGO LTD	30,405	14.090	428,406.450		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,726	13.620	677,268.120		
REECE LTD	10,500	18.320	192,360.000		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	60,660	6.160	373,665.600		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SEEK LTD	14,264	23.570	336,202.480	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	30,976	11.410	353,436.160	
	NEWCREST MINING LTD	39,092	27.500	1,075,030.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	73,593	96.910	7,131,897.630	
	AMPOL LTD	10,454	31.760	332,019.040	
	ORICA LTD	19,499	15.290	298,139.710	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	65,087	14.620	951,571.940	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	53,152	37.550	1,995,857.600	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	6.680	261,067.760	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	18,801	38.250	719,138.250	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,010	171.000	2,737,710.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,750	37.880	975,410.000	
	CSL LTD	21,034	308.000	6,478,472.000	
	WESFARMERS LTD	49,470	47.800	2,364,666.000	
	COCHLEAR LTD	2,823	245.010	691,663.230	
	BLUESCOPE STEEL LTD	19,124	19.590	374,639.160	
	SUNCORP GROUP LTD	54,249	13.300	721,511.700	
	ASX LTD	8,307	67.450	560,307.150	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	22.160	557,745.040	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	103,987	5.130	533,453.310	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,599	35.810	701,840.190	
	BRAMBLES LTD	60,760	13.380	812,968.800	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,602	69.500	528,339.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,857	57.850	454,527.450	
	REA GROUP LTD	2,236	136.980	306,287.280	
	オーストラリア・ドル 小計			67,036,957.080 (6,198,237,052)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	35,500	67.670	2,402,285.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	15,181	42.490	645,040.690	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	64.440	612,180.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	900	2,775.840	2,498,256.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,187	102.530	1,352,063.110	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,800	60.890	1,205,622.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,850	200.850	1,576,672.500	
	BCE INC	4,930	61.380	302,603.400	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,500	198.210	1,684,785.000	
	SUNCOR ENERGY INC	59,230	39.250	2,324,777.500	
	METRO INC/CN	10,300	71.920	740,776.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	15,000	98.650	1,479,750.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	53,000	66.710	3,535,630.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,300	57.360	2,311,608.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	81,000	78.890	6,390,090.000	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	12,500	38.820	485,250.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	61,650	124.060	7,648,299.000	
	TOURMALINE OIL CORP	14,400	59.730	860,112.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TC ENERGY CORP	45,350	55.230	2,504,680.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,529	43.000	1,054,747.000	
	BARRICK GOLD CORP	78,300	23.230	1,818,909.000	
	CAE INC	14,200	28.800	408,960.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,512	165.920	1,246,391.040	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	34.700	246,370.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	95.080	332,780.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,550	63.180	413,829.000	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	20.550	361,680.000	
	HYDRO ONE LTD	14,400	38.840	559,296.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	6,960	118.490	824,690.400	
	NORTHLAND POWER INC	11,200	29.770	333,424.000	
	WSP GLOBAL INC	5,500	175.790	966,845.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,700	108.320	400,784.000	
	PARKLAND CORP	6,600	34.400	227,040.000	
	QUEBECOR INC -CL B	6,800	32.480	220,864.000	
	EMERA INC	11,800	56.550	667,290.000	
	TFI INTERNATIONAL INC	3,500	148.210	518,735.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,400	36.550	197,370.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,800	59.610	941,838.000	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	98.490	157,584.000	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,700	11.120	296,904.000	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	22,117	69.740	1,542,439.580	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	11.440	335,192.000	
	AIR CANADA	7,600	21.720	165,072.000	
	KINROSS GOLD CORP	56,100	6.510	365,211.000	
	BANK OF MONTREAL	31,700	116.650	3,697,805.000	
	POWER CORP OF CANADA	26,000	35.360	919,360.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	53,300	78.250	4,170,725.000	
	NUTRIEN LTD	23,119	73.600	1,701,558.400	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,800	47.090	273,122.000	
	CAMECO CORP	18,900	40.380	763,182.000	
	FIRSTSERVICE CORP	1,800	198.610	357,498.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,700	50.400	488,880.000	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	41.100	106,860.000	
	TELUS CORP	10,800	25.730	277,884.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,500	58.210	1,193,305.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	168.290	403,896.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	49,300	75.270	3,710,811.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	986.500	986,500.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	12,100	68.720	831,512.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,137	160.280	502,798.360	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	20.810	353,770.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	103.390	392,882.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	26,100	67.430	1,759,923.000	
	ENBRIDGE INC	90,000	50.260	4,523,400.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BROOKFIELD CORP	62,625	41.650	2,608,331.250	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	81,800	25.880	2,116,984.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,420	105.660	4,376,437.200	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,400	89.150	392,260.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	39.080	293,100.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,250	157.980	3,988,995.000	
	CGI INC - CLASS A	9,400	141.600	1,331,040.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	61.730	179,017.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	39.700	142,920.000	
	TMX GROUP LTD	2,500	148.090	370,225.000	
	OPEN TEXT CORP	12,100	56.500	683,650.000	
	SAPUTO INC	10,800	35.200	380,160.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	25,800	30.080	776,064.000	
	FORTIS INC	21,600	57.640	1,245,024.000	
	RB GLOBAL INC	8,400	73.860	620,424.000	
	LUNDIN MINING CORP	27,800	10.070	279,946.000	
	CENOVUS ENERGY INC	63,200	22.820	1,442,224.000	
	DOLLARAMA INC	12,800	83.480	1,068,544.000	
	ALTAGAS LTD	12,100	24.280	293,788.000	
	KEYERA CORP	10,200	31.320	319,464.000	
ARC RESOURCES LTD	28,600	16.840	481,624.000		
カナダ・ドル 小計				105,970,618.930 (11,060,153,497)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	128,100	3.310	424,011.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	62,300	27.840	1,734,432.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	89,200	30.600	2,729,520.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,975	6.600	435,435.000	
	KEPPEL CORP LTD	71,700	6.260	448,842.000	
	UOL GROUP LTD	22,900	6.480	148,392.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,600	6.780	166,788.000	
	SEATRUM	2,016,022	0.121	243,938.660	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,400	32.140	141,416.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	166,700	12.230	2,038,741.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	279,500	1.000	279,500.000	
	VENTURE CORP LTD	12,800	14.970	191,616.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	406,650	2.500	1,016,625.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	72,200	3.650	263,530.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,200	9.380	395,836.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	94,600	3.880	367,048.000	
シンガポール・ドル 小計				11,025,670.660 (1,143,582,561)	
スイス・フラン	DUFY AG-REG	4,854	41.500	201,441.000	
	UBS GROUP AG-REG	145,555	18.080	2,631,634.400	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	313.000	452,911.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	307	719.000	220,733.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,823	28.470	194,250.810	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	31,265	292.800	9,154,392.000	
	SIKA AG-REG	6,499	255.800	1,662,444.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	112,600.000	563,000.000	
	ABB LTD-REG	69,946	33.940	2,373,967.240	
	SWISS RE AG	13,423	93.200	1,251,023.600	
	NESTLE SA-REG	122,379	109.600	13,412,738.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,010	841.600	850,016.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,774	196.750	349,034.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,536	57.200	545,459.200	
	SGS SA-REG	6,925	83.880	580,869.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,026	189.700	194,632.200	
	TEMENOS AG - REG	2,716	78.120	212,173.920	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	126.600	231,424.800	
	VAT GROUP AG	1,176	375.100	441,117.600	
	BKW AG	942	162.800	153,357.600	
	ALCON INC	22,237	72.100	1,603,287.700	
	SIG GROUP N AG	13,641	24.920	339,933.720	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,290	267.300	344,817.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,696	432.300	2,894,680.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,956	142.400	278,534.400	
	CLARIANT AG-REG	9,678	13.160	127,362.480	
	NOVARTIS AG-REG	94,023	89.370	8,402,835.510	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,867.000	296,853.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,424	94.550	134,639.200	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	23,230	145.750	3,385,772.500	
	SWISSCOM AG-REG	1,153	568.800	655,826.400	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	92.550	124,387.200	
	GEBERIT AG-REG	1,559	498.500	777,161.500	
	GIVAUDAN-REG	411	3,043.000	1,250,673.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,967	136.150	676,257.050	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,279	239.200	545,136.800	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,375	57.520	424,210.000	
	LONZA GROUP AG-REG	3,314	586.800	1,944,655.200	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	50.500	114,584.500	
	HOLCIM LTD	24,669	57.240	1,412,053.560	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	538.000	738,136.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,424	264.300	640,663.200	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,275	77.700	254,467.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	11,130.000	489,720.000	
	スイス・フラン 小計			63,533,268.690 (9,784,758,711)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	8,813	232.000	2,044,616.000	
	INVESTOR CLASS A	23,863	222.700	5,314,290.100	
	VOLVO CAR CLASS B	28,514	40.160	1,145,122.240	
	ERICSSON LM-B SHS	143,721	56.520	8,123,110.920	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	VOLVO AB-B SHS	74,305	207.850	15,444,294.250	
	SKF AB-B SHARES	17,719	179.650	3,183,218.350	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	94.920	2,499,528.360	
	GETINGE AB-B SHS	10,572	254.000	2,685,288.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	79,569	118.350	9,416,991.150	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,793	89.900	6,274,390.700	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,333	174.200	7,548,608.600	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	142.340	4,974,213.640	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	29,833	149.550	4,461,525.150	
	SKANSKA AB-B SHS	15,724	146.450	2,302,779.800	
	SANDVIK AB	52,501	203.300	10,673,453.300	
	INVESTOR AB-B SHS	87,179	221.800	19,336,302.200	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	131,528	159.800	21,018,174.400	
	VOLVO AB-A SHS	9,255	216.400	2,002,782.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,336	426.000	1,847,136.000	
	SECURITAS AB-B SHS	22,743	83.800	1,905,863.400	
	TELIA CO AB	122,866	25.150	3,090,079.900	
	ALFA LAVAL AB	13,863	397.000	5,503,611.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	76,858	137.600	10,575,660.800	
	ASSA ABLOY AB-B	49,353	248.500	12,264,220.500	
	SAAB AB-B	3,943	596.600	2,352,393.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,027	296.100	1,784,594.700	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	30,192	39.540	1,193,791.680	
	INDUTRADE AB	13,454	262.400	3,530,329.600	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,807	213.000	1,662,891.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,513	466.000	1,637,058.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	222.600	1,523,251.800	
	LIFCO AB-B SHS	10,774	230.700	2,485,561.800	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	74,623	105.800	7,895,113.400	
	BEIJER REF AB	16,584	161.000	2,670,024.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,993	293.000	8,787,949.000	
	EMBRACER GROUP AB	30,041	25.270	759,136.070	
	BOLIDEN AB	13,087	357.800	4,682,528.600	
	EPIROC AB-A	31,534	201.400	6,350,947.600	
	EPIROC AB-B	19,202	171.200	3,287,382.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	86.220	1,672,236.900	
	NORDEA BANK ABP	160,871	110.700	17,808,419.700	
	EQT AB	17,511	211.200	3,698,323.200	
	EVOLUTION AB	9,024	1,449.000	13,075,776.000	
	KINNEVIK AB - B	11,612	160.900	1,868,370.800	
	HEXAGON AB-B SHS	102,232	128.300	13,116,365.600	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,118	294.400	2,095,539.200	
	スウェーデン・クローナ 小計			267,573,245.610 (3,465,073,531)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	79,858	1,081.000	86,326,498.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DANSKE BANK A/S	33,963	148.300	5,036,712.900	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	12,140.000	1,857,420.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	49,726	204.300	10,159,021.800	
	CARLSBERG AS-B	4,849	1,046.500	5,074,478.500	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,071	341.800	3,442,267.800	
	COLOPLAST-B	5,850	881.400	5,156,190.000	
	DSV PANALPINA A/S	9,166	1,363.500	12,497,841.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,760.000	749,760.000	
	DEMANT A/S	4,275	269.900	1,153,822.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	240	12,270.000	2,944,800.000	
	TRYG A/S	17,729	158.250	2,805,614.250	
	PANDORA A/S	4,341	565.000	2,452,665.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,194	513.000	2,664,522.000	
	GENMAB A/S	3,249	2,722.000	8,843,778.000	
	ORSTED A/S	9,315	610.600	5,687,739.000	
デンマーク・クローネ 小計				156,853,130.750 (3,157,453,521)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	59,568	5.575	332,091.600	
	MERCURY NZ LTD	34,143	6.650	227,050.950	
	EBOS GROUP LTD	7,660	41.460	317,583.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,147	5.195	478,703.660	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,644	8.790	541,850.760	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	27,626	23.960	661,918.960	
ニュージーランド・ドル 小計				2,559,199.530 (217,173,672)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	45,804	190.550	8,727,952.200	
	NORSK HYDRO ASA	64,351	69.840	4,494,273.840	
	ORKLA ASA	36,983	79.200	2,929,053.600	
	TELENOR ASA	34,455	112.900	3,889,969.500	
	EQUINOR ASA	46,908	294.750	13,826,133.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,153	422.600	3,445,457.800	
	MOWI ASA	21,643	190.000	4,112,170.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,244	183.100	1,692,576.400	
	AKER BP ASA	15,560	257.000	3,998,920.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,098	453.200	1,857,213.600	
	SALMAR ASA	3,573	477.600	1,706,464.800	
ADEVINTA ASA	13,944	80.700	1,125,280.800		
ノルウェー・クローネ 小計				51,805,465.540 (658,965,521)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	37,346	19.030	710,694.380	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	22,443	29.310	657,804.330	
	EXOR NV	4,786	79.960	382,688.560	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,136	118.000	606,048.000	
	CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	31.960	93,898.480	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DSM FIRMENICH AG	7,889	103.820	819,035.980	
	BAYER AG-REG	44,238	52.610	2,327,361.180	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,486	18.375	174,305.250	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	90,946	9.862	896,909.450	
	COMMERZBANK AG	48,018	9.576	459,820.360	
	VOLKSWAGEN AG	1,304	150.150	195,795.600	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	9,372	121.540	1,139,072.880	
	SIEMENS AG-REG	34,201	159.280	5,447,535.280	
	E.ON SE	101,096	11.320	1,144,406.720	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,909	106.160	1,582,739.440	
	GEA GROUP AG	6,681	40.100	267,908.100	
	CONTINENTAL AG	4,853	66.680	323,598.040	
	BASF SE	40,416	46.790	1,891,064.640	
	ALLIANZ SE-REG	18,163	210.150	3,816,954.450	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,695	74.800	575,586.000	
	RHEINMETALL AG	1,965	240.100	471,796.500	
	RWE AG	28,268	39.330	1,111,780.440	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,029	9.303	251,450.780	
	BRENNTAG SE	6,969	75.480	526,020.120	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	19,055	26.230	499,812.650	
	SAP SE	47,021	124.360	5,847,531.560	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,309	342.600	2,161,463.400	
	ZALANDO SE	9,669	27.120	262,223.280	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	6,389	69.880	446,463.320	
	COVESTRO AG	8,520	38.670	329,468.400	
	RATIONAL AG	215	642.000	138,030.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	333.500	403,535.000	
	TALANX AG	3,119	53.650	167,334.350	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,755	54.160	365,850.800	
	DELIVERY HERO SE	7,584	36.690	278,256.960	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,748	111.600	195,076.800	
	BECHTLE AG	3,626	37.310	135,286.060	
	NEMETSCHEK SE	2,557	74.800	191,263.600	
	SCOUT24 AG	3,600	61.240	220,464.000	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,721	53.800	684,389.800	
	KNORR-BREMSE AG	3,158	65.780	207,733.240	
	HELLOFRESH SE	7,177	20.550	147,487.350	
	SIEMENS ENERGY AG	23,742	24.400	579,304.800	
	BEIERSDORF AG	4,547	120.650	548,595.550	
	MERCK KGAA	5,820	167.100	972,522.000	
	ADIDAS AG	7,467	159.520	1,191,135.840	
	PUMA SE	4,586	47.210	216,505.060	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,584	67.700	310,336.800	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	145,949	19.138	2,793,171.960	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,061	40.580	367,695.380	
	MERCEDES-BENZ GROUP N AG	38,764	72.240	2,800,311.360	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	QIAGEN N. V.	10,272	43.440	446,215.680	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	58,805	35.805	2,105,513.020	
	HANNOVER RUECK SE	2,720	205.200	558,144.000	
	DEUTSCHE POST AG-REG	45,384	42.880	1,946,065.920	
	DEUTSCHE BOERSE AG	8,556	165.600	1,416,873.600	
	MTU AERO ENGINES AG	2,417	219.700	531,014.900	
	WACKER CHEMIE AG	899	127.650	114,757.350	
	SYMRISE AG	5,990	101.050	605,289.500	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.635	108,857.120	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,686	99.850	268,197.100	
	VONOVIA SE	31,518	17.845	562,438.710	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,105	50.660	157,299.300	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,997	18.156	762,497.530	
	NN GROUP NV	12,086	34.840	421,076.240	
	ARCELORMITTAL	25,700	24.930	640,701.000	
	HEINEKEN NV	11,672	94.320	1,100,903.040	
	AEGON NV	77,429	4.350	336,816.150	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,015	29.355	1,350,770.320	
	AKZO NOBEL N. V.	7,841	73.040	572,706.640	
	WOLTERS KLUWER	11,595	112.100	1,299,799.500	
	ING GROEP NV	163,846	11.970	1,961,236.620	
	KONINKLIJKE KPN NV	143,197	3.172	454,220.880	
	ASML HOLDING NV	18,154	674.600	12,246,688.400	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	17,828	14.040	250,305.120	
	IMCD NV	2,514	144.650	363,650.100	
	ADYEN NV	977	1,582.000	1,545,614.000	
	JUST EAT TAKEAWAY	9,530	13.900	132,467.000	
	PROSUS NV	36,049	66.220	2,387,164.780	
	JDE PEET' S NV	5,785	27.500	159,087.500	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,115	397.750	841,241.250	
	RANDSTAD NV	5,275	48.360	255,099.000	
	HEINEKEN HOLDING NV	5,248	79.800	418,790.400	
	OCI NV	4,386	21.000	92,106.000	
	TOTALENERGIES SE	109,487	55.180	6,041,492.660	
	MICHELIN (CGDE)	30,548	27.430	837,931.640	
	AIR LIQUIDE SA	23,578	159.380	3,757,861.640	
	KERING	3,350	506.700	1,697,445.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,430	165.620	4,046,096.600	
	BOUYGUES SA	9,572	30.430	291,275.960	
	BNP PARIBAS	50,023	56.480	2,825,299.040	
	THALES SA	4,734	133.000	629,622.000	
	DANONE	28,911	56.060	1,620,750.660	
	CARREFOUR SA	26,778	17.315	463,661.070	
	VIVENDI	31,166	8.376	261,046.410	
	L' OREAL	10,842	407.800	4,421,367.600	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,086	54.670	1,207,441.620	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	LEGRAND SA	12,015	88.720	1,065,970.800	
	PERNOD RICARD SA	9,292	204.300	1,898,355.600	
	EURAZEO SE	1,981	64.800	128,368.800	
	SOCIETE GENERALE SA	35,528	22.610	803,288.080	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	12,431	830.900	10,328,917.900	
	ACCOR SA	8,355	31.690	264,769.950	
	CAPGEMINI SE	7,430	167.700	1,246,011.000	
	VALEO SA	9,148	18.990	173,720.520	
	PUBLICIS GROUPE	10,308	70.800	729,806.400	
	BUREAU VERITAS SA	12,970	24.520	318,024.400	
	EIFFAGE	3,675	100.250	368,418.750	
	SODEXO SA	3,903	101.650	396,739.950	
	IPSEN	1,706	110.600	188,683.600	
	AMUNDI SA	2,569	54.050	138,854.450	
	TELEPERFORMANCE	2,667	141.800	378,180.600	
	EURONEXT NV	3,876	63.300	245,350.800	
	EUROFINS SCIENTIFIC	5,946	61.600	366,273.600	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,194	265.000	316,410.000	
	SEB SA	997	88.350	88,084.950	
	ESSILORLUXOTTICA	13,103	171.320	2,244,805.960	
	DASSAULT AVIATION SA	1,108	164.500	182,266.000	
	WORLDLINE SA	10,790	36.570	394,590.300	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,561	36.660	167,206.260	
	AXA SA	82,807	27.255	2,256,904.780	
	EDENRED	11,258	60.720	683,585.760	
	RENAULT SA	8,329	33.095	275,648.250	
	HERMES INTERNATIONAL	1,426	1,957.200	2,790,967.200	
	STMICROELECTRONICS NV	30,776	42.010	1,292,899.760	
	REMY COINTREAU	1,009	140.050	141,310.450	
	DASSAULT SYSTEMES SE	30,068	41.675	1,253,083.900	
	WENDEL	1,124	102.200	114,872.800	
	ORANGE	87,788	11.030	968,301.640	
	ALSTOM	14,107	26.950	380,183.650	
	SANOFI	51,072	94.980	4,850,818.560	
	VINCI SA	23,903	107.580	2,571,484.740	
	AIRBUS SE	26,700	128.380	3,427,746.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,624	27.960	856,247.040	
	CREDIT AGRICOLE SA	54,582	10.954	597,891.220	
	BIOMERIEUX	1,852	94.720	175,421.440	
	ENGIE	82,244	14.104	1,159,969.370	
	SAFRAN SA	15,391	139.040	2,139,964.640	
	ARKEMA	2,576	85.680	220,711.680	
	ADP	1,343	142.900	191,914.700	
	GETLINK SE	19,411	16.155	313,584.700	
	BOLLORE	39,141	5.935	232,301.830	
	UCB SA	5,577	82.500	460,102.500	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	KBC GROUP NV	11,272	62.760	707,430.720	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	73.500	322,150.500	
	SOLVAY SA	3,212	102.750	330,033.000	
	UMICORE	9,239	27.330	252,501.870	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,112	50.910	1,991,191.920	
	AGEAS	7,114	38.640	274,884.960	
	D' IETEREN GROUP	1,036	166.500	172,494.000	
	ELIA GROUP SA/NV	1,462	115.500	168,861.000	
	SOFINA	670	202.000	135,340.000	
	ARGENX SE	2,509	369.100	926,071.900	
	PRYSMIAN SPA	11,238	36.500	410,187.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	48,878	18.140	886,646.920	
	MEDIOBANCA SPA	26,230	10.705	280,792.150	
	TENARIS SA	20,832	12.345	257,171.040	
	UNICREDIT SPA	84,516	18.858	1,593,802.720	
	TELECOM ITALIA SPA	434,374	0.252	109,592.560	
	INTESA SANPAOLO	721,438	2.271	1,638,746.410	
	POSTE ITALIANE SPA	22,639	10.000	226,390.000	
	MONCLER SPA	9,291	64.360	597,968.760	
	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,624	42.840	198,092.160	
	ENI SPA	110,008	13.142	1,445,725.130	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,654	12.445	281,929.030	
	DIASORIN SPA	1,144	98.840	113,072.960	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,648	11.815	173,066.120	
	NEXI SPA	25,005	7.436	185,937.180	
	AMPLIFON SPA	5,632	33.450	188,390.400	
	ENEL SPA	366,238	6.046	2,214,274.940	
	SNAM SPA	88,957	4.979	442,916.900	
	TERNA SPA	63,467	7.918	502,531.700	
	CNH INDUSTRIAL NV	46,159	12.565	579,987.830	
	FINECOBANK SPA	26,908	12.675	341,058.900	
	STELLANTIS NV	101,275	14.786	1,497,452.150	
	FERRARI NV	5,676	279.100	1,584,171.600	
	TELEFONICA SA	234,049	3.891	910,684.650	
	ENDESA SA	14,367	20.970	301,275.990	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	271,306	6.490	1,760,775.940	
	IBERDROLA SA	270,354	11.580	3,130,699.320	
	REPSOL SA	60,600	13.370	810,222.000	
	GRIFOLS SA	12,949	11.550	149,560.950	
	BANCO SANTANDER SA	738,996	3.210	2,372,177.160	
	AMADEUS IT GROUP SA	20,286	68.440	1,388,373.840	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.860	276,658.000	
	CAIXABANK SA	195,084	3.631	708,350.000	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,544	31.320	298,918.080	
	AENA SME SA	3,383	146.850	496,793.550	
	CELLNEX TELECOM SA	25,443	38.200	971,922.600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ACCIONA SA	1,117	156.850	175,201.450	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	49,119	32.150	1,579,175.850	
	ENAGAS SA	10,803	18.195	196,560.580	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,900	16.020	286,758.000	
	FERROVIAL SA	23,057	29.290	675,339.530	
	UPM-KYMMENE OYJ	24,034	28.640	688,333.760	
	NOKIA OYJ	238,120	3.835	913,190.200	
	WARTSILA OYJ ABP	20,930	10.890	227,927.700	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	26,320	12.405	326,499.600	
	ELISA OYJ	6,414	52.360	335,837.040	
	SAMPO OYJ-A SHS	21,110	43.580	919,973.800	
	FORTUM OYJ	19,800	12.205	241,659.000	
	KESKO OYJ-B SHS	12,355	17.925	221,463.370	
	KONE OYJ-B	15,332	51.280	786,224.960	
	NESTE OYJ	19,050	37.370	711,898.500	
	ORION OYJ-CLASS B	4,846	40.320	195,390.720	
	METSO CORPORATION	31,351	10.625	333,104.370	
	VERBUND AG	2,951	68.050	200,815.550	
	OMV AG	6,496	43.880	285,044.480	
	ERSTE GROUP BANK AG	15,510	31.480	488,254.800	
	VOESTALPINE AG	4,878	30.300	147,803.400	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,784	34.660	408,433.440	
	AIB GROUP PLC	61,254	3.900	238,890.600	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	47,750	9.150	436,912.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,975	63.940	445,981.500	
	JERONIMO MARTINS	12,272	24.080	295,509.760	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	132,745	4.642	616,202.290	
	GALP ENERGIA SGPS SA	21,724	10.515	228,427.860	
	EDP RENOVAVEIS SA	12,491	19.235	240,264.380	
	KERRY GROUP PLC-A	7,189	92.460	664,694.940	
	CRH PLC	33,337	45.460	1,515,500.020	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,983	185.850	1,483,640.550	
ユーロ 小計				213,757,630.140 (32,040,131,181)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	68,000	42.100	2,862,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	108,000	49.800	5,378,400.000	
	MTR CORP	76,500	36.500	2,792,250.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,500	101.800	7,278,700.000	
	SINO LAND CO	182,000	10.300	1,874,600.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	132,169	47.650	6,297,852.850	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	54.000	1,296,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	80,500	56.350	4,536,175.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,507	24.550	1,632,746.850	
	HONG KONG & CHINA GAS	536,475	7.210	3,867,984.750	
	HANG SENG BANK LTD	36,600	106.900	3,912,540.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,500	19.260	1,396,350.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WH GROUP LTD	399,000	4.160	1,659,840.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	59,100	302.400	17,871,840.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	12.960	1,257,120.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	12.360	1,075,320.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	54,000	19.260	1,040,040.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	95,669	43.700	4,180,735.300	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	42.250	1,267,500.000	
	AIA GROUP LTD	565,600	78.000	44,116,800.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	13.360	855,040.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	80,000	39.700	3,176,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	82,400	20.100	1,656,240.000	
	ESR CAYMAN LTD	95,800	12.440	1,191,752.000	
	SANDS CHINA LTD	119,600	26.500	3,169,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	68,000	73.750	5,015,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	177,000	23.750	4,203,750.000	
香港・ドル 小計				134,862,776.750 (2,411,346,448)	
合計				327,359,557,109 [327,359,557,109]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,537	1,184,504.400	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,207	1,619,697.570	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,700	339,288.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,000	1,128,250.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,800	1,059,912.000	
		EQUINIX INC	4,408	3,339,544.880	
		AMERICAN TOWER CORP	21,700	4,147,955.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,343	586,836.800	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,200	530,328.000	
		KIMCO REALTY CORP	28,900	542,164.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	17,300	331,987.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,200	613,050.000	
		INVITATION HOMES INC	28,500	982,965.000	
		VICI PROPERTIES INC	46,900	1,482,509.000	
		VENTAS INC	18,600	842,394.000	
		WEYERHAEUSER CO	34,214	986,389.620	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,200	2,302,800.000	
		IRON MOUNTAIN INC	13,600	751,128.000	
		SUN COMMUNITIES INC	5,800	768,906.000	
		PROLOGIS INC	42,954	5,365,813.680	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,700	888,349.000			
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,000	538,100.000			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,000	685,650.000	
		WELLTOWER INC	23,200	1,757,632.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	25,500	528,360.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,400	813,564.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,200	541,938.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,100	452,991.000	
		REALTY INCOME CORP	30,895	1,844,431.500	
		PUBLIC STORAGE	7,400	2,134,086.000	
		REGENCY CENTERS CORP	7,200	419,472.000	
		UDR INC	14,500	596,820.000	
		WP CAREY INC	10,000	706,100.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,600	1,432,080.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,300	920,115.000	
	アメリカ・ドル 小計			43,166,111.450 (6,051,025,503)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,834	192,897.500	
		SEGRO PLC	55,182	456,686.230	
		BRITISH LAND CO PLC	38,375	136,346.370	
	イギリス・ポンド 小計			785,930.100 (136,940,461)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	45,529	375,614.250	
		LENDLEASE GROUP	28,107	218,391.390	
		TRANSURBAN GROUP	134,358	1,964,313.960	
		APA GROUP	50,633	512,912.290	
		SCENTRE GROUP	218,948	595,538.560	
		GPT GROUP	81,080	338,914.400	
		MIRVAC GROUP	173,080	405,007.200	
		STOCKLAND	104,777	459,971.030	
		GOODMAN GROUP	73,798	1,467,104.240	
	VICINITY CENTRES	163,150	303,459.000		
	オーストラリア・ドル 小計			6,641,226.320 (614,047,786)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	172,414.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	117,566.000	
	カナダ・ドル 小計			289,980.000 (30,265,213)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	165,600	447,120.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	261,870	523,740.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170,200	284,234.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112,700	185,955.000	
	シンガポール・ドル 小計			1,441,049.000 (149,465,602)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,203	232,574.100		
		GECINA SA	1,995	197,604.750		
		KLEPIERRE	9,340	205,760.200		
		COVIVIO	2,000	94,040.000		
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,389	201,276.360		
	ユーロ 小計				931,255.410 (139,585,873)	
	香港・ドル	LINK REIT	124,500	5,870,175.000		
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	181,000	1,726,740.000		
	香港・ドル 小計				7,596,915.000 (135,832,841)	
	投資証券 合計				7,257,163,279 [7,257,163,279]	
合計				7,257,163,279 [7,257,163,279]		

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 604 銘柄	97.6%	2.4%	74.4%
	投資証券 35 銘柄			
イギリス・ポンド	株式 79 銘柄	99.1%	0.9%	4.3%
	投資証券 3 銘柄			
イスラエル・シケル	株式 9 銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49 銘柄	91%	9.0%	2.0%
	投資証券 10 銘柄			
カナダ・ドル	株式 85 銘柄	99.7%	0.3%	3.3%
	投資証券 2 銘柄			
シンガポール・ドル	株式 16 銘柄	88.4%	11.6%	0.4%
	投資証券 4 銘柄			
スイス・フラン	株式 44 銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式 46 銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 16 銘柄	100%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式 6 銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12 銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.6%	0.4%	9.6%
	投資証券 5 銘柄			
香港・ドル	株式 27 銘柄	94.7%	5.3%	0.8%
	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

	2022年6月6日現在 金額(円)	2023年6月5日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	5,696,408,831	8,083,687,965
コール・ローン	1,304,305,964	1,316,481,366
国債証券	234,504,938,294	251,403,629,306
派生商品評価勘定	21,748,461	7,667,397
未収入金	15,749,407	11,204,843
未収利息	1,315,513,379	1,601,633,414
前払費用	43,054,119	71,242,440
流動資産合計	242,901,718,455	262,495,546,731
資産合計	242,901,718,455	262,495,546,731
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	712,889
未払金	4,935,132,601	5,474,668,258
未払解約金	145,405,730	248,983,806
流動負債合計	5,080,538,331	5,724,364,953
負債合計	5,080,538,331	5,724,364,953
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	75,518,465,344	79,326,984,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	162,302,714,780	177,444,197,721
元本等合計	237,821,180,124	256,771,181,778
純資産合計	237,821,180,124	256,771,181,778
負債純資産合計	242,901,718,455	262,495,546,731

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 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。 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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。 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	2022 年 6 月 6 日現在	2023 年 6 月 5 日現在
1. ※1 期首	2021 年 6 月 8 日	2022 年 6 月 7 日
期首元本額	72,171,959,824 円	75,518,465,344 円
期中追加設定元本額	9,393,523,151 円	9,967,747,761 円
期中一部解約元本額	6,047,017,631 円	6,159,229,048 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	468,789,568 円	420,348,520 円

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	9,719,452円	7,898,412円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	60,069,032円	47,909,085円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	21,864,771円	18,253,368円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	273,677,757円	216,841,012円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	262,828,185円	457,193,545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)	582,097,301円	730,996,597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)	2,435,159,714円	3,033,257,830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)	637,283,512円	855,201,324円
D-I's 外国債券インデックス	946,025円	1,615,120円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	11,046,385円	17,415,830円
iFree 外国債券インデックス	1,957,942,756円	2,204,039,693円
iFree 8資産バランス	1,635,638,497円	2,093,016,152円
iFree 年金バランス	281,749,418円	408,215,928円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	15,487円
DCダイワ外国債券インデックス	49,873,381,777円	50,799,853,169円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,015,192,007円	1,133,031,789円
ダイワ・ライフ・バランス50	638,155,597円	746,371,730円
ダイワ・ライフ・バランス70	416,524,630円	532,513,009円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	613,659,406円	676,398,361円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	475,082,867円	527,279,690円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	179,008,193円	206,860,176円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	31,677,555円	34,610,415円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,390,426円	17,092,551円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,091,284,840円	1,613,655,804円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,766,018円	4,454,951円

区分	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	1,373,889 円	1,621,436 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	2,265,840 円	3,253,618 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)	8,553,439 円	462,884,174 円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	126,818,187 円	112,079,398 円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	101,559,044 円	29,164,889 円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,578,350,089 円	3,126,411,245 円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	218,536,659 円	196,547,666 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	147,279,804 円	156,992,713 円
ダイワ・ノーロード 外国債券フ ァンド	46,689,867 円	58,631,967 円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワS MA専用)	2,584,864,644 円	2,520,728,659 円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,608,313,372 円	5,747,816,771 円
ダイワライフスタイル25	29,864,070 円	28,914,057 円
ダイワライフスタイル50	59,547,724 円	61,248,945 円
ダイワライフスタイル75	15,513,027 円	16,348,971 円
計	75,518,465,344 円	79,326,984,057 円
2. 期末日における受益権の総数	75,518,465,344 口	79,326,984,057 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月7日 至2023年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

区分	自 2022 年 6 月 7 日 至 2023 年 6 月 5 日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 6 月 5 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022 年 6 月 6 日現在	2023 年 6 月 5 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	△30,035,105,080	△2,884,416,101
合計	△30,035,105,080	△2,884,416,101

(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	2022 年 6 月 6 日現在				2023 年 6 月 5 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引 為替予約取引								

種類	2022年6月6日現在				2023年6月5日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
売建	-	-	-	-	51,467,935	-	52,180,720	△712,785
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	51,467,935	-	52,180,720	△712,785
買建	1,117,565,949	-	1,139,314,410	21,748,461	1,064,544,748	-	1,072,212,041	7,667,293
アメリカ・ドル	584,094,960	-	595,870,248	11,775,288	87,960,550	-	88,587,707	627,157
イギリス・ポンド	-	-	-	-	9,014,278	-	9,022,317	8,039
オフショア・人民元	171,335,360	-	175,005,048	3,669,688	723,623,800	-	727,275,700	3,651,900
シンガポール・ドル	-	-	-	-	27,108,708	-	27,276,004	167,296
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	195,982,580	-	199,129,385	3,146,805
ユーロ	362,135,629	-	368,439,114	6,303,485	20,854,832	-	20,920,928	66,096
合計	1,117,565,949	-	1,139,314,410	21,748,461	1,116,012,683	-	1,124,392,761	6,954,508

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
に評価しております。
- ① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2022年6月6日現在	2023年6月5日現在
1口当たり純資産額	3.1492円	3.2369円
(1万口当たり純資産額)	(31,492円)	(32,369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	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	893,834.100	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	772,306.610	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	786,169.260	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	820,428.840	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,651,762.460	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,278,911.760	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	965,529.180	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	586,129.840	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	561,957.630	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,010,575.130	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,178,753.920	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,146,496.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,287,790.900	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,106,576.200	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,782,673.640	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,087,246.960	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,533,944.490	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,390,297.260	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,441,958.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,471,535.510	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,281,829.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,430,950.410	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,166,475.420	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,320,858.310			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,343,462.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,296,095.620	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,927,171.740	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,031,059.120	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,997,510.280	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,108,679.210	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,005,212.560	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,970,361.800	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,671,131.280	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,705,416.390	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,325,285.340	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,493,064.640	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,982,019.160	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,530,202.480	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,549,785.950	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,455,275.700	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,545,955.470	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,562,483.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	555,464.510	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,547,666.280	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,419,647.240	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,191,370.760	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,167,301.790	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,980,960.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,026,230.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,950,836.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	822,770.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,420,508.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,970,972.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,026,816.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,681,640.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	3,300,000.000	3,196,875.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,320,224.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,514,730.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,899,740.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,163,335.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,924,140.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,409,800.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,124,955.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,005,550.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,374,280.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,076,352.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,692,844.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,035,802.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,508,012.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,614,464.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,521,050.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,800,124.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,267,088.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,205,160.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,841,366.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,439,879.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,898,630.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,381,951.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,706,410.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,420,825.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,475,872.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,425,925.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,424,850.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,565,061.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,719,177.800	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,900,550.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,440,960.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,182,814.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,400,525.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,956,601.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,391,725.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,374,350.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,824,439.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,596,112.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,665,628.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,832,120.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,374,770.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,622,200.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,294,905.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,336,600.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,143,849.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,319,360.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,571,072.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,819,440.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,311,700.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,868,330.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	954,190.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,769,360.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,528,463.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,335,625.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,843,740.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,857,440.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,312,400.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,385,975.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,610,104.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,333,350.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,944,055.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,669,030.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	270,303.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,895,072.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,322,500.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,410,496.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,500,792.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,496,366.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,099,616.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,112,144.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,245,850.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,053,470.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,759,700.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,970,315.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,046,750.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,112,768.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,438,880.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,317,950.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,847,743.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,218,050.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,032,190.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,647,560.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,436,640.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,195,185.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,014,538.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,633,400.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,447,320.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,175,608.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,415,266.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,636,206.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,325,050.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,315,400.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	907,810.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,065,920.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,864,028.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,895,338.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,523,200.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,402,500.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,420,049.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,716,260.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,536,680.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,643,800.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,464,252.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,085,235.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,296,620.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,718,848.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,932,574.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,525,280.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,985,344.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,901,260.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,398,400.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,542,350.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,221,095.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,837,790.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,523,250.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,655,016.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,604,504.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,387,340.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,332,400.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,352,100.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,497,350.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,074,450.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,372,850.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,157,420.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,887,100.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,243,095.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,316,700.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,307,226.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,933,040.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,275,980.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,352,080.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,638,280.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,950,064.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,076,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,506,400.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,633,480.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	943,940.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,989,032.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,508,118.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,842,351.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,790,021.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,949,450.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,494,000.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,629,750.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,753,900.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,769,720.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,734,050.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,895,030.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,703,777.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,900,430.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,109,950.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,342,500.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,845,650.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,864,700.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,381,380.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,650,260.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,899,640.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,937,760.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,871,400.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,917,710.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,913,270.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,879,931.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	976,920.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,433,675.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,788,545.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,386,044.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,820,620.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,876,069.800	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,138,878.400	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,805,587.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,418,750.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,363,465.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,257,358.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,466,890.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,505,550.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,509,450.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,392,622.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	992,480.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,020,490.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,911,988.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,506,405.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,775,702.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,028,590.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,983,740.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,506,975.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,994,000.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,491,200.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,478,300.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,486,050.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	5,015,500.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,496,880.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,974,140.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	990,030.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,908,550.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,480,505.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,861,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,500,000.000	1,465,770.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	4,290,075.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,636,249.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,495,140.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	1,011,260.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,015,030.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,529,000.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,960,250.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,782,000.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,657,487.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,977,560.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,947,500.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,966,560.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	985,780.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,300,000.000	3,213,375.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,300,000.000	1,240,473.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	1,500,000.000	1,466,475.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,949,600.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,583,116.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,663,555.000	
		アメリカ・ドル 小計		895,695,411.650 (125,558,582,805)	
	イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	873,393.510	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	836,222.960	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,347,507.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	992,516.800	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,052,555.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	979,210.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,254,293.700	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,323,375.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	491,202.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	713,053.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	450,372.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,236,045.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,766,259.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	719,676.300	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	998,010.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	507,450.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,346,310.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,329,504.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	442,442.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,119,042.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,842,975.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	984,520.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,062,080.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	885,474.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,022,285.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,327,704.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	571,515.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,679,230.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	670,670.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,793,024.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	303,178.600	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,973,800.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	931,000.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	100,000.000	92,926.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	388,816.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	600,000.000	528,540.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	300,000.000	279,450.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,034,647.250	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,274,585.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,481,553.280	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,360,488.180	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,414,808.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,659,595.280	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,319,610.640	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,233,971.200	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,134,811.240	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,673,888.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,296,062.150	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,420,203.360	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,602,447.600	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,097,020.820	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,545,491.540	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,375,553.120	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,560,442.500	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,165,861.620	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,066,425.360	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,318,214.280	
		イギリス・ポンド 小計		68,151,308.990 (11,874,684,079)	
	イスラエル・シ ュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,932,030.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,906,448.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,179,595.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,681,200.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,270,232.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,110,564.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,004,768.000	
		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,490,608.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,259,564.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	181,628.000	
		0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	851,922.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	244,932.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	460,026.000	
		イスラエル・シュケル 小計		17,573,517.000 (657,658,999)	
	オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,084,372.550	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,338,212.360	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,785,162.280	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,417,369.640	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,786,997.880	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,100,267.280	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,180,809.150	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	724,695.840	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,626,103.600	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,115,377.520	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,042,840.880	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,449,060.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,817,806.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,688,070.700	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,161,789.800	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,427,490.000	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,211,624.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,281,032.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,662,720.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	851,802.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,478,848.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,027,075.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,091,688.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,359,568.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,225,458.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,207,392.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,077,923.000	
		オーストラリア・ドル 小計		42,221,555.480 (3,903,805,020)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,329,792.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,207,450.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,210,750.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,146,350.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,298,920.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,245,520.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,208,130.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,501,035.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,332,280.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,334,440.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,070,625.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,147,420.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,175,051.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,180,530.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,547,140.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,151,392.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,544,145.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,057,450.000	
		3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,191,400.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,795,735.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,353,550.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,336,200.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,561,510.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,748,310.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,257,935.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,092,477.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,362,670.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,506,880.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,605,105.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,311,210.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,064,380.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,973,650.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,199,424.000	
		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	10,013,500.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,159,750.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,679,795.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,004,150.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,027,160.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,979,440.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,955,250.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,597,440.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	22,000,000.000	21,965,680.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,482,995.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,193,120.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,025,760.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,522,385.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,005,760.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,141,170.000	
		2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	5,010,950.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,151,000.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,088,740.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,216,150.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	23,076,590.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,131,550.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,191,750.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	7,000,000.000	7,139,020.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,008,540.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	15,000,000.000	14,973,000.000	
		オフショア・人民元 小計		671,789,501.000 (13,233,043,948)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	547,041.000	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,111,782.830	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,353,770.490	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,209,846.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,006,902.050	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,004,417.980	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,374,637.950	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,236,484.340	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,113,690.400	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	907,032.450	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,126,391.200	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	609,940.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,897,250.300	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,151,924.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,347,892.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,018,784.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	664,440.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,667,614.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,635,640.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,902,222.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	275,406.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,982,718.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	951,440.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,924,218.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,018,544.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,828,995.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	190,162.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,355,640.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	94,033.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	387,256.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	195,654.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	975,890.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	724,215.800	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	352,368.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	200,052.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	296,727.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	585,642.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	575,784.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	297,039.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	365,352.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,188,828.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	493,040.000	
	カナダ・ドル 小計			46,146,708.290 (4,816,331,944)	
	シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	784,352.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	916,446.700	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	808,191.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	410,384.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	592,992.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	624,062.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	514,494.640	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	719,304.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	436,275.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	706,500.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	543,372.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	335,244.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	482,220.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	703,125.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	545,400.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	181,792.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,940.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	235,099.200	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	262,350.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,750.000	
	シンガポール・ドル 小計			10,089,294.540 (1,046,461,629)	
	スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,129,199.700	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,521,556.350	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,794,936.600	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,657,362.500	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,284,226.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,797,184.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,201,500.000	
		1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,898,700.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			38,284,665.150 (495,786,414)	
	デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,951,672.980	
		1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,863,757.340	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,669,509.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,580,417.300	
		0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,839,775.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	405,770.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	957,510.000	
	デンマーク・クローネ 小計			38,268,411.620 (770,343,126)	
	ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	603,564.000	
		3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	900,000.000	840,663.000	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	403,720.800	
		3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	560,820.000	
		1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	431,918.200	
		1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	230,688.500	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	329,188.000	
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	446,250.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	365,543.200	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	278,038.400	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	616,563.200	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	198,136.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	507,190.000	
	ニュージーランド・ドル 小計			5,812,283.300	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				(493,230,361)	
	ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,237,304.150	
		1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,132,678.200	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,211,257.500	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,296,405.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,513,356.000	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,205,136.000	
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,973,845.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,538,687.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,454,625.000	
	ノルウェー・クローネ 小計			30,563,293.850 (388,765,097)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,969,807.690	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,794,196.500	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,067,826.400	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,233,060.000	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,821,100.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,190,060.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,832,534.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	935,890.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,290,060.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	462,115.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	1,000,000.000	1,072,460.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,313,670.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,006,600.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	824,560.350	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,191,049.000	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,354,655.320	
	ポーランド・ズロチ 小計			35,359,644.260 (1,180,202,381)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,370,484.620	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,242,460.160	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,554,696.320	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,345,422.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	739,910.890	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,431,423.700	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,899,164.280	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,442,038.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,066,777.250	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,756,923.390	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,258,466.600	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,006,845.900	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,570,506.500	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,748.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,207,742.900	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,108,691.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,211,916.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,293,180.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,209,580.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	659,600.500	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,340,792.300	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,343,484.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	401,064.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,293,578.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,688,505.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,595,410.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,664,712.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,388,352.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	433,860.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	523,325.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	737,142.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,002,140.000	
	マレーシア・リンギット 小計			44,351,942.810 (1,358,029,878)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,863,049.000	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,127,826.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,057,202.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,179,880.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	916,640.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	12,480,160.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,133,300.000	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,691,051.930	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,418,852.480	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,695,111.220	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,081,931.840	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,074,567.220	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	30,532,235.300	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,004,416.560	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,336,522.320	
	メキシコ・ペソ 小計			268,592,745.870 (2,145,223,402)	
	ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	311,587.640	
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	267,348.960	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	762,275.120	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	260,391.600	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	730,008.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	389,912.000	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	445,975.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	435,870.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	192,612.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	213,084.700	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	247,704.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	409,195.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	183,060.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	481,914.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	183,198.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	276,021.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	266,886.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	257,061.600	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	380,372.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	302,088.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,323,530.810	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,055,129.560	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	570,775.520	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	142,682.400	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,177,241.600	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	390,695.400	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,095,780.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,127,705.600	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	773,720.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	812,939.400	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	396,984.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	232,960.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	144,973.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	965,328.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	454,920.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	414,012.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	133,224.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	259,176.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,271,595.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	231,645.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	293,469.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	298,365.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,006,570.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,630,751.170	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,543,610.620	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	888,741.160	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,389,718.330	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	880,055.360	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	540,903.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,021,251.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,014,961.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	449,517.400	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	482,292.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,361,860.000	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	560,690.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,352,460.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	490,917.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,015,833.000	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	535,436.000	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,069,080.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,263,136.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	212,079.500	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	319,508.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	500,768.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	373,252.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	500,000.000	500,710.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	578,034.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	705,488.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,351,981.170	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,470,755.220	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,061,473.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,423,727.300	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,728,526.960	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,839,760.000	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,849,280.090	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,626,305.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,272,473.030	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,190,449.100	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,813,054.400	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,701,074.960	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,949,034.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,111,220.380	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,057,090.640	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,944,636.880	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,238,088.600	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,885,882.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,059,562.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,167,054.100	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,749,577.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,695,986.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,199,591.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,613,060.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,497,162.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,509,130.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,581,069.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,805,980.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,535,994.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,025,436.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	759,105.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,023,512.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,769,860.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	580,360.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,005,352.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	584,913.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,134,468.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,302,752.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,573,964.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,027,404.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	197,782.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	100,000.000	99,928.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,700,085.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,048,131.000	
		0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	97,183.000	
		0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	513,130.100	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,484,400.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,491,240.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	999,960.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,633,377.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,281,080.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,161,356.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,146.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,047,188.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,197,898.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	91,240.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,870,580.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	412,559.200	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	99,406.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,243,072.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,825,736.670	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,005,158.780	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,121,825.540	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,994,096.160	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,621,655.680	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,716,054.720	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,391,444.780	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,720,487.780	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,919,174.580	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,078,272.800	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,035,010.860	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,810,573.050	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,333,463.200	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,884,972.650	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,689,254.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,108,820.330	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,371,470.300	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	927,001.450	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,723,651.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,127,420.300	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,186,480.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,998,129.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,925,772.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,330,995.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,474,998.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,952,763.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,838,048.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,110,685.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,544,380.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,481,479.100	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,784,660.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,428,042.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,278,560.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	562,355.600	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	881,160.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,660,312.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,808,290.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,355,172.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,818,152.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,996,491.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,200,000.000	928,836.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	2,300,000.000	2,106,547.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,484,928.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	886,010.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	1,022,560.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	200,000.000	198,352.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	700,000.000	708,862.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	600,000.000	601,662.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,280,657.430	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,993,802.850	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,968,086.120	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,452,747.480	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,934,516.940	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,497,421.700	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,699,408.260	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,815,188.940	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,045,010.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,234,993.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,045,800.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	629,109.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,170,820.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	728,696.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	593,812.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,059,318.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	601,173.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	781,128.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,209.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	498,984.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	254,484.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	890,541.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,293,266.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,249,127.400	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,698,821.840	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,792,848.760	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,272,796.230	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,401,546.680	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,739,948.350	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,802,101.750	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,230,362.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1. 6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,269,897.240	
		2. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,875,468.000	
		1. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	995,974.080	
		2. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	672,595.440	
		2. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,310,205.000	
		2. 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,445,945.800	
		3. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,427,151.000	
		2. 05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,563,299.000	
		1. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,558,928.000	
		2. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,113,606.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,974,084.000	
		1. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,255,787.000	
		2. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,464,830.000	
		2. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,522,317.000	
		3. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,179,398.200	
		3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,511,994.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,842,487.000	
		1. 75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,162,028.000	
		2. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,024,757.000	
		3. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,072,475.000	
		1. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,639,453.000	
		0. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,238,744.000	
		0. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,153,775.000	
		2. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,086,689.500	
		1. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,104,210.000	
		1. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,458,165.000	
		0. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,660,240.000	
		1. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,819,356.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,990,186.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,578,416.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,043,745.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,539,893.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	703,428.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	469,133.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,637,249.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,404,810.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,340,614.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,002,111.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	261,933.200	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	690,680.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,512,438.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	961,400.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,794,030.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,331,780.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	758,277.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	285,372.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	513,608.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	275,928.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	477,885.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	766,544.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,426,640.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	267,075.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	193,770.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	494,260.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	301,230.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,906,148.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	303,456.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,497,930.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	100,508.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	502,305.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	400,200.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	505,690.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	914,805.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,199,472.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	600,000.000	616,818.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,570,549.120	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,296,805.820	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,065,515.650	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,485,493.820	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,685,665.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,208,501.120	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,177,558.160	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,429,169.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,132,638.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,557,154.600	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,901,764.480	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,211,718.870	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,304,926.480	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,924,828.620	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,256,163.840	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,798,966.200	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,047,266.220	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	847,056.600	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	679,933.920	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,495,789.400	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	744,325.740	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,076,085.630	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	945,614.390	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	753,132.450	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,021,259.940	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	464,623.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	736,712.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	653,257.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	682,275.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	869,012.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	412,320.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	262,206.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	454,600.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	669,656.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	640,296.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	257,580.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	80,541.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	194,454.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	932,934.750	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,522,519.700	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	922,363.750	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	388,405.940	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	720,570.720	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	728,479.350	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	915,494.280	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	682,567.780	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	390,322.600	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	379,181.550	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,062,450.040	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,992,116.300	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,906,554.240	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,152,565.920	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,655,710.760	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,678,817.600	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,385,111.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,491,819.800	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,800,592.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,607,077.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,923,863.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,232,648.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,794,672.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,684,965.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,469,600.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,895,400.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,224,652.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,413,628.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,160,486.400	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,380,050.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	736,498.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,200,200.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,112,168.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	882,726.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	462,590.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,741,190.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	290,607.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	308,178.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,182,725.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,322,210.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,532,274.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	376,098.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	808,398.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,699,614.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	389,796.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	94,168.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	87,644.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,604,953.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	945,330.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,480,260.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	300,000.000	297,918.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	816,752.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,620,051.390	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,875,797.760	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,139,078.240	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,221,045.560	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,882,794.070	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,133,990.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,957,584.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,551,460.650	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,092,030.110	
		ユーロ 小計		556,951,632.680 (83,481,480,223)	
国債証券	合計			251,403,629,306	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				[251, 403, 629, 306]	
合計				251, 403, 629, 306 [251, 403, 629, 306]	

- (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 272 銘柄	100%	49.8%
イギリス・ポンド	国債証券 57 銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シケル	国債証券 13 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27 銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 58 銘柄	100%	5.3%
カナダ・ドル	国債証券 42 銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 20 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%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 13 銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9 銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16 銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券 32 銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15 銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券 371 銘柄	100%	33.2%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月6日から2023年12月5日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年2月2日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e 年金バランスの2023年6月6日から2023年12月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、i F r e e 年金バランスの2023年12月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月6日から2023年12月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚

偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

i F r e e 年金バランス

(1) 【中間貸借対照表】

	当中間計算期間末 2023年12月5日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	82,901,743
親投資信託受益証券	6,794,782,475
未収入金	3,919,000
流動資産合計	6,881,603,218
資産合計	6,881,603,218
負債の部	
流動負債	
未払解約金	12,659,504
未払受託者報酬	680,495
未払委託者報酬	4,729,749
その他未払費用	255,112
流動負債合計	18,324,860
負債合計	18,324,860
純資産の部	
元本等	
元本	※1 4,862,796,775
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,000,481,583
(分配準備積立金)	517,835,882
元本等合計	6,863,278,358
純資産合計	6,863,278,358
負債純資産合計	6,881,603,218

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 日 金 額 (円)
営業収益	
有価証券売買等損益	326,383,385
営業収益合計	326,383,385
営業費用	
支払利息	13,880
受託者報酬	680,495
委託者報酬	4,729,749
その他費用	255,112
営業費用合計	5,679,236
営業利益又は営業損失 (△)	320,704,149
経常利益又は経常損失 (△)	320,704,149
中間純利益又は中間純損失 (△)	320,704,149
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	16,840,593
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	1,365,807,192
剰余金増加額又は欠損金減少額	487,677,967
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	487,677,967
剰余金減少額又は欠損金増加額	156,867,132
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	156,867,132
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	2,000,481,583

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首元本額	4,033,442,966 円
期中追加設定元本額	1,286,088,347 円
期中一部解約元本額	456,734,538 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,862,796,775 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023 年 12 月 5 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023 年 12 月 5 日現在
該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,4114円 (14,114円)

(参考)

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

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

「ネオ・ジャパン債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,590,669,536
国債証券	55,040,658,376
地方債証券	225,439,205
特殊債券	2,393,955,930
社債券	80,175,995,600
未収利息	432,239,127
前払費用	10,211,548
流動資産合計	142,869,169,322
資産合計	142,869,169,322
負債の部	
流動負債	
未払金	1,000,000,000
未払解約金	9,674,930
流動負債合計	1,009,674,930
負債合計	1,009,674,930
純資産の部	
元本等	
元本	※1 134,130,126,759
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,729,367,633
元本等合計	141,859,494,392
純資産合計	141,859,494,392
負債純資産合計	142,869,169,322

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</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。 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)先物オプション取引</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。 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>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	96,413,557,321 円
期中追加設定元本額	38,262,182,207 円
期中一部解約元本額	545,612,769 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ネオ・ジャパン債券ファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	132,513,770,834 円
i F r e e 年金バランス	1,616,355,925 円
計	134,130,126,759 円
2. 期末日における受益権の総数	134,130,126,759 円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年12月5日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2023年12月5日現在
1口当たり純資産額	1.0576円
(1万口当たり純資産額)	(10,576円)

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,351,531,255
株式 ※2※3	274,720,226,710
未収入金	97,639,700
未収配当金	754,104,833
未収利息	660,476
その他未収収益 ※4	6,549,586
差入委託証拠金	7,921,151
流動資産合計	287,938,633,711
資産合計	287,938,633,711
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,611,050
前受金	96,780,000
未払金	17,328,200
未払解約金	854,504,890
受入担保金	7,238,344,311
流動負債合計	8,216,568,451
負債合計	8,216,568,451
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	166,422,515,072
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	113,299,550,188
元本等合計	279,722,065,260
純資産合計	279,722,065,260
負債純資産合計	287,938,633,711

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	154,707,449,700 円
期中追加設定元本額	19,345,720,651 円
期中一部解約元本額	7,630,655,279 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	2,801,751,934 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,349,200,893 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	911,273 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,019,052 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	192,250,160 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	13,126,071 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	409,017,693 円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	334,558,120 円

区分	2023年12月5日現在
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	679,461,245円
D-I's TOPIXインデックス	13,683,461円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	250,892,420円
iFree TOPIXインデックス	7,280,005,929円
iFree 8資産バランス	4,607,390,202円
iFree 年金バランス	999,592,602円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	638,850円
DCダイワ日本株式インデックス	70,750,314,109円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,130,739,193円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,933,334,764円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,659,272,182円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,354,925,170円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	55,176,028円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	76,206,904円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,787,553,654円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,445,814円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,685,906円
ダイワつみたてインデックスバランス70	29,768,814円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	11,448,730,933円
ダイワ世界バランスファンド40VA	54,371,807円
ダイワ世界バランスファンド60VA	20,876,356円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,779,620,810円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	350,930,093円
ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	73,719,521円
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	237,244,091円
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	12,128,882,646円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	5,876,095,328円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,348,064,514円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,167,658,269円
ダイワライフスタイル25	107,308,072円
ダイワライフスタイル50	483,465,716円
ダイワライフスタイル75	404,428,524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)	8,140,449,510円
計	166,422,515,072円
2. 期末日における受益権の総数	166,422,515,072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 6,829,317,670円

区分	2023年12月5日現在
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 1,183,810,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2023年12月5日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	4,945,840,000	-	4,936,345,000	△9,495,000
合計	4,945,840,000	-	4,936,345,000	△9,495,000

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年12月5日現在
1口当たり純資産額	1.6808円
(1万口当たり純資産額)	(16,808円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況
 以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,414,507,781
コール・ローン	9,729,761,967
株式	390,232,325,529
投資証券	8,501,333,670
派生商品評価勘定	706,428,001
未収入金	87,375,060
未収配当金	536,003,444
差入委託証拠金	7,799,110,489
流動資産合計	419,006,845,941
資産合計	419,006,845,941
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,388,107
未払金	279,763,719
未払解約金	575,527,000
流動負債合計	925,678,826
負債合計	925,678,826
純資産の部	
元本等	
元本	※1 78,782,685,463
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	339,298,481,652
元本等合計	418,081,167,115
純資産合計	418,081,167,115
負債純資産合計	419,006,845,941

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 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。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。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。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。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>

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 日
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	2023 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	73,305,284,321 円
期中追加設定元本額	7,531,220,417 円
期中一部解約元本額	2,053,819,275 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックス V A	252,159,607 円
ダイワ国内重視バランスファンド 30 V A (一般投資家私募)	2,398,033 円
ダイワ国内重視バランスファンド 50 V A (一般投資家私募)	27,113,381 円
ダイワ国際分散バランスファンド 30 V A (一般投資家私募)	4,173,336 円
ダイワ国際分散バランスファンド 50 V A (一般投資家私募)	131,811,172 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)	102,286,592 円
ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用)	90,561,111 円
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)	731,492,283 円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	4,494,733,779 円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)	564,169,530 円
D-I's 外国株式インデックス	20,923,332 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	53,313,694 円
i F r e e 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	7,612,759,721 円
i F r e e 8資産バランス	1,484,945,225 円
i F r e e 年金バランス	321,035,811 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,052,677 円

区分	2023年12月5日現在
DCダイワ外国株式インデックス	47,549,251,480円
ダイワ・ライフ・バランス30	507,111,516円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,075,299,438円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,028,299,491円
大和DC海外株式インデックスファンド	2,017,055,591円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	12,568,923円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	13,068,453円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,129,678,498円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,057,594円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,504,278円
ダイワつみたてインデックスバランス70	5,293,680円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	11,618,359円
ダイワ世界バランスファンド40VA	52,676,509円
ダイワ世界バランスファンド60VA	33,932,785円
ダイワ・バランスファンド35VA	910,373,309円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	48,117,622円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	140,584,660円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,398,852,149円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	431,373,322円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	2,324,047,271円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,022,029,754円
ダイワライフスタイル25	8,618,923円
ダイワライフスタイル50	39,067,351円
ダイワライフスタイル75	32,621,224円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	89,653,999円
計	78,782,685,463円
2. 期末日における受益権の総数	78,782,685,463口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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>

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2023年12月5日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引					
株価指数 先物取引					
買建	18,577,271,170		-	19,256,655,104	679,383,934
合計	18,577,271,170		-	19,256,655,104	679,383,934

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2023年12月5日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
買建	9,103,193,530		-	9,059,849,490	△43,344,040
アメリカ・ドル	5,287,986,000		-	5,265,381,600	△22,604,400
イギリス・ ポンド	278,640,900		-	277,442,400	△1,198,500
オーストラリ ア・ドル	612,777,690		-	610,561,350	△2,216,340
カナダ・ドル	944,137,920		-	940,096,770	△4,041,150
スイス・フラン	776,370,520		-	775,144,620	△1,225,900
ユーロ	1,203,280,500		-	1,191,222,750	△12,057,750

種類	2023年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
合計	9,103,193,530	-	9,059,849,490	△43,344,040

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年12月5日現在
1口当たり純資産額	5.3068円
(1万口当たり純資産額)	(53,068円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月5日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,082,456,148
コール・ローン	1,424,513,974
国債証券	276,320,079,929
派生商品評価勘定	4,395
未収入金	43,204,333
未収利息	1,892,542,980
前払費用	76,724,407
流動資産合計	288,839,526,166
資産合計	288,839,526,166
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,137,287
未払金	5,742,876,764
未払解約金	326,661,323
流動負債合計	6,076,675,374
負債合計	6,076,675,374
純資産の部	
元本等	
元本	※1 82,578,920,852
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	200,183,929,940
元本等合計	282,762,850,792
純資産合計	282,762,850,792
負債純資産合計	288,839,526,166

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 6 月 6 日 至 2023 年 12 月 5 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。 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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。 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	2023 年 12 月 5 日現在
1. ※1 期首	2023 年 6 月 6 日
期首元本額	79,326,984,057 円
期中追加設定元本額	6,194,292,139 円
期中一部解約元本額	2,942,355,344 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスVA	391,220,587 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	7,319,300 円

区分	2023年12月5日現在
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	40,271,896円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,003,665円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	203,109,383円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	569,147,604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)	789,537,760円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	3,678,762,630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)	846,963,929円
D-I's 外国債券インデックス	2,551,780円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	19,850,729円
iFree 外国債券インデックス	2,158,748,213円
iFree 8資産バランス	2,278,798,652円
iFree 年金バランス	496,915,006円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	317,728円
DCダイワ外国債券インデックス	51,432,449,750円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,155,771,303円
ダイワ・ライフ・バランス50	815,278,955円
ダイワ・ライフ・バランス70	624,369,470円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	691,324,270円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	547,435,066円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	218,542,112円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	37,083,440円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	18,926,484円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,954,094,615円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,614,349円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,938,861円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,291,011円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	1,109,516,318円
ダイワ世界バランスファンド40VA	93,247,794円
ダイワ世界バランスファンド60VA	25,462,305円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,818,521,908円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	174,697,159円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	160,248,328円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	66,707,729円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	3,204,755,855円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,819,566,379円
ダイワライフスタイル25	26,707,798円

区分	2023年12月5日現在
ダイワライフスタイル50	59,336,674円
ダイワライフスタイル75	16,514,057円
計	82,578,920,852円
2. 期末日における受益権の総数	82,578,920,852口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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>

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年12月5日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建	271,760,551	-	272,064,759	△304,208	
アメリカ・ドル	153,317,186	-	153,556,452	△239,266	
イギリス・ポンド	16,921,049	-	16,920,803	246	
ユーロ	101,522,316	-	101,587,504	△65,188	
買建	1,166,271,232	-	1,159,442,548	△6,828,684	
オフショア・人民元	1,046,331,594	-	1,040,423,296	△5,908,298	
シンガポール・ドル	19,520,002	-	19,393,659	△126,343	

種類	2023年12月5日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
ニュージーランド・ドル	25,779,248	-	25,636,396	△142,852
ポーランド・ズロチ	27,875,525	-	27,717,861	△157,664
メキシコ・ペソ	46,764,863	-	46,271,336	△493,527
合計	1,438,031,783	-	1,431,507,307	△7,132,892

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
に評価しております。
- ① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されてい
る場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されてい
ない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている
場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先
物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていな
い場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値
を用いております。
- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の
対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年12月5日現在
1口当たり純資産額	3.4242円
(1万口当たり純資産額)	(34,242円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年12月29日

I 資産総額	7,002,929,342 円
II 負債総額	12,289,842 円
III 純資産総額 (I - II)	6,990,639,500 円
IV 発行済数量	4,914,115,425 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.4226 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

2023年12月29日

I 資産総額	294,653,571,073 円
II 負債総額	7,718,688,250 円
III 純資産総額 (I - II)	286,934,882,823 円
IV 発行済数量	168,766,987,274 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.7002 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

2023年12月29日

I 資産総額	427,502,403,105 円
II 負債総額	418,376,345 円
III 純資産総額 (I - II)	427,084,026,760 円
IV 発行済数量	79,513,676,221 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	5.3712 円

(参考) ネオ・ジャパン債券マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日

I 資産総額	143,193,168,532 円
II 負債総額	13,800,000 円
III 純資産総額 (I - II)	143,179,368,532 円
IV 発行済数量	134,620,594,648 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.0636 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

2023 年 12 月 29 日

I 資産総額	285,357,344,043 円
II 負債総額	581,926,437 円
III 純資産総額 (I - II)	284,775,417,606 円
IV 発行済数量	82,919,285,917 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.4344 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。
- (2) 受益者に対する特典
ありません。
- (3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。
- (4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の譲渡
 - ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
 - ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
 - ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (6) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (7) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。
- (8) 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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、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

2023年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023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	90	293,196
追加型株式投資信託	790	25,470,735
株式投資信託 合計	880	25,763,932
単位型公社債投資信託	101	170,879
追加型公社債投資信託	14	1,533,421
公社債投資信託 合計	115	1,704,299
総合計	995	27,468,231

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、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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64期事業年度（2022年4月1日から2023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65期事業年度に係る中間会計期間（2023年4月1日から2023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り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。

独立監査人の監査報告書

2023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	間瀬 友未
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64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2023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、継続企業的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。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,168	1,982
有価証券	486	346
前払費用	332	393
未収委託者報酬	13,811	12,525
未収収益	52	47
関係会社短期貸付金	24,900	22,100
その他	45	59
流動資産計	42,799	37,455
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	4	3
器具備品	198	193
無形固定資産	1,770	1,482
ソフトウェア	1,738	1,351
ソフトウェア仮勘定	31	131
投資その他の資産	16,617	13,824
投資有価証券	10,755	8,260
関係会社株式	3,705	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,067	1,066
繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	101
未払金	9,856	5,874
未払収益分配金	26	38
未払償還金	12	12
未払手数料	4,917	4,525
その他未払金	※2 4,900	※2 1,297
未払費用	4,246	3,987
未払法人税等	980	560
未払消費税等	1,016	327
賞与引当金	866	692
その他	2	2
流動負債計	17,033	11,545
固定負債		
退職給付引当金	2,399	2,276
役員退職慰労引当金	13	51
その他	1	0
固定負債計	2,415	2,329
負債合計	19,449	13,874
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,925	11,505
利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692
福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	327	286
有価証券償還益	40	150
その他	264	171
営業外収益計	631	608
営業外費用		
投資有価証券売却損	59	244
有価証券償還損	0	2
その他	34	31
営業外費用計	93	277
経常利益	19,089	15,642
特別損失		
関係会社整理損失	-	229
投資有価証券評価損	331	257
特別損失計	331	486
税引前当期純利益	18,757	15,155
法人税、住民税及び事業税	5,950	4,589
法人税等調整額	69	248
法人税等合計	6,019	4,838
当期純利益	12,738	10,317

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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	947	947	38,566
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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通りであります。

建物	15～18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別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与及び上席参事についても、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。

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

※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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
未払金	4,694百万円	1,178百万円

3 保証債務

前事業年度(2022年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2023年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 3月31日	2021年 6月23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
2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ①剰余金の配当の総額 12,737百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 4,883円
- ④基準日 2022年3月31日
- ⑤効力発生日 2022年6月24日

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 為替変動リスクの管理

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

(ii) 価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（2022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	66	—	—	66
資産合計	66	—	—	66

当事業年度（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（2）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,448
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度 (2022年3月31日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 1,677百万円) 及び関連会社株式 (貸借対照表計上額 2,027百万円) は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度 (2023年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度 (2022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	66	55	11
(2) その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

(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（2023年3月31日）

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

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331百万円の減損処理を行っております。

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

(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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,452百万円	2,399百万円
勤務費用	152	150
退職給付の支払額	△ 303	△ 322
その他	98	48
退職給付債務の期末残高	2,399	2,276

(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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,399 百万円	2,276 百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,399	2,276
退職給付引当金	2,399	2,276
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,399	2,276

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	152 百万円	150 百万円
その他	67	153
確定給付制度に係る退職給付費用	219	303

(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189百万円、当事業年度184百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	734	697
賞与引当金	227	182
投資有価証券評価損	144	177
関係会社株式評価損	—	155
未払事業税	213	114
出資金評価損	94	94
システム関連費用	111	68
その他	437	309
繰延税金資産小計	1,963	1,799
評価性引当額	△ 356	△ 459
繰延税金資産合計	1,607	1,339
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 562	△ 356
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 722	△ 515
繰延税金資産の純額	885	824

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（2022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（2023年3月31日）

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 69,845 百万円、その他 559 百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (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)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	17,100 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	22,100 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,900	-	-

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

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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	15,348	未払手数料	3,028
						本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
							不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。
- (注4) ソフトウェアの購入については、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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	16,078.50円	1株当たり純資産額 14,983.42円
1株当たり当期純利益	4,883.43円	1株当たり当期純利益 3,955.35円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,738	10,317
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 渡部 啓太

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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。

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 (2023年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		2,879
有価証券		110
未収委託者報酬		14,148
関係会社短期貸付金		17,800
その他		629
流動資産合計		35,568
固定資産		
有形固定資産	※1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		1,009
その他		203
無形固定資産合計		1,213
投資その他の資産		
投資有価証券		8,477
関係会社株式		3,475
繰延税金資産		628
その他		1,216
投資その他の資産合計		13,797
固定資産合計		15,196
資産合計		50,764

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2023年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		5,255
未払費用		4,567
未払法人税等		2,453
賞与引当金		727
その他	※2	725
流動負債合計		13,864
固定負債		
退職給付引当金		2,228
役員退職慰労引当金		58
固定負債合計		2,287
負債合計		16,152
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,594
利益剰余金合計		6,968
株主資本合計		33,638
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		973
評価・換算差額等合計		973
純資産合計		34,612
負債・純資産合計		50,764

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		36,557
その他営業収益		322
営業収益合計		36,879
営業費用		
支払手数料		15,250
その他営業費用		7,380
営業費用合計		22,631
一般管理費	※1	6,087
営業利益		8,160
営業外収益	※2	128
営業外費用	※3	116
経常利益		8,172
特別利益		—
特別損失	※4	258
税引前中間純利益		7,914
法人税、住民税及び事業税		2,505
法人税等調整額		2
中間純利益		5,405

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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 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
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,316	△10,316	△10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△4,910	△4,910	△4,910
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,594	6,594	33,638

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,316
中間純利益	-	-	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	438	438	438
当中間期変動額合計	438	438	△4,472
当中間期末残高	973	973	34,612

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

であります。

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

5. グループ通算制度の適用

当社は、株式会社大和証券グループ本社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

※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 (2023年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務2,299百万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 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

※2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
投資有価証券売却益	35百万円
有価証券償還益	32百万円
雑収入	32百万円
受取配当金	25百万円

※3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
有価証券償還損	103百万円

※4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
ソフトウェア除却損	153百万円
投資有価証券評価損	104百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
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

(金融商品関係)

当中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	111	7,809	—	7,921
資産合計	111	7,809	—	7,921

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の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	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間 (2023年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式 (中間貸借対照表計上額 1,448百万円) 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	111	55	56
(2) その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
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	2,297	2,623	△325
小計	2,297	2,623	△325
合計	7,921	6,518	1,403

(注) 非上場株式 (中間貸借対照表計上額 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。

(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 36,557 百万円、その他 322 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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,268.89円
1株当たり中間純利益	2,072.34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 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③ 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

- a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。
- 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。

追加型証券投資信託

(i F r e e 年金バランス)

約 款

大和アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

別に定めるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主として、別に定めるマザーファンドの受益証券への投資を通じて、国内外の様々な資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
※ インデックス運用を行なうマザーファンドの受益証券への投資を基本としますが、市場環境等によっては、委託会社の判断に基づき、インデックス運用を行なわないマザーファンドの受益証券に投資を行ないます。
- ② 資産クラスおよび配分比率の決定にあたっては、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオに近づけることを目標とします。
- ③ 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ④ 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。
- ⑤ 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。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資制限
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ② 新株引受権証券等への投資制限
新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 投資信託証券への投資制限
投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ⑥ 有価証券先物取引等の範囲
有価証券先物取引等は、約款第22条の範囲で行ないます。
- ⑦ スワップ取引の範囲
スワップ取引は、約款第23条の範囲で行ないます。
- ⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引の範囲
金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第24条の範囲で行ないます。

3. 収益分配方針

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
(i F r e e 年金バランス)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関(受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第17条第1項、同条第2項および第30条において同じ。))を含みます。)と信託契約を締結し、これを委託することができます。

④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第 2 条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けま

す。

(信託金の限度額)

第 3 条 委託者は、受託者と合意のうえ、3,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第48条第1項、同条第2項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第 5 条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第 6 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第 7 条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところに従い、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。

③ 前項の規定により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せん。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者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、委託者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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法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(以下「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③ 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。

④ 第28条に規定する予約為替の評価は、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。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者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 委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、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。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、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。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 委託者は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として委託者が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。
- ③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、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。
- ④ 第1項および第2項の規定にかかわらず、委託者および指定販売会社は、別に定める取引所の休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込の受付を行ないません。
- ⑤ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第38条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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、委託者が追加設定を制限する措置をとった場合には、指定販売会社は、取得申込の受付を中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込を取消することができるものとします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第13条 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、

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、ただし、前項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。）に社振法の規定に従い、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、

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託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、

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、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、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限り、）

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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第16条 委託者は、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別に定めるマザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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

います。)

14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第14号の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前項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号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。
- ④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑥ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑦ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（利害関係人等との取引等）

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人、第30条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条まで、第26条、第28条、第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができ

ます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条まで、第26条、第28条、第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

（運用の基本方針）

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

（投資する株式等の範囲）

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限）

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信用取引の指図範囲）

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができます。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図および範囲）

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロ

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

1. 先物取引の売建およびコール・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(組入有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する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。
- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する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。
- ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・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第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する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。

(スワップ取引の運用指図および範囲)

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

- ② 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、第4条に定める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。
- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみ

なした額との合計額（以下本項において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ⑥ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲）

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、第4条に定める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。
- ③ 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本項において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ⑧ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第25条 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第27条 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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④ 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第29条 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(信託業務の委託等)

第30条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適

合していることを確認するものとします。

- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第31条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第32条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、すみやかに登記または登録をすることとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第33条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第34条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第35条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第36条 委託者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、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第37条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第38条 この信託の計算期間は、毎年6月6日から翌年6月5日までとします。ただし、第1計算期間は、2018年8月31日から2019年6月5日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定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。

(信託財産に関する報告等)

第39条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行なうことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行なわないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第40条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 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。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の15.9の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ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。
- ③ 第1項の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。

(収益の分配方式)

第42条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第43条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）

に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定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て支払います。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第45条 受益者が、収益分配金については第43条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第43条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として委託者または指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める取引所の休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約請求の受付を行いません。なお、前項の一部解約請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約請求をするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、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、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求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一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第47条 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第48条 委託者は、信託期間中において、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、年金積立金管理運用独立行政法人（GPIF）の基本ポートフォリオ（これに準ずるものを含みます。）の参照が不能となる場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③ 委託者は、第1項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。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等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ④ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）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、この信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ⑤ 第3項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。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約するとき、あるいは、委託者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、この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、第3項から前項までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条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者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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け出ます。なお、この信託約款は本条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、

- ② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、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、書面決議を行いません。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等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この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 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）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、この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 第2項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、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者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、この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 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第54条 この信託は、受益者が第46条の規定による一部解約請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行なう場合において、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。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第55条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があつた場合には、これを交付します。

（公告）

第57条 委託者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 前項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。

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

- 第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。
- 第 2条 第43条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。
- 第 3条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 第 4条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

2018年8月31日

委託者 大和アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

I 別に定めるマザーファンド

約款第16条および「運用の基本方針」の「別に定めるマザーファンド」とは、次のものをいいます。

親投資信託（トピックス・インデックス・マザーファンド）
親投資信託（外国株式インデックスマザーファンド）
親投資信託（ネオ・ジャパン債券マザーファンド）
親投資信託（外国債券インデックスマザーファンド）

II 別に定める取引所

約款第12条および第46条の「別に定める取引所」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所