

ダイワライフスタイル75

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

※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8月24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「ダイワライフスタイル75」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8月23日に関東財務局長に提出しており、2024年8月24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】

ダイワライフスタイル75

(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】

5,000億円を上限とします。

(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8月24日から2025年2月21日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式					
一般	年1回	グローバル (含む日本)			
大型株					
中小型株	年2回	日本			日経225
債券					
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
公債		欧州			
社債	年6回 (隔月)	アジア			TOPIX
その他債券		オセアニア			
クレジット属性 ()					
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産配分 (固定型(株式、債券)))	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (合成インデックス)
資産複合 ()	その他 ()	中近東 (中東)			
資産配分固定型		エマージング			
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

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

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

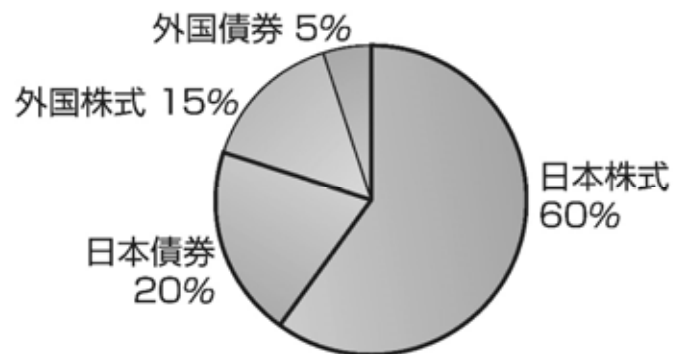
<信託金の限度額>

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

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行いません。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国内	海外	合計
株式	60%	15%	75%
債券	20%	5%	25%
合計	80%	20%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

2

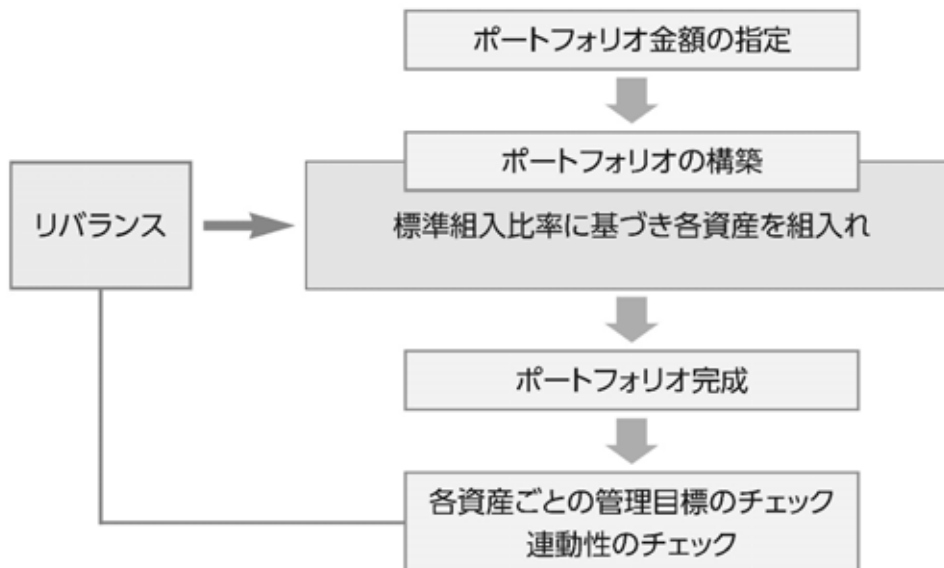
各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

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

各資産ごとのベンチマーク

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

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

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

3 毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産総額の50%以下とします。

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

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

2. 日本債券インデックスマザーファンド

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデル^(注)の使用により効率的なDBI総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またDBI総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行いません。

(注) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。このモデルを用いることにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ないポートフォリオを効率的に構築および管理することができます。

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスであり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対象：日本で発行されている確定利付公募債券

残存額：50億円以上

期間：残存期間1年以上

種類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

3. 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

(2) 【ファンドの沿革】

2000年4月28日
2000年12月1日

信託契約締結、当初設定、運用開始
ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル75」）

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 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
	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 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
	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 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	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）、わが国の公社債、外国の株式（預託証券を含みます。）、外国の公社債 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（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 (2024年5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

トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックス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

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

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

<標準組入比率>

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の60%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

ハ. 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。

- ニ. 保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。
- ホ. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。
- ヘ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

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

(2) 【投資対象】

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

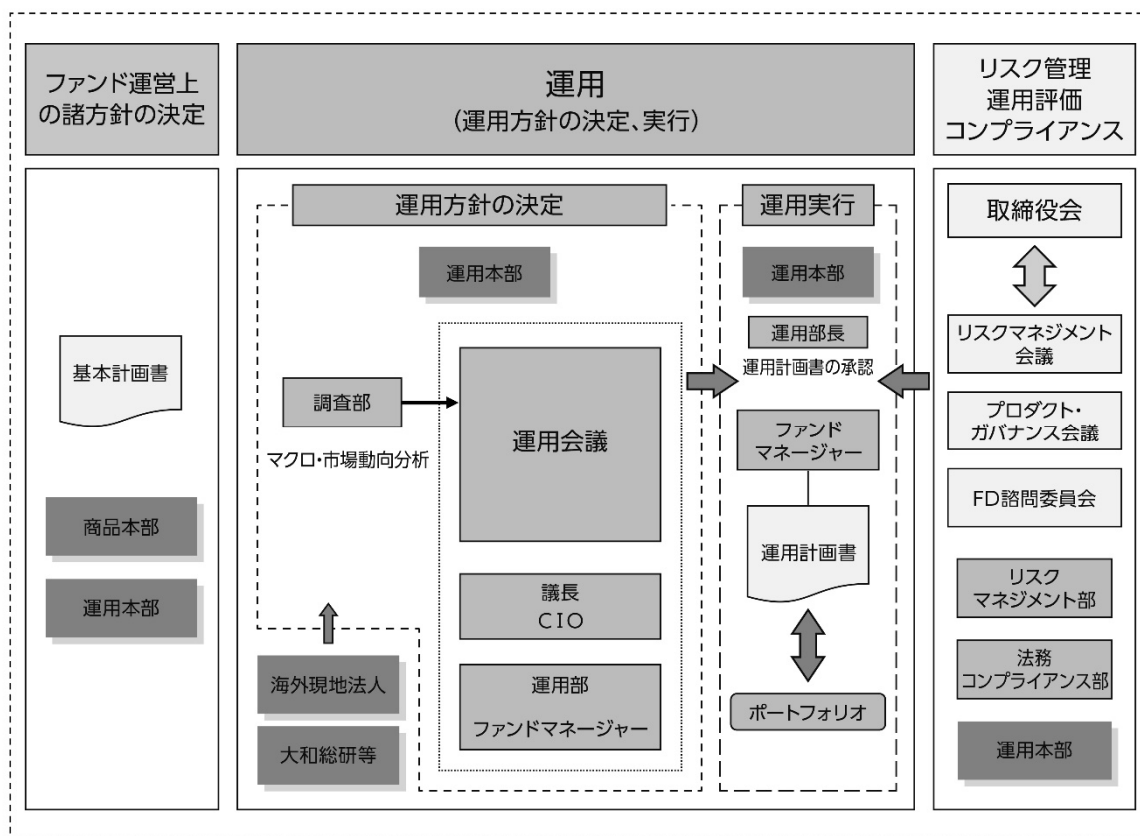
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 22. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 24. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 25. 外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの
なお、前5.の証券または証書ならびに前16.および前20.の証券または証書のうち前5.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前6.から前10.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券ならびに前16.および前20.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（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。
- 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 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

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

(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・ガバナンス会議およびFD 諮問委員会

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

イ. リスクマネジメント会議

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

ロ. プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ. FD 諮問委員会

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

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は2024年5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】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

- 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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 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、取得時において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、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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商

品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。) 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. 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(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)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て取扱うものとします（以下同じ）。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当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)②の 1. から 4. に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 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、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。
- ハ. 委託会社は、わが国の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これらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)②の 1. から 4. に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)②の 1. から 4. に掲げる金融商品で運用している額（以下本 2. において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

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 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債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10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転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑫ 有価証券の貸付け（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.および2.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の50%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。

ロ. 前イ.の1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

⑬ 外貨建資産（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産総額に占める外貨建資産の時価総額の

割合を乗じて得た額をいいます。

⑭ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑮ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑯ 信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰ 資金の借入れ（信託約款）

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

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より支弁します。

<参 考>マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 基本的な投資態度

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）をモデルとして運用を行ないます。

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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。

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。

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、異なった受取り金利または異なった受取り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. 日本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

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

(2) 投資対象

- 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。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。
1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

3. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

- (1) 投資方針
 - ① 主要投資対象
外国の公社債を主要投資対象とします。
 - ② 投資態度
 - イ. 主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
 - ロ. 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
 - ハ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
- (2) 投資対象
 - ① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
 1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当

たは株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。
 - ② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
 - ③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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。組入実質外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

なお、当ファンドにおいては、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行ないません。このため、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、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) その他の留意点

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

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

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

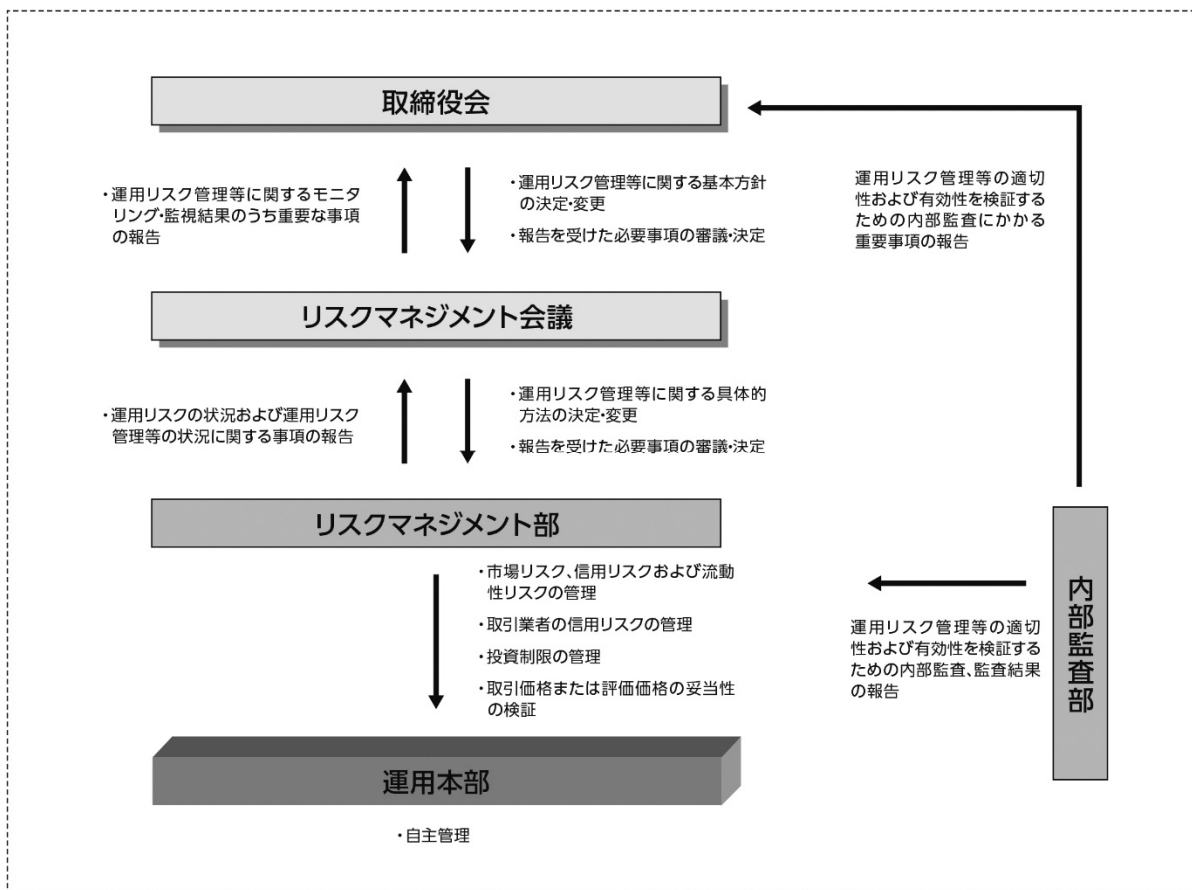
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

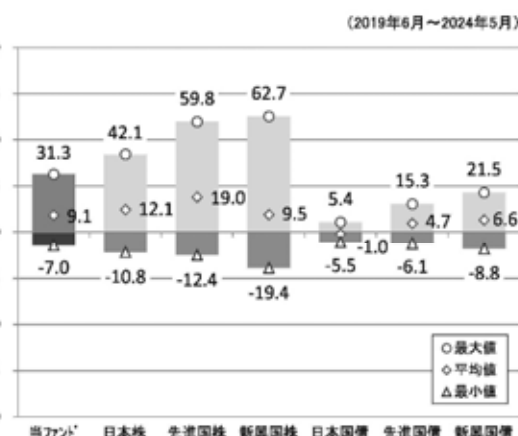
参考情報

- 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。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる商標または商標は、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に基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>] ●NOMURA-BPI 国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承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 0.99%（税抜 0.90%）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信託財産中から支弁するものとします。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.35% (税抜)	年率 0.47% (税抜)	年率 0.08% (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ならびに信託財産にかかる監査報酬および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な費用（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（配当控除の適用があります。）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、2024年5月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2024年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,276,573,543	99.71
内 日本	1,276,573,543	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,748,860	0.29
純資産総額	1,280,322,403	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2024年5月31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	382,541,278	1.7061 652,688,604	2.0133 770,170,354	60.15
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	191,244,504	1.3432 256,893,827	1.3059 249,746,197	19.51
3	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	29,911,662	5.2808 157,958,784	6.4563 193,118,663	15.08
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	17,302,053	3.4348 59,430,244	3.6723 63,538,329	4.96

(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	99.71%
合計	99.71%

(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

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15 計算期間末 (2014年12月1日)	647,563,978	647,563,978	1.2277	1.2277
第16 計算期間末 (2015年11月30日)	734,908,867	734,908,867	1.3210	1.3210
第17 計算期間末 (2016年11月30日)	760,338,807	760,338,807	1.2701	1.2701
第18 計算期間末 (2017年11月30日)	937,336,300	937,336,300	1.4842	1.4842
第19 計算期間末 (2018年11月30日)	964,868,778	964,868,778	1.4329	1.4329
第20 計算期間末 (2019年12月2日)	987,001,021	987,001,021	1.5034	1.5034
第21 計算期間末 (2020年11月30日)	1,003,821,196	1,003,821,196	1.5739	1.5739
第22 計算期間末 (2021年11月30日)	1,071,752,055	1,071,752,055	1.7587	1.7587
第23 計算期間末 (2022年11月30日)	970,687,952	970,687,952	1.8029	1.8029
2023年5月末日	1,057,630,228	—	1.9156	—
6月末日	1,123,004,594	—	2.0278	—
7月末日	1,128,346,203	—	2.0405	—
8月末日	1,139,629,660	—	2.0491	—
9月末日	1,141,426,257	—	2.0422	—
10月末日	1,092,275,147	—	1.9870	—
第24 計算期間末 (2023年11月30日)	1,143,789,567	1,143,789,567	2.0848	2.0848
12月末日	1,149,612,818	—	2.0878	—
2024年1月末日	1,217,739,552	—	2.2013	—
2月末日	1,251,953,426	—	2.2834	—
3月末日	1,286,077,720	—	2.3573	—
4月末日	1,268,190,562	—	2.3442	—
5月末日	1,280,322,403	—	2.3599	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第15 計算期間	0.0000
第16 計算期間	0.0000
第17 計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
2023年12月1日～ 2024年5月31日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第15計算期間	13.6
第16計算期間	7.6
第17計算期間	△3.9
第18計算期間	16.9
第19計算期間	△3.5
第20計算期間	4.9
第21計算期間	4.7
第22計算期間	11.7
第23計算期間	2.5
第24計算期間	15.6
2023年12月1日～ 2024年5月31日	13.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第15計算期間	88,503,723	58,126,096
第16計算期間	101,015,060	72,136,389
第17計算期間	85,325,672	42,999,115
第18計算期間	91,122,014	58,225,626
第19計算期間	88,023,270	46,224,810
第20計算期間	77,348,317	94,205,484
第21計算期間	70,011,657	88,725,573
第22計算期間	58,729,098	87,120,025
第23計算期間	43,691,259	114,678,406
第24計算期間	52,043,128	41,811,980
2023年12月1日～ 2024年5月31日	30,457,532	36,565,089

(参考) マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		344,868,750,330	96.52
	内 日本	344,868,750,330	96.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,447,771,902	3.48
純資産総額		357,316,522,232	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		12,307,680,000	3.44
	内 日本	12,307,680,000	3.44

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年5月31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	4,849,200	2,904.97 14,086,804,023	3,401.00 16,492,129,200	4.62
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,296,900	1,332.01 7,055,559,224	1,658.00 8,782,260,200	2.46
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	618,500	12,820.62 7,929,558,338	12,895.00 7,975,557,500	2.23
4	日立	日本	株式	電気機器	428,700	10,120.88 4,338,822,155	16,145.00 6,921,361,500	1.94
5	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	186,900	21,592.52 4,035,643,036	33,630.00 6,285,447,000	1.76
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	609,100	7,632.84 4,649,165,737	10,290.00 6,267,639,000	1.75
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	88,400	58,340.21 5,157,274,592	70,690.00 6,248,996,000	1.75
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,794,200	2,547.86 4,571,386,886	3,303.00 5,926,242,600	1.66

	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	三井物産	日本	株式	卸売業	699,900	5,839.79 4,087,271,038	7,970.00 5,578,203,000	1.56
10	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	653,800	5,144.43 3,363,428,833	7,948.00 5,196,402,400	1.45
11	任天堂	日本	株式	その他製 品	557,600	6,537.56 3,645,347,518	8,555.00 4,770,268,000	1.34
12	伊藤忠	日本	株式	卸売業	628,100	5,782.02 3,631,687,368	7,410.00 4,654,221,000	1.30
13	信越化学	日本	株式	化学	793,300	4,701.53 3,729,724,476	5,855.00 4,644,771,500	1.30
14	東京海上HD	日本	株式	保険業	849,200	3,632.49 3,084,717,064	5,429.00 4,610,306,800	1.29
15	第一三共	日本	株式	医薬品	771,600	4,099.07 3,162,843,711	5,578.00 4,303,984,800	1.20
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信 業	26,346,300	180.44 4,753,987,043	154.30 4,065,234,090	1.14
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	436,900	6,574.17 2,872,255,818	9,042.00 3,950,449,800	1.11
18	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,174,000	2,686.60 3,154,073,050	3,214.00 3,773,236,000	1.06
19	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	2,092,500	1,790.06 3,745,704,668	1,769.50 3,702,678,750	1.04
20	HOYA	日本	株式	精密機器	173,900	16,216.29 2,820,013,948	19,060.00 3,314,534,000	0.93
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	783,900	4,771.09 3,740,064,077	4,173.00 3,271,214,700	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	684,400	4,711.35 3,224,449,552	4,337.00 2,968,242,800	0.83
23	三菱電機	日本	株式	電気機器	992,800	1,944.76 1,930,760,622	2,730.00 2,710,344,000	0.76
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信 業	1,414,200	1,766.70 2,498,479,595	1,887.50 2,669,302,500	0.75
25	ディスコ	日本	株式	機械	42,900	27,678.81 1,187,421,317	61,490.00 2,637,921,000	0.74
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	106,500	24,665.59 2,626,886,331	22,945.00 2,443,642,500	0.68
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	803,500	2,767.08 2,223,350,973	2,966.50 2,383,582,750	0.67
28	丸紅	日本	株式	卸売業	775,000	2,511.43 1,946,360,015	3,060.00 2,371,500,000	0.66
29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	528,400	3,430.78 1,812,828,430	4,452.00 2,352,436,800	0.66
30	住友商事	日本	株式	卸売業	565,500	3,240.21 1,832,341,456	4,081.00 2,307,805,500	0.65

(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	96.52%
合計	96.52%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.34%
建設業	1.97%
食料品	3.01%
繊維製品	0.35%
パルプ・紙	0.15%
化学	5.35%
医薬品	4.16%
石油・石炭製品	0.53%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.86%
非鉄金属	0.77%
金属製品	0.50%
機械	5.42%
電気機器	16.78%
輸送用機器	8.52%
精密機器	2.16%
その他製品	2.31%
電気・ガス業	1.52%
陸運業	2.21%
海運業	0.76%
空運業	0.36%
倉庫・運輸関連業	0.13%
情報・通信業	6.61%
卸売業	7.55%
小売業	3.90%
銀行業	7.79%
証券、商品先物取引業	0.92%
保険業	2.94%
その他金融業	1.13%
不動産業	1.87%
サービス業	4.23%
合計	96.52%

(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 0606 月	買建	444	12,158,486,800	12,307,680,000	3.44%

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年5月31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	96,154,937,240	82.94
内 日本	96,154,937,240	82.94
地方債証券	6,739,298,500	5.81
内 日本	6,739,298,500	5.81
特殊債券	3,822,859,400	3.30
内 日本	3,822,859,400	3.30
社債券	8,902,518,800	7.68
内 日本	8,902,518,800	7.68
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	309,178,784	0.27
純資産総額	115,928,792,724	100.00

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

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

(2) 投資資産 (2024年5月31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	145 5 年国債	日本	国債証券	1,770,000,000	100.17 1,773,026,700	99.79 1,766,318,400	0.100000 2025/09/20	1.52
2	144 5 年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	100.16 1,502,548,000	99.83 1,497,570,000	0.100000 2025/06/20	1.29
3	147 5 年国債	日本	国債証券	1,430,000,000	99.91 1,428,803,900	99.38 1,421,191,200	0.005000 2026/03/20	1.23
4	370 10 年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	98.67 1,332,129,200	96.23 1,299,105,000	0.500000 2033/03/20	1.12
5	150 5 年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	99.68 1,295,940,000	98.94 1,286,233,000	0.005000 2026/12/20	1.11
6	148 5 年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	99.87 1,278,424,000	99.20 1,269,862,400	0.005000 2026/06/20	1.10
7	349 10 年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	99.71 1,246,475,000	98.62 1,232,775,000	0.100000 2027/12/20	1.06
8	146 5 年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.15 1,181,802,400	99.68 1,176,271,200	0.100000 2025/12/20	1.01
9	149 5 年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	99.53 1,164,546,400	99.07 1,159,200,900	0.005000 2026/09/20	1.00

	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 (%)
10	347 10 年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	99.91 1,099,021,000	98.93 1,088,263,000	0.100000 2027/06/20	0.94
11	365 10 年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	96.63 1,092,018,000	94.64 1,069,499,800	0.100000 2031/12/20	0.92
12	456 2 年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.87 1,048,645,500	99.65 1,046,356,500	0.100000 2026/01/01	0.90
13	348 10 年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.82 1,048,204,500	98.78 1,037,211,000	0.100000 2027/09/20	0.89
14	360 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.94 979,480,000	96.26 962,640,000	0.100000 2030/09/20	0.83
15	373 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.93 989,359,600	96.13 961,360,000	0.600000 2033/12/20	0.83
16	369 10 年国債	日本	国債証券	990,000,000	98.96 979,707,700	96.51 955,528,200	0.500000 2032/12/20	0.82
17	363 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.20 972,036,000	95.36 953,620,000	0.100000 2031/06/20	0.82
18	364 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.85 968,500,000	95.00 950,090,000	0.100000 2031/09/20	0.82
19	345 10 年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.04 950,427,500	99.18 942,210,000	0.100000 2026/12/20	0.81
20	350 10 年国債	日本	国債証券	900,000,000	99.59 896,355,000	98.43 885,933,000	0.100000 2028/03/20	0.76
21	367 10 年国債	日本	国債証券	900,000,000	96.94 872,487,000	94.74 852,723,000	0.200000 2032/06/20	0.74
22	151 5 年国債	日本	国債証券	850,000,000	99.66 847,181,000	98.79 839,791,500	0.005000 2027/03/20	0.72
23	16 40 年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	85.80 961,024,300	74.31 832,361,600	1.300000 2063/03/20	0.72
24	362 10 年国債	日本	国債証券	850,000,000	97.35 827,533,900	95.67 813,220,500	0.100000 2031/03/20	0.70
25	368 10 年国債	日本	国債証券	860,000,000	96.67 831,396,500	94.41 811,943,200	0.200000 2032/09/20	0.70
26	343 10 年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.11 780,889,200	99.40 775,327,800	0.100000 2026/06/20	0.67
27	344 10 年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.09 780,756,600	99.29 774,493,200	0.100000 2026/09/20	0.67
28	346 10 年国債	日本	国債証券	780,000,000	99.98 779,867,400	99.06 772,675,800	0.100000 2027/03/20	0.67
29	340 10 年国債	日本	国債証券	760,000,000	100.71 765,411,200	100.18 761,375,600	0.400000 2025/09/20	0.66
30	371 10 年国債	日本	国債証券	800,000,000	97.56 780,555,000	95.10 760,808,000	0.400000 2033/06/20	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	82.94%
地方債証券	5.81%
特殊債券	3.30%
社債券	7.68%
合計	99.73%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	515,770,117,853	91.68
内 香港	2,829,968,210	0.50
内 シンガポール	1,978,254,875	0.35
内 イスラエル	1,112,591,261	0.20
内 ノルウェー	935,166,323	0.17
内 スウェーデン	4,895,974,513	0.87
内 デンマーク	5,777,978,305	1.03
内 イギリス	21,634,020,538	3.85
内 アイルランド	524,055,636	0.09
内 オランダ	7,362,701,729	1.31
内 ベルギー	1,281,749,058	0.23
内 フランス	16,724,228,447	2.97
内 ドイツ	12,146,715,273	2.16
内 スイス	12,956,179,804	2.30
内 ポルトガル	275,392,068	0.05
内 スペイン	3,867,968,201	0.69
内 イタリア	3,929,645,363	0.70
内 フィンランド	1,456,056,895	0.26
内 オーストリア	271,882,942	0.05
内 カナダ	15,682,849,663	2.79
内 アメリカ	390,949,800,372	69.49
内 オーストラリア	8,887,760,245	1.58
内 ニュージーランド	289,178,132	0.05
投資証券	9,989,938,898	1.78
内 香港	143,669,478	0.03
内 シンガポール	189,235,714	0.03
内 イギリス	175,853,692	0.03
内 ベルギー	40,992,454	0.01
内 フランス	199,969,431	0.04
内 カナダ	35,015,071	0.01
内 アメリカ	8,322,419,129	1.48
内 オーストラリア	882,783,929	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)	36,803,829,599	6.54
純資産総額	562,563,886,350	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)	36,305,293,627	6.45
内 イギリス	1,876,080,495	0.33
内 ドイツ	6,353,219,644	1.13
内 カナダ	2,392,312,602	0.43
内 アメリカ	24,330,146,751	4.32
内 オーストラリア	1,353,534,135	0.24
為替予約取引(買建)	20,277,735,340	3.60
内 日本	20,277,735,340	3.60

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年5月31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	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	392,500	59,927.18 23,521,477,285	64,995.37 25,510,685,002	4.53
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	816,500	29,519.78 24,102,982,529	29,982.79 24,480,951,791	4.35
3	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	137,280	80,755.89 11,086,178,821	173,197.70 23,776,580,256	4.23
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	516,900	23,423.38 12,107,557,633	28,106.61 14,528,310,224	2.58
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	123,400	54,390.66 6,711,815,107	73,205.41 9,033,548,458	1.61
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	328,900	21,314.28 7,010,299,478	26,976.52 8,872,577,888	1.58
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	286,440	21,534.66 6,168,410,223	27,203.79 7,792,254,868	1.39

	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	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	44,885	95,167.04 4,271,577,712	127,752.50 5,734,171,160	1.02
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	24,712	152,716.48 3,773,932,892	213,805.89 5,283,571,381	0.94
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	160,670	24,647.05 3,960,066,100	31,242.98 5,019,810,271	0.89
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	72,950	56,938.62 4,153,683,276	64,045.53 4,672,121,516	0.83
12	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	252,309	16,111.14 4,065,012,354	17,866.79 4,507,952,574	0.80
13	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	159,050	37,312.11 5,934,494,269	28,023.54 4,457,144,769	0.79
14	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	188,687	16,007.44 3,020,399,789	20,868.64 3,937,641,830	0.70
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	51,366	83,228.15 4,275,101,945	75,493.82 3,877,815,609	0.69
16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	88,050	40,155.37 3,535,691,312	42,523.56 3,744,199,634	0.67
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	130,967	23,806.76 3,117,905,890	25,482.78 3,337,404,453	0.59
18	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	21,651	110,632.55 2,395,307,262	149,576.18 3,238,473,873	0.58
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	46,500	65,089.41 3,026,661,782	69,294.75 3,222,206,061	0.57
20	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	24,660	94,270.33 2,324,707,899	127,796.39 3,151,459,017	0.56
21	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	133,800	23,890.15 3,196,522,958	22,771.18 3,046,784,847	0.54
22	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	55,350	49,504.91 2,740,100,310	51,595.67 2,855,820,512	0.51
23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	140,821	16,219.76 2,284,088,592	19,518.83 2,748,661,469	0.49
24	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需 品	246,900	8,263.01 2,040,171,884	10,170.85 2,511,184,988	0.45
25	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	99,418	22,689.68 2,255,767,500	24,805.67 2,466,130,339	0.44
26	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	24,290	76,468.58 1,857,422,621	101,514.22 2,465,780,608	0.44
27	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	98,072	22,223.53 2,179,510,766	24,500.02 2,402,766,883	0.43
28	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	395,901	4,821.00 1,908,670,364	6,054.86 2,397,127,583	0.43

	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 (%)
29	ADVANCED MICRO DEVICES	アメリカ	株式	情報技術	89,827	20,211.93 1,815,588,378	26,136.39 2,347,753,954	0.42
30	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	138,276	17,125.29 2,368,035,255	16,342.70 2,259,803,738	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	91.68%
投資証券	1.78%
合計	93.46%

(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	4.28%
素材	3.56%
資本財・サービス	9.63%
一般消費財・サービス	9.08%
生活必需品	6.15%
ヘルスケア	11.22%
金融	14.26%
情報技術	23.46%
コミュニケーション・サービス	7.27%
公益事業	2.48%
不動産	0.28%
合計	91.68%

(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 JUN 24	買建	591	24,368,773,929	24,330,146,751	4.32%
	イギリス	FTSE 100 INDEX JUN 24	買建	114	1,846,368,247	1,876,080,495	0.33%
	オーストラリア	SPI 200 JUN 24	買建	68	1,382,350,730	1,353,534,135	0.24%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX JUN 24	買建	79	2,407,700,046	2,392,312,602	0.43%
	ドイツ	SWISS MKT IX JUN 24	買建	86	1,735,788,468	1,775,577,328	0.32%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		EURO STOXX 50 JUN 24	買建	540	4,573,886,782	4,577,642,316	0.81%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年6月	買建	87,400,000	13,698,045,140	13,691,135,500	2.43%
		豪ドル買/円売 2024年6月	買建	7,300,000	747,907,990	758,597,750	0.13%
		カナダ・ドル買/円売 2024年6月	買建	15,100,000	1,725,089,450	1,728,272,090	0.31%
		ユーロ買/円売 2024年6月	買建	11,200,000	1,889,067,180	1,900,052,000	0.34%
		英ポンド買/円売 2024年6月	買建	5,200,000	1,027,729,850	1,036,893,000	0.18%
		スイス・フラン買/円売 2024年6月	買建	6,700,000	1,149,048,400	1,162,785,000	0.21%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年5月31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	309,220,514,532	97.36
内 ユーロ	98,454,433,202	31.00
内 中国	29,028,372,977	9.14
内 シンガポール	1,201,392,169	0.38
内 マレーシア	1,571,727,870	0.49
内 イスラエル	1,029,147,672	0.32
内 ノルウェー	476,837,263	0.15
内 スウェーデン	569,215,229	0.18
内 デンマーク	794,586,844	0.25
内 イギリス	15,469,092,164	4.87
内 ポーランド	1,570,314,527	0.49
内 カナダ	6,065,761,392	1.91
内 アメリカ	145,897,585,320	45.94
内 メキシコ	2,427,910,203	0.76
内 オーストラリア	3,956,153,216	1.25
内 ニュージーランド	707,984,484	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,376,419,790	2.64
純資産総額	317,596,934,322	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,131,260,001	0.67
内 日本	2,131,260,001	0.67

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年5月31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	11,000,000	96.47 1,663,420,058	94.87 1,635,777,825	3.875000 2033/08/15	0.52

	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 (%)
2	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	99.49 1,569,034,595	99.83 1,574,516,440	2.050000 2029/04/15	0.50
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	103.33 1,619,629,992	99.57 1,560,660,180	4.500000 2033/11/15	0.49
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,501,722,961	96.96 1,474,219,323	4.125000 2032/11/15	0.46
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,359,606,020	80.53 1,350,700,523	1.125000 2031/02/15	0.43
6	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,293,542,399	101.09 1,310,390,537	2.390000 2026/11/15	0.41
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,323,256,290	87.69 1,305,775,077	2.750000 2032/08/15	0.41
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,312,511,449	88.83 1,294,858,920	2.875000 2032/05/15	0.41
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,297,866,134	79.89 1,289,826,312	1.250000 2031/08/15	0.41
10	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	100.69 1,261,700,439	101.25 1,268,778,307	2.370000 2029/01/15	0.40
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,263,684,902	80.08 1,255,205,268	1.375000 2031/11/15	0.40
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	97.98 1,259,427,401	95.69 1,229,937,212	4.000000 2034/02/15	0.39
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,227,781,724	79.64 1,223,311,812	0.875000 2030/11/15	0.39
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,179,462,230	92.44 1,159,136,187	3.500000 2033/02/15	0.36
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,131,185,330	93.88 1,137,375,806	1.625000 2026/05/15	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,136,605,909	82.71 1,127,892,262	1.625000 2031/05/15	0.36
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,137,370,957	91.36 1,117,027,359	3.375000 2033/05/15	0.35
18	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	100.79 1,088,794,796	101.87 1,100,406,677	2.540000 2030/12/25	0.35
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 999,695,557	91.62 1,005,291,175	1.125000 2026/10/31	0.32
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 988,904,008	78.91 989,556,046	0.625000 2030/08/15	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 987,778,614	93.33 980,185,972	2.875000 2028/08/15	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 960,758,206	93.65 954,156,317	2.875000 2028/05/15	0.30
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 949,828,726	86.92 953,723,715	0.750000 2028/01/31	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 (%)
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	102.17 960,890,839	101.02 950,060,701	4.875000 2028/10/31	0.30
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 955,159,766	91.70 948,652,862	2.625000 2029/02/15	0.30
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 940,018,682	93.55 938,493,916	2.375000 2027/05/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 933,240,148	91.84 935,746,420	1.500000 2027/01/31	0.29
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 936,257,863	93.51 930,753,859	2.750000 2028/02/15	0.29
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 938,559,120	98.93 930,443,122	4.375000 2026/08/15	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.44 935,259,195	98.76 928,863,183	4.250000 2026/01/31	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.36%
合計	97.36%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

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	メキシコ・ペソ買/円売 2024年6月	買建	9,518,000	86,942,171	87,516,106	0.03%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2024年6月	買建	937,000	13,254,895	13,904,424	0.00%
		オフショア人民元買/円売 2024年6月	買建	41,274,000	892,126,206	891,275,791	0.28%
		カナダ・ドル買/円売 2024年6月	買建	1,876,000	213,863,437	214,723,020	0.07%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2024年6月	買建	1,014,000	14,479,514	14,986,920	0.00%
		英ポンド買/円売 2024年 6月	買建	755,000	147,984,398	150,571,234	0.05%
		シンガポール・ドル買/円 売 2024年6月	買建	377,000	43,339,166	43,748,173	0.01%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		米ドル買/円売 2024年6月	買建	2,651,000	413,621,029	415,172,377	0.13%
		マレーシア・リングgit 買/円売 2024年6月	買建	450,000	15,003,000	14,983,920	0.00%
		ユーロ買/円売 2024年6月	買建	1,676,000	283,320,943	284,378,036	0.09%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●ダイワライフスタイル75

2024年5月31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	23,599円
純資産総額	12億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.7%
3カ月間	3.4%
6カ月間	13.2%
1年間	23.2%
3年間	37.0%
5年間	73.1%
設定来	136.0%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
	12年11月	13年12月	14年12月	15年11月	16年11月	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

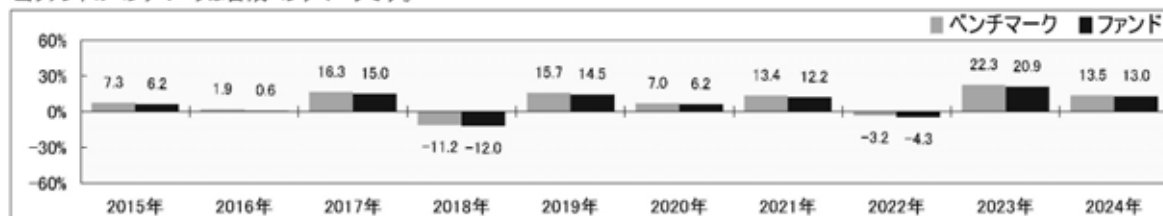
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率	
国内株式・先物	2,122	60.1%	日本円	80.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	2.8%	
国内債券	423	19.5%	米ドル	13.7%	最終利回り(%)	TOPIX 先物 0606月	日本	2.1%	
外国株式・先物	1,196	14.8%	ユーロ	3.0%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.5%	
外国債券	994	4.8%	英ポンド	0.9%	残存年数	ソニーグループ	日本	1.3%	
外国リート	55	0.3%	カナダ・ドル	0.6%	債券格付別構成	日立	日本	1.2%	
外国投資証券	3	0.0%	オフショア人民元	0.5%	AAA	83.8%	東京エレクトロン	日本	1.1%
			スイス・フラン	0.4%	AA	9.5%	三井住友フィナンシャルG	日本	1.1%
			豪ドル	0.4%	A	4.7%	キーエンス	日本	1.1%
			デンマーク・クローネ	0.2%	BBB	-	三菱商事	日本	1.0%
コール・ローン、その他	3.6%		その他	0.5%	BB以下・無格付	2.0%	三井物産	日本	0.9%
合計	4,793	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	13.9%	

※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。無格付債券を2.0%保有しております。
 ※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

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2024年は5月31日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワライフスタイル75	1.00%	0.99%	0.01%

※対象期間は2022年12月1日～2023年11月30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、

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとし、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。

（2024年11月4日まで）

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。

（2024年11月5日以降）

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

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、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、受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ない、

2【換金（解約）手続等】

（2024年11月4日まで）

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。

（2024年11月5日以降）

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

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

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位（別に定める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、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

委託会社は、金融商品取引所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、上記に準じて計算される価額とします。

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。

委託会社は、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。委託会社は、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：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該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。

- ・ 公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、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.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
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4.に該当する場合を除き、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

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ができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 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5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

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られた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なります。）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なります。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期計算期間(2022年12月1日から2023年11月30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

2024年1月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 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」に掲げられているダイワライフスタイル75の2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワライフスタイル75の2023年11月30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】

ダイワライフスタイル75

(1) 【貸借対照表】

	第23期 2022年11月30日現在 金額(円)	第24期 2023年11月30日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,755,344	11,109,707
親投資信託受益証券	967,855,688	1,140,428,482
未収入金	102,000	-
流動資産合計	976,713,032	1,151,538,189
資産合計	976,713,032	1,151,538,189
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,258,474	2,137,961
未払受託者報酬	420,169	494,566
未払委託者報酬	4,307,130	5,069,815
その他未払費用	39,307	46,280
流動負債合計	6,025,080	7,748,622
負債合計	6,025,080	7,748,622
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	538,400,027	548,631,175
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	432,287,925	595,158,392
(分配準備積立金)	293,004,178	420,528,829
元本等合計	970,687,952	1,143,789,567
純資産合計	970,687,952	1,143,789,567
負債純資産合計	976,713,032	1,151,538,189

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第 23 期 自 2021 年 12 月 1 日 至 2022 年 11 月 30 日 金 額 (円)	第 24 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日 金 額 (円)
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	31,616,172	165,689,794
営業収益合計	31,616,172	165,689,795
営業費用		
支払利息	1,316	1,794
受託者報酬	870,435	924,736
委託者報酬	8,922,797	9,479,394
その他費用	81,438	86,527
営業費用合計	9,875,986	10,492,451
営業利益又は営業損失 (△)	21,740,186	155,197,344
経常利益又は経常損失 (△)	21,740,186	155,197,344
当期純利益又は当期純損失 (△)	21,740,186	155,197,344
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 (△)	△2,166,534	6,198,993
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	462,364,881	432,287,925
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,004,720	47,614,932
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	33,004,720	47,614,932
剰余金減少額又は欠損金増加額	86,988,396	33,742,816
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	86,988,396	33,742,816
分配金	※1	-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	432,287,925	595,158,392

(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 24 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 23 期 2022 年 11 月 30 日現在	第 24 期 2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首元本額	609,387,174 円	538,400,027 円
期中追加設定元本額	43,691,259 円	52,043,128 円
期中一部解約元本額	114,678,406 円	41,811,980 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	538,400,027 口	548,631,175 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 23 期 自 2021 年 12 月 1 日 至 2022 年 11 月 30 日	第 24 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 (23,906,941 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (323,094,229 円) 及び分配準備積立金 (269,097,237 円) より分配対象額は 616,098,407 円 (1 万口当たり 11,443.13 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 (148,998,883 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (356,276,234 円) 及び分配準備積立金 (271,529,946 円) より分配対象額は 776,805,063 円 (1 万口当たり 14,158.97 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 24 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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。

区分	第 24 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
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 24 期 2023 年 11 月 30 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 23 期 2022 年 11 月 30 日現在	第 24 期 2023 年 11 月 30 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	31,590,623	159,637,110
合計	31,590,623	159,637,110

(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 23 期 2022 年 11 月 30 日現在	第 24 期 2023 年 11 月 30 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 24 期
自 2022 年 12 月 1 日
至 2023 年 11 月 30 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 23 期 2022 年 11 月 30 日現在	第 24 期 2023 年 11 月 30 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1.8029 円 (18,029 円)	2.0848 円 (20,848 円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	404,489,561	689,209,762	
	日本債券インデックスマザーファンド	165,500,810	222,383,438	
	外国株式インデックスマザーファンド	32,628,804	172,185,461	
	外国債券インデックスマザーファンド	16,514,057	56,649,821	
親投資信託受益証券 合計			1,140,428,482	
合計			1,140,428,482	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月30日現在 金額(円)	2023年11月30日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,597,232,619	11,318,400,016
株式 ※2※3	199,365,246,780	278,401,688,320
派生商品評価勘定	252,089,300	145,283,800
未収入金	22,308,117	17,079,700
未収配当金	1,574,706,818	1,959,196,490
未収利息	656,842	550,242
その他未収収益 ※4	15,277,058	13,627,126
差入委託証拠金	13,280,000	53,472,780
流動資産合計	213,840,797,534	291,909,298,474
資産合計	213,840,797,534	291,909,298,474
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,899,900	1,249,200
前受金	257,225,000	129,325,000
未払金	-	20,441,625
未払解約金	298,031,030	105,766,530
受入担保金	7,992,907,366	7,260,574,102
流動負債合計	8,550,063,296	7,517,356,457
負債合計	8,550,063,296	7,517,356,457
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	147,745,976,638	166,904,971,223
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	57,544,757,600	117,486,970,794
元本等合計	205,290,734,238	284,391,942,017
純資産合計	205,290,734,238	284,391,942,017
負債純資産合計	213,840,797,534	291,909,298,474

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 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首	2021 年 12 月 1 日	2022 年 12 月 1 日
期首元本額	139,094,932,448 円	147,745,976,638 円
期中追加設定元本額	22,455,105,001 円	33,173,755,669 円
期中一部解約元本額	13,804,060,811 円	14,014,761,084 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	2,868,987,712 円	2,805,574,007 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,779,931,786 円	4,373,834,835 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	917,791 円	911,362 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,001,280 円	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)	283,754,331 円	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)	20,586,631 円	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)	571,049,427 円	414,927,130 円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	-円	335,163,355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）	461,873,574円	677,458,015円
D-I's TOPIXインデックス	29,463,339円	13,684,283円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	216,770,163円	248,960,497円
iFree TOPIXインデックス	6,249,961,543円	7,247,259,131円
iFree 8資産バランス	4,259,741,459円	4,606,729,135円
iFree 年金バランス	788,377,659円	999,756,008円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	638,850円
DCダイワ日本株式インデックス	69,173,293,158円	70,849,239,578円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,306,033,755円	3,130,739,193円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,756,270,267円	4,922,236,693円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,672,940,801円	5,657,702,841円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,732,752,455円	7,362,939,711円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	57,574,140円	54,910,538円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	70,614,624円	75,461,317円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,701,356,905円	4,784,147,220円
ダイワつみたてインデックスバランス30	11,751,428円	12,447,223円
ダイワつみたてインデックスバランス50	10,416,225円	11,579,092円
ダイワつみたてインデックスバランス70	26,427,874円	29,768,814円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	1,913,542,032円	11,296,011,297円
ダイワ世界バランスファンド40VA	79,912,966円	54,608,372円
ダイワ世界バランスファンド60VA	34,293,201円	20,876,356円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,068,797,182円	3,793,959,218円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	454,578,946円	350,586,677円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	62,260,889円	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）	104,389,988円	73,719,521円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	200,763,198円	236,956,098円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	11,679,378,364 円	12,428,283,316 円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	1,850,371,567 円	6,094,958,950 円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,206,509,611 円	3,354,073,654 円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,201,006,985 円	1,171,702,165 円
ダイワライフスタイル25	135,418,737 円	108,414,945 円
ダイワライフスタイル50	552,924,023 円	483,952,477 円
ダイワライフスタイル75	422,585,053 円	404,489,561 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)	8,706,395,569 円	8,144,168,066 円
計	147,745,976,638 円	166,904,971,223 円
2. 期末日における受益権の総数	147,745,976,638 口	166,904,971,223 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,569,896,520 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 6,909,195,160 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 902,690,000 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 1,209,560,000 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12月1日 至2023年11月30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 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 11 月 30 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 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 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	4, 104, 712, 548	△5, 884, 432, 916
合計	4, 104, 712, 548	△5, 884, 432, 916

(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 11 月 30 日現在				2023 年 11 月 30 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11月30日現在				2023年11月30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	5,560,450,000	-	5,810,800,000	250,350,000	5,273,120,000	-	5,417,280,000	144,160,000
合計	5,560,450,000	-	5,810,800,000	250,350,000	5,273,120,000	-	5,417,280,000	144,160,000

- (注)
1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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11月30日現在	2023年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3895円	1.7039円
(1万口当たり純資産額)	(13,895円)	(17,039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	4,500	3,830.00	17,235,000	
ニッスイ	116,200	737.40	85,685,880	
マルハニチロ	17,400	2,840.00	49,416,000	
雪国まいたけ	10,100	950.00	9,595,000	
カネコ種苗	3,700	1,422.00	5,261,400	
サカタのタネ	13,200	3,985.00	52,602,000	
ホクト	9,400	1,754.00	16,487,600	
ホクリヨウ	1,100	1,147.00	1,261,700	貸付株式数 400 株
ショーボンドHD	15,800	6,025.00	95,195,000	
ミライト・ワン	38,300	1,846.50	70,720,950	
タマホーム	7,300	3,480.00	25,404,000	貸付株式数 2,900 株
サンヨーホームズ	800	724.00	579,200	
日本アクア	2,600	935.00	2,431,000	
ファーストコーポレーション	1,600	738.00	1,180,800	貸付株式数 700 株
ベステラ	1,500	1,036.00	1,554,000	貸付株式数 600 株 (600 株)
キャンディル	1,100	579.00	636,900	貸付株式数 700 株
住石ホールディングス	11,400	772.00	8,800,800	貸付株式数 5,100 株
日鉄鉱業	4,600	5,650.00	25,990,000	
三井松島HLDGS	6,900	2,818.00	19,444,200	貸付株式数 2,700 株
INPEX	428,200	2,090.00	894,938,000	貸付株式数 171,000 株
石油資源開発	13,400	5,690.00	76,246,000	
K&Oエナジーグループ	5,200	2,189.00	11,382,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,300	1,023.00	1,329,900	
第一カッター興業	2,900	1,307.00	3,790,300	
明豊ファシリティワークス	2,300	805.00	1,851,500	
安藤・間	67,000	1,092.00	73,164,000	
東急建設	36,200	788.00	28,525,600	
コムシスホールディングス	37,000	3,207.00	118,659,000	
ビーアールホールディングス	16,900	359.00	6,067,100	
高松コンストラクションGP	8,600	2,637.00	22,678,200	
東建コーポレーション	3,300	8,100.00	26,730,000	
ソネック	700	952.00	666,400	
ヤマウラ	5,800	1,438.00	8,340,400	貸付株式数 200 株
オリエンタル白石	42,500	330.00	14,025,000	
大成建設	75,800	5,031.00	381,349,800	
大林組	289,700	1,247.50	361,400,750	
清水建設	229,700	971.60	223,176,520	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
飛島建設	8,300	1,299.00	10,781,700	
長谷工コーポレーション	74,300	1,818.50	135,114,550	貸付株式数 28,500 株
松井建設	7,500	775.00	5,812,500	
銭高組	700	3,850.00	2,695,000	貸付株式数 200 株
鹿島建設	179,600	2,336.50	419,635,400	
不動テトラ	5,600	2,189.00	12,258,400	
大末建設	1,800	1,352.00	2,433,600	
鉄建建設	5,800	1,953.00	11,327,400	
西松建設	15,400	3,914.00	60,275,600	
三井住友建設	60,100	398.00	23,919,800	
大豊建設	2,800	3,650.00	10,220,000	貸付株式数 700 株
佐田建設	2,800	656.00	1,836,800	
ナカノフドー建設	3,300	452.00	1,491,600	
奥村組	13,100	4,515.00	59,146,500	
東鉄工業	10,000	2,902.00	29,020,000	
イチケン	1,100	2,300.00	2,530,000	
富士ピー・エス	2,000	445.00	890,000	
浅沼組	5,900	3,695.00	21,800,500	
戸田建設	109,600	844.30	92,535,280	
熊谷組	13,500	3,400.00	45,900,000	
北野建設	800	3,100.00	2,480,000	
植木組	1,300	1,456.00	1,892,800	
矢作建設	11,000	1,286.00	14,146,000	
ピーエス三菱	10,200	941.00	9,598,200	
日本ハウスHLDGS	17,100	326.00	5,574,600	貸付株式数 6,800 株
大東建託	29,800	16,300.00	485,740,000	
新日本建設	11,400	1,111.00	12,665,400	
東亜道路	3,200	6,690.00	21,408,000	
日本道路	9,500	1,897.00	18,021,500	
東亜建設	6,200	3,575.00	22,165,000	貸付株式数 2,400 株
日本国土開発	22,800	589.00	13,429,200	
若築建設	2,800	2,946.00	8,248,800	
東洋建設	20,300	1,330.00	26,999,000	
五洋建設	114,900	810.40	93,114,960	
世紀東急	10,400	1,664.00	17,305,600	貸付株式数 4,100 株
福田組	3,000	5,220.00	15,660,000	貸付株式数 1,200 株
日本ドライケミカル	1,100	2,578.00	2,835,800	貸付株式数 100 株
住友林業	70,000	3,774.00	264,180,000	
日本基礎技術	2,700	450.00	1,215,000	
巴コーポレーション	5,700	560.00	3,192,000	
大和ハウス	224,000	4,199.00	940,576,000	
ライト工業	16,700	1,980.00	33,066,000	
積水ハウス	245,700	3,029.00	744,225,300	
日特建設	7,700	1,028.00	7,915,600	
北陸電気工事	5,500	945.00	5,197,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユアテック	17,700	1,003.00	17,753,100	
日本リーテック	6,300	1,257.00	7,919,100	
四電工	3,400	2,908.00	9,887,200	
中電工	12,500	2,431.00	30,387,500	
関電工	50,700	1,328.00	67,329,600	
きんでん	57,000	2,219.50	126,511,500	
東京エネシス	8,100	965.00	7,816,500	
トーエネック	2,600	4,245.00	11,037,000	
住友電設	7,700	2,557.00	19,688,900	
日本電設工業	15,200	2,024.00	30,764,800	
エクシオグループ	40,700	3,118.00	126,902,600	
新日本空調	5,200	2,235.00	11,622,000	
九電工	17,500	4,663.00	81,602,500	
三機工業	17,500	1,750.00	30,625,000	
日揮ホールディングス	80,200	1,661.50	133,252,300	
中外炉工業	2,700	2,239.00	6,045,300	
ヤマト	3,700	941.00	3,481,700	
太平電業	5,000	3,875.00	19,375,000	
高砂熱学	21,700	2,999.00	65,078,300	
三晃金属	600	4,700.00	2,820,000	
NEC ネットズエスアイ	32,300	2,159.00	69,735,700	
朝日工業社	3,800	2,798.00	10,632,400	
明星工業	15,700	1,120.00	17,584,000	
大気社	9,300	4,230.00	39,339,000	
ダイダン	10,600	1,480.00	15,688,000	
日比谷総合設備	5,800	2,358.00	13,676,400	
ニッポン	24,600	2,274.00	55,940,400	
日清製粉G本社	75,300	2,048.50	154,252,050	
日東富士製粉	1,500	4,720.00	7,080,000	
昭和産業	8,000	3,060.00	24,480,000	
鳥越製粉	4,600	715.00	3,289,000	貸付株式数 1,800 株
中部飼料	11,600	1,085.00	12,586,000	
フィード・ワン	12,200	792.00	9,662,400	
東洋精糖	900	2,018.00	1,816,200	
日本甜菜糖	4,900	2,013.00	9,863,700	
DM三井製糖ホールディ	8,200	3,020.00	24,764,000	
塩水港精糖	6,700	234.00	1,567,800	
ウェルネオシュガー	4,200	2,064.00	8,668,800	貸付株式数 1,400 株
LIFULL	29,000	196.00	5,684,000	貸付株式数 10,900 株
MIXI	18,200	2,417.00	43,989,400	
ジェイエイシーリクルート メント	7,600	2,661.00	20,223,600	
日本M&Aセンターホール デ	135,300	685.20	92,707,560	
メンバーズ	2,900	1,100.00	3,190,000	貸付株式数 900 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
中広	700	412.00	288,400	
UTグループ	11,200	2,215.00	24,808,000	
アイティメディア	3,200	972.00	3,110,400	貸付株式数 1,200株
E・Jホールディングス	5,000	1,605.00	8,025,000	貸付株式数 1,900株
オープンアップグループ	25,500	2,159.00	55,054,500	貸付株式数 9,600株
コシダカホールディングス	25,400	1,043.00	26,492,200	
アルトナー	2,000	1,807.00	3,614,000	貸付株式数 500株
パソナグループ	10,200	2,345.00	23,919,000	
CDS	1,200	1,732.00	2,078,400	
リンクアンドモチベーション	24,400	586.00	14,298,400	貸付株式数 9,100株
エス・エム・エス	29,700	2,810.00	83,457,000	
サニーサイドアップG	1,400	619.00	866,600	貸付株式数 100株
パーソルホールディングス	864,100	254.80	220,172,680	
リニカル	3,000	530.00	1,590,000	
クックパッド	23,100	119.00	2,748,900	貸付株式数 1,700株
エスクリ	1,900	283.00	537,700	貸付株式数 1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディング	2,400	678.00	1,627,200	貸付株式数 900株
森永製菓	17,500	5,277.00	92,347,500	
中村屋	2,100	3,070.00	6,447,000	貸付株式数 600株
江崎グリコ	23,400	4,079.00	95,448,600	
名糖産業	3,400	1,635.00	5,559,000	貸付株式数 1,200株
井村屋グループ	5,000	2,319.00	11,595,000	
不二家	5,600	2,501.00	14,005,600	貸付株式数 2,200株
山崎製パン	54,500	3,235.00	176,307,500	
第一屋製パン	1,000	695.00	695,000	
モロゾフ	2,700	3,885.00	10,489,500	
亀田製菓	4,700	3,885.00	18,259,500	
寿スピリッツ	38,400	2,348.00	90,163,200	
カルビー	37,300	2,769.00	103,283,700	
森永乳業	29,600	2,760.00	81,696,000	
六甲バター	6,200	1,384.00	8,580,800	貸付株式数 2,300株
ヤクルト	116,300	3,303.00	384,138,900	
明治ホールディングス	99,800	3,423.00	341,615,400	
雪印メグミルク	19,800	2,163.00	42,827,400	
プリマハム	11,100	2,250.00	24,975,000	
日本ハム	35,100	4,394.00	154,229,400	
林兼産業	1,900	599.00	1,138,100	貸付株式数 600株
丸大食品	8,400	1,617.00	13,582,800	
S Foods	9,000	3,205.00	28,845,000	
柿安本店	3,100	2,476.00	7,675,600	貸付株式数 800株
伊藤ハム米久HLDGS	12,500	3,950.00	49,375,000	
学情	4,300	2,021.00	8,690,300	貸付株式数 200株
スタジオアリス	4,200	2,064.00	8,668,800	貸付株式数 1,600株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
クロスキャット	5,200	1,127.00	5,860,400	貸付株式数 500株
シミックホールディングス	4,100	2,644.00	10,840,400	
エプコ	1,300	810.00	1,053,000	貸付株式数 100株
システナ	125,500	296.00	37,148,000	
N J S	1,800	2,827.00	5,088,600	貸付株式数 700株
デジタルアーツ	5,200	4,815.00	25,038,000	
日鉄ソリューションズ	14,100	4,645.00	65,494,500	
総合警備保障	141,800	856.80	121,494,240	
キューブシステム	4,400	1,112.00	4,892,800	貸付株式数 1,800株
いちご	93,900	351.00	32,958,900	
日本駐車場開発	86,000	204.00	17,544,000	
コア	3,700	1,779.00	6,582,300	
カカクコム	56,100	1,677.50	94,107,750	
アイロムグループ	3,400	2,031.00	6,905,400	貸付株式数 1,100株
セントケア・ホールディング	6,100	936.00	5,709,600	貸付株式数 2,000株
サイネックス	800	838.00	670,400	
ルネサンス	6,600	865.00	5,709,000	貸付株式数 2,600株
ディップ	13,000	3,170.00	41,210,000	
S B Sホールディングス	7,300	2,507.00	18,301,100	
デジタルホールディングス	4,500	1,265.00	5,692,500	
新日本科学	7,700	1,647.00	12,681,900	貸付株式数 3,300株
キャリアデザインセンター	1,000	2,015.00	2,015,000	
ベネフィット・ワン	29,500	1,515.00	44,692,500	
エムスリー	167,700	2,445.50	410,110,350	
ツカダ・グローバルHOLD	3,100	384.00	1,190,400	貸付株式数 600株
プラス	500	698.00	349,000	貸付株式数 200株
アウトソーシング	54,500	1,200.00	65,400,000	
ウェルネット	3,600	565.00	2,034,000	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	3,800	2,711.00	10,301,800	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	30,100	1,504.00	45,270,400	
博報堂DYHLDGS	108,300	1,115.50	120,808,650	
ぐるなび	16,000	294.00	4,704,000	
タカミヤ	11,400	456.00	5,198,400	
ジャパンベストレスキュー	4,100	997.00	4,087,700	
ファンコミュニケーションズ	11,900	417.00	4,962,300	
ライク	3,100	1,364.00	4,228,400	貸付株式数 100株
A o b a - B B T	1,700	424.00	720,800	貸付株式数 800株
エスプール	24,400	397.00	9,686,800	貸付株式数 9,700株
WDBホールディングス	4,300	2,313.00	9,945,900	
手間いらず	1,400	2,496.00	3,494,400	
ティア	2,700	460.00	1,242,000	貸付株式数 1,100株
CDG	500	1,249.00	624,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アドウェイズ	11,700	551.00	6,446,700	貸付株式数 4,600 株
バリューコマース	7,500	1,386.00	10,395,000	
インフォマート	88,100	441.00	38,852,100	
サッポロホールディングス	26,800	5,766.00	154,528,800	
アサヒグループホールディングン	187,900	5,455.00	1,024,994,500	貸付株式数 75,000 株
麒麟HD	338,900	2,087.00	707,284,300	貸付株式数 135,200 株
宝ホールディングス	55,700	1,215.00	67,675,500	
オエノンホールディングス	24,500	374.00	9,163,000	
養命酒	2,800	1,873.00	5,244,400	貸付株式数 700 株
コカ・コーラボトラーズJHD	63,900	2,025.50	129,429,450	
サントリー食品インター	57,300	4,648.00	266,330,400	
ダイドーグループHD	4,700	5,980.00	28,106,000	貸付株式数 1,500 株
伊藤園	27,600	4,495.00	124,062,000	
キーコーヒー	9,300	2,068.00	19,232,400	
ユニカフェ	1,700	957.00	1,626,900	貸付株式数 700 株
ジャパンフーズ	900	1,169.00	1,052,100	
日清オイリオグループ	11,500	4,185.00	48,127,500	
不二製油グループ	19,000	2,322.00	44,118,000	
かどや製油	600	3,560.00	2,136,000	
J-オイルミルズ	9,600	1,973.00	18,940,800	
ローソン	18,600	7,321.00	136,170,600	
サンエー	6,600	4,600.00	30,360,000	貸付株式数 1,300 株
カワチ薬品	6,800	2,551.00	17,346,800	
エービーシー・マート	38,200	2,440.50	93,227,100	
ハードオフコーポレーション	2,700	1,530.00	4,131,000	
高千穂交易	2,400	3,400.00	8,160,000	貸付株式数 1,000 株
アスクル	18,000	2,159.00	38,862,000	貸付株式数 7,200 株
ゲオホールディングス	9,800	2,347.00	23,000,600	貸付株式数 3,200 株
アダストリア	10,500	3,800.00	39,900,000	貸付株式数 3,600 株
ジーフット	3,800	288.00	1,094,400	貸付株式数 1,200 株
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	600	688.00	412,800	貸付株式数 200 株
オルパヘルスケアHLDGS	700	1,757.00	1,229,900	
伊藤忠食品	2,000	7,160.00	14,320,000	
くら寿司	10,200	3,675.00	37,485,000	貸付株式数 2,800 株
キャンドゥ	3,100	2,619.00	8,118,900	貸付株式数 1,100 株
エレマテック	7,800	1,767.00	13,782,600	
IKホールディングス	1,500	340.00	510,000	貸付株式数 300 株
パルグループHLDGS	17,100	2,336.00	39,945,600	
エディオン	34,500	1,485.00	51,232,500	貸付株式数 13,800 株
あらた	6,700	6,250.00	41,875,000	
サーラコーポレーション	18,200	711.00	12,940,200	貸付株式数 7,000 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ワッツ	2,300	578.00	1,329,400	貸付株式数 1,000株
トーメンデバイス	1,300	5,300.00	6,890,000	
ハローズ	3,900	4,145.00	16,165,500	貸付株式数 400株
J Pホールディングス	21,700	391.00	8,484,700	貸付株式数 1,200株
フジオフードG本社	9,700	1,444.00	14,006,800	貸付株式数 3,800株 (100株)
あみやき亭	2,100	3,660.00	7,686,000	貸付株式数 600株
東京エレクトロデバイス	8,700	4,875.00	42,412,500	
ひらまつ	11,300	248.00	2,802,400	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	15,000	1,126.00	16,890,000	貸付株式数 5,400株
双日	97,300	3,293.00	320,408,900	
アルフレッサホールディン グス	87,700	2,377.50	208,506,750	
大黒天物産	2,700	6,160.00	16,632,000	貸付株式数 1,000株
ハニーズホールディングス	6,900	1,672.00	11,536,800	貸付株式数 2,600株
ファーマライズHD	1,000	640.00	640,000	貸付株式数 500株
キッコーマン	53,900	9,065.00	488,603,500	
味の素	193,200	5,526.00	1,067,623,200	
ブルドックソース	4,400	2,092.00	9,204,800	
キューピー	43,900	2,580.00	113,262,000	
ハウス食品G本社	28,100	3,229.00	90,734,900	
カゴメ	35,100	3,177.00	111,512,700	
焼津水産化工	2,000	1,170.00	2,340,000	
アリアケジャパン	8,100	4,615.00	37,381,500	
ピエトロ	600	1,823.00	1,093,800	
エバラ食品工業	2,000	2,834.00	5,668,000	貸付株式数 200株
やまみ	500	3,105.00	1,552,500	
ニチレイ	37,300	3,224.00	120,255,200	
横浜冷凍	23,900	1,109.00	26,505,100	
東洋水産	41,100	7,870.00	323,457,000	
イトアンドHLDGS	3,700	2,045.00	7,566,500	貸付株式数 1,400株 (100株)
大冷	800	1,928.00	1,542,400	
ヨシムラ・フード・HLD GS	3,700	1,114.00	4,121,800	貸付株式数 1,800株
日清食品HD	28,600	14,665.00	419,419,000	
永谷園ホールディングス	4,100	2,169.00	8,892,900	
一正蒲鉾	2,200	738.00	1,623,600	貸付株式数 300株
フジッコ	8,600	1,936.00	16,649,600	
ロックフィールド	9,300	1,591.00	14,796,300	貸付株式数 1,500株
日本たばこ産業	494,200	3,801.00	1,878,454,200	貸付株式数 197,300株
ケンコーマヨネーズ	5,700	1,615.00	9,205,500	
わらべや日洋HD	5,500	3,485.00	19,167,500	
なとり	5,300	2,035.00	10,785,500	
イフジ産業	900	1,342.00	1,207,800	貸付株式数 200株
ファーマフーズ	11,700	1,283.00	15,011,100	貸付株式数 4,600株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北の達人コーポ	34,800	208.00	7,238,400	貸付株式数 13,900株 (1,300株)
ユーグレナ	50,500	746.00	37,673,000	貸付株式数 20,200株
紀文食品	7,200	1,152.00	8,294,400	貸付株式数 100株
ピクルスホールディングス	4,900	1,207.00	5,914,300	貸付株式数 1,200株
スター・マイカ・HLDG S	9,400	607.00	5,705,800	
SREホールディングス	3,500	2,774.00	9,709,000	貸付株式数 1,500株
ADワークスグループ	11,600	246.00	2,853,600	貸付株式数 2,800株
片倉工業	7,600	1,677.00	12,745,200	貸付株式数 2,600株
グンゼ	5,900	4,800.00	28,320,000	
ヒューリック	189,800	1,468.00	278,626,400	貸付株式数 75,700株
神栄	700	1,781.00	1,246,700	
ラサ商事	3,100	1,509.00	4,677,900	貸付株式数 900株
アルペン	7,100	1,950.00	13,845,000	貸付株式数 2,800株
ハブ	1,500	720.00	1,080,000	
ラクーンホールディングス	6,900	681.00	4,698,900	貸付株式数 2,600株
クオールホールディングス	12,000	1,706.00	20,472,000	
アルコニックス	11,600	1,320.00	15,312,000	
神戸物産	67,600	3,904.00	263,910,400	
ソリトンシステムズ	4,200	1,276.00	5,359,200	
ジンズホールディングス	5,200	4,695.00	24,414,000	貸付株式数 2,000株
ビックカメラ	46,400	1,221.00	56,654,400	貸付株式数 18,000株
DCMホールディングス	46,100	1,279.00	58,961,900	
ペッパーフードサービス	19,900	109.00	2,169,100	貸付株式数 200株
ハイパー	1,100	346.00	380,600	貸付株式数 400株
Monotaro	123,800	1,493.00	184,833,400	
東京一番フーズ	1,100	501.00	551,100	
DDグループ	3,100	1,333.00	4,132,300	貸付株式数 1,200株
あいホールディングス	14,000	2,472.00	34,608,000	
ディービーエックス	1,300	1,017.00	1,322,100	
きちりホールディングス	1,100	1,025.00	1,127,500	貸付株式数 500株
J. フロント リテイ リング	100,300	1,354.50	135,856,350	
ドトール・日レスHD	15,500	2,195.00	34,022,500	
マツキヨココカラ&カンパ ニー	158,900	2,553.50	405,751,150	
ブロンコビリー	5,100	3,160.00	16,116,000	貸付株式数 1,900株
ZOZO	57,700	3,125.00	180,312,500	
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,263.00	5,304,600	貸付株式数 1,600株
物語コーポレーション	14,600	3,880.00	56,648,000	
三越伊勢丹HD	147,200	1,671.00	245,971,200	
東洋紡	35,700	1,052.00	37,556,400	
ユニチカ	26,900	183.00	4,922,700	
富士紡ホールディングス	3,600	3,690.00	13,284,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日清紡ホールディングス	62,700	1,086.50	68,123,550	
倉敷紡績	6,200	2,557.00	15,853,400	
ダイワボウHD	38,700	2,909.50	112,597,650	
シキボウ	3,700	1,093.00	4,044,100	
日東紡績	10,500	4,495.00	47,197,500	
トヨタ紡織	34,800	2,550.00	88,740,000	
マクニカホールディングス	20,700	7,313.00	151,379,100	
H a m e e	3,000	1,014.00	3,042,000	
マーケットエンタープライズ	500	1,202.00	601,000	貸付株式数 200株
ラクト・ジャパン	3,400	1,951.00	6,633,400	貸付株式数 1,300株
ウエルシアHD	45,300	2,584.00	117,055,200	貸付株式数 18,100株
クリエイトSDH	14,400	3,060.00	44,064,000	貸付株式数 5,100株
グリムス	3,700	2,106.00	7,792,200	
バイタルKSKHD	13,200	1,071.00	14,137,200	
八洲電機	7,000	1,271.00	8,897,000	貸付株式数 200株
メディアスホールディングス	5,500	772.00	4,246,000	
レスターホールディングス	7,400	2,683.00	19,854,200	
ジオリーブグループ	1,100	1,245.00	1,369,500	貸付株式数 500株
丸善CHI HD	5,600	329.00	1,842,400	
大光	2,300	638.00	1,467,400	貸付株式数 1,100株
OCHIホールディングス	1,100	1,425.00	1,567,500	
TOKAIホールディングス	47,300	941.00	44,509,300	
黒谷	1,300	583.00	757,900	
ミサワ	1,000	634.00	634,000	
ティーライフ	700	1,417.00	991,900	貸付株式数 100株
C o m i n i x	900	789.00	710,100	
エー・ピーホールディングス	1,100	903.00	993,300	貸付株式数 500株
三洋貿易	9,900	1,313.00	12,998,700	
チムニー	1,500	1,387.00	2,080,500	貸付株式数 700株
シュッピン	7,900	1,238.00	9,780,200	貸付株式数 3,100株
ビューティガレージ	2,700	2,520.00	6,804,000	
オイシックス・ラ・大地	11,700	1,393.00	16,298,100	貸付株式数 4,600株
ウイン・パートナーズ	5,500	1,192.00	6,556,000	貸付株式数 500株
ネクステージ	19,900	2,289.00	45,551,100	貸付株式数 7,500株
ジョイフル本田	25,400	1,792.00	45,516,800	貸付株式数 1,500株
鳥貴族ホールディングス	3,200	2,838.00	9,081,600	貸付株式数 1,200株 (100株)
ホットランド	6,600	1,972.00	13,015,200	貸付株式数 2,500株
すかいらくHD	119,400	2,180.50	260,351,700	貸付株式数 47,700株
SFPホールディングス	4,800	2,233.00	10,718,400	貸付株式数 1,900株
綿半ホールディングス	6,600	1,370.00	9,042,000	
日本毛織	21,800	1,295.00	28,231,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダイトウボウ	7,300	88.00	642,400	貸付株式数 5,300 株
トーア紡コーポレーション	1,800	460.00	828,000	貸付株式数 400 株
ダイドーリミテッド	6,600	400.00	2,640,000	貸付株式数 3,700 株
ヨシックスホールディングス	1,600	3,040.00	4,864,000	
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	24,200	1,011.00	24,466,200	貸付株式数 10,900 株
野村不動産HLDGS	45,300	3,604.00	163,261,200	
三重交通グループHD	17,100	572.00	9,781,200	貸付株式数 2,700 株
サムティ	13,000	2,342.00	30,446,000	貸付株式数 5,000 株
地主	6,200	2,306.00	14,297,200	貸付株式数 2,300 株
プレサンスコーポレーショ ン	12,900	1,504.00	19,401,600	貸付株式数 5,100 株
フィル・カンパニー	1,300	596.00	774,800	貸付株式数 500 株
ハウコム	700	890.00	623,000	貸付株式数 300 株
JPMC	4,600	1,123.00	5,165,800	
サンセイランディック	1,300	1,062.00	1,380,600	貸付株式数 500 株
エストラスト	500	641.00	320,500	貸付株式数 200 株
フージャースHD	12,500	1,058.00	13,225,000	
オープンハウスグループ	29,800	4,128.00	123,014,400	
東急不動産HD	244,600	914.00	223,564,400	
飯田GHD	78,000	2,210.00	172,380,000	
イーランド	700	1,499.00	1,049,300	貸付株式数 300 株
帝国繊維	9,300	2,029.00	18,869,700	貸付株式数 3,600 株
日本コークス工業	83,800	122.00	10,223,600	
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	677.00	2,640,300	貸付株式数 1,500 株
ミタチ産業	1,200	1,158.00	1,389,600	貸付株式数 600 株
BEENOS	3,600	1,495.00	5,382,000	貸付株式数 1,600 株
あさひ	8,100	1,317.00	10,667,700	
日本調剤	5,900	1,288.00	7,599,200	貸付株式数 200 株
コスモス薬品	8,600	15,650.00	134,590,000	貸付株式数 3,400 株
シップヘルスケアHD	31,400	2,087.50	65,547,500	
トーエル	2,100	702.00	1,474,200	貸付株式数 900 株
ソフトクリエイトHD	6,800	1,695.00	11,526,000	
セブン&アイ・HLDGS	301,100	5,495.00	1,654,544,500	
クリエイト・レストラン ツ・ホール	59,100	1,045.00	61,759,500	貸付株式数 23,900 株
明治電機工業	3,400	1,430.00	4,862,000	
ツルハホールディングス	18,300	12,440.00	227,652,000	
デリカフーズHLDGS	2,400	594.00	1,425,600	
スターティアホールディン グス	1,200	1,334.00	1,600,800	貸付株式数 400 株
サンマルクホールディン グス	6,900	1,998.00	13,786,200	
フェリシモ	1,100	913.00	1,004,300	貸付株式数 400 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トリドールホールディングス	24,400	4,151.00	101,284,400	貸付株式数 6,400株
帝人	79,500	1,345.50	106,967,250	
東レ	554,300	767.10	425,203,530	
クラレ	120,500	1,504.50	181,292,250	
旭化成	559,600	1,026.50	574,429,400	
TOKYO BASE	10,400	271.00	2,818,400	貸付株式数 4,100株
稲葉製作所	4,400	1,486.00	6,538,400	貸付株式数 1,700株
宮地エンジニアリングG	4,300	3,185.00	13,695,500	貸付株式数 1,600株
トーカロ	24,600	1,438.00	35,374,800	
アルファCO	1,700	1,483.00	2,521,100	
SUMCO	151,400	2,216.50	335,578,100	
川田テクノロジーズ	2,000	7,000.00	14,000,000	
RS TECHNOLOGIES	5,700	2,862.00	16,313,400	
ジェイテックコーポレーション	600	2,040.00	1,224,000	貸付株式数 200株
信和	3,100	740.00	2,294,000	貸付株式数 1,100株
ビーロット	3,200	1,007.00	3,222,400	貸付株式数 1,200株
ファーストブラザーズ	1,000	1,008.00	1,008,000	貸付株式数 400株 (400株)
AND DOホールディングス	4,900	1,045.00	5,120,500	貸付株式数 1,700株
シーアールイー	4,500	1,576.00	7,092,000	貸付株式数 400株 (200株)
ケイアイスター不動産	3,900	3,490.00	13,611,000	貸付株式数 1,500株
アグレ都市デザイン	800	1,509.00	1,207,200	
ジェイ・エス・ビー	4,000	2,561.00	10,244,000	
ロードスターキャピタル	5,300	2,200.00	11,660,000	
テンポイノベーション	1,300	1,114.00	1,448,200	貸付株式数 600株
グローバルリンクマネジメント	800	2,471.00	1,976,800	貸付株式数 400株
フェイスネットワーク	1,200	1,390.00	1,668,000	貸付株式数 600株
霞ヶ関キャピタル	1,900	9,120.00	17,328,000	
住江織物	900	2,247.00	2,022,300	
日本フェルト	2,700	423.00	1,142,100	
イチカワ	600	1,627.00	976,200	
エコナックホールディングス	4,300	143.00	614,900	
日東製網	500	1,472.00	736,000	貸付株式数 100株
芦森工業	900	2,202.00	1,981,800	
アツギ	3,100	467.00	1,447,700	
ウイルプラスHLDGS	800	1,090.00	872,000	貸付株式数 400株
JMホールディングス	6,500	2,077.00	13,500,500	
コマダホールディングス	21,300	2,767.00	58,937,100	
サツドラホールディングス	2,100	771.00	1,619,100	貸付株式数 1,100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アレンザホールディングス	6,400	1,014.00	6,489,600	貸付株式数 700株
串カツ田中HLDGS	2,300	1,625.00	3,737,500	貸付株式数 900株
バロックジャパン	6,800	820.00	5,576,000	貸付株式数 2,700株
クスリのアオキHLDGS	23,400	3,422.00	80,074,800	
ダイニック	1,400	725.00	1,015,000	
共和レザー	2,600	728.00	1,892,800	
ピーバンドットコム	600	378.00	226,800	貸付株式数 200株
力の源HD	3,900	1,568.00	6,115,200	貸付株式数 1,500株
FOOD&LIFE COMPANY	46,600	2,863.00	133,415,800	
アセンテック	3,400	575.00	1,955,000	貸付株式数 100株
セーレン	15,900	2,320.00	36,888,000	貸付株式数 6,300株
ソトー	1,400	705.00	987,000	貸付株式数 100株
東海染工	400	942.00	376,800	
小松マテーレ	12,000	780.00	9,360,000	
ワコールホールディングス	16,900	3,255.00	55,009,500	
ホギメディカル	10,900	3,425.00	37,332,500	
クラウドディアHLDGS	1,000	407.00	407,000	貸付株式数 500株
TSIホールディングス	27,800	774.00	21,517,200	貸付株式数 9,800株
マツオカコーポレーション	1,400	1,518.00	2,125,200	
ワールド	11,700	1,630.00	19,071,000	
TIS	90,600	3,127.00	283,306,200	
テクミラホールディングス	2,100	471.00	989,100	貸付株式数 700株
グリー	22,100	568.00	12,552,800	
GMOペパボ	1,000	1,351.00	1,351,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	51,800	1,810.50	93,783,900	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	4,100	4,805.00	19,700,500	
ボルテージ	1,300	263.00	341,900	貸付株式数 600株
電算	500	1,518.00	759,000	貸付株式数 200株
AGS	1,900	750.00	1,425,000	
ファインデックス	6,600	952.00	6,283,200	
ブレインパッド	6,200	1,024.00	6,348,800	貸付株式数 2,200株
KL a b	15,300	278.00	4,253,400	貸付株式数 5,700株
ポールトゥウィンホールディングン	14,100	535.00	7,543,500	
ネクソン	185,000	3,198.00	591,630,000	
アイスタイル	24,500	438.00	10,731,000	貸付株式数 9,800株 (4,000株)
エムアップホールディングス	10,100	1,018.00	10,281,800	
エイチーム	4,900	684.00	3,351,600	
エニグモ	10,600	383.00	4,059,800	貸付株式数 3,800株
テクノスジャパン	4,100	638.00	2,615,800	
enish	4,000	181.00	724,000	貸付株式数 1,600株
コロプラ	32,000	609.00	19,488,000	
オルトプラス	3,800	165.00	627,000	貸付株式数 1,500株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ブロードリーフ	39,300	566.00	22,243,800	
クロス・マーケティングG	2,700	567.00	1,530,900	貸付株式数 1,000株
デジタルハーツHLDGS	5,200	1,000.00	5,200,000	貸付株式数 2,000株
メディアドゥ	3,700	1,516.00	5,609,200	
じげん	24,100	538.00	12,965,800	
ブイキューブ	9,900	331.00	3,276,900	貸付株式数 3,800株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,000	519.00	519,000	貸付株式数 600株
サイバーリンクス	1,800	729.00	1,312,200	貸付株式数 1,000株
ディー・エル・イー	4,300	223.00	958,900	
フィックスターズ	9,300	1,356.00	12,610,800	
CARTA HOLDINGS	3,900	1,312.00	5,116,800	貸付株式数 1,400株
オプティム	8,400	846.00	7,106,400	貸付株式数 2,600株
セレス	3,300	915.00	3,019,500	貸付株式数 1,300株
SHIFT	5,500	34,440.00	189,420,000	
特種東海製紙	4,500	3,715.00	16,717,500	
ティーガイア	8,600	1,835.00	15,781,000	
セック	900	4,345.00	3,910,500	
テクマトリックス	15,100	1,735.00	26,198,500	
プロシップ	4,000	1,321.00	5,284,000	貸付株式数 1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	21,500	2,292.00	49,278,000	
GMOペイメントゲートウェイ	16,500	8,707.00	143,665,500	
ザッパラス	1,200	488.00	585,600	貸付株式数 700株
システムリサーチ	2,800	3,590.00	10,052,000	貸付株式数 900株
インターネットイニシアティブ	39,600	2,657.00	105,217,200	
さくらインターネット	9,300	1,791.00	16,656,300	貸付株式数 3,700株
ヴィンクス	1,100	2,015.00	2,216,500	
GMOグローバルサインHD	2,500	2,491.00	6,227,500	貸付株式数 1,000株
SRAホールディングス	4,200	3,595.00	15,099,000	
システムインテグレータ	1,300	401.00	521,300	
朝日ネット	8,800	627.00	5,517,600	
eBASE	11,700	806.00	9,430,200	
アバントグループ	10,400	1,488.00	15,475,200	
アドソル日進	3,500	1,606.00	5,621,000	
ODKソリューションズ	900	575.00	517,500	貸付株式数 600株
フリービット	4,300	1,189.00	5,112,700	
コムチュア	11,900	2,015.00	23,978,500	
サイバーコム	700	1,900.00	1,330,000	
アステリア	6,500	727.00	4,725,500	貸付株式数 2,400株
アイル	3,900	3,570.00	13,923,000	
王子ホールディングス	344,500	549.20	189,199,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本製紙	46,600	1,337.00	62,304,200	
三菱製紙	6,200	530.00	3,286,000	貸付株式数 2,400株
北越コーポレーション	40,600	1,409.00	57,205,400	貸付株式数 16,200株
中越パルプ	1,900	1,726.00	3,279,400	貸付株式数 300株
巴川製紙	1,300	744.00	967,200	貸付株式数 700株
大王製紙	36,400	1,047.50	38,129,000	
阿波製紙	1,200	400.00	480,000	貸付株式数 400株
マークラインズ	4,500	2,765.00	12,442,500	
メディカル・データ・ビジ	9,800	694.00	6,801,200	貸付株式数 4,400株
g u m i	12,200	416.00	5,075,200	貸付株式数 4,800株
ショーケース	1,000	399.00	399,000	貸付株式数 500株
モバイルファクトリー	1,000	725.00	725,000	貸付株式数 400株
テラスカイ	3,600	1,566.00	5,637,600	貸付株式数 1,400株
デジタル・インフォメーシ ョン	4,800	1,636.00	7,852,800	
P C Iホールディングス	1,800	1,039.00	1,870,200	貸付株式数 200株
アイビーシー	700	503.00	352,100	貸付株式数 200株
ネオジャパン	2,700	1,038.00	2,802,600	貸付株式数 900株
P R T I M E S	1,700	1,716.00	2,917,200	貸付株式数 600株
ラクス	39,100	2,665.00	104,201,500	
ランドコンピュータ	2,200	928.00	2,041,600	
ダブルスタンダード	2,500	1,504.00	3,760,000	貸付株式数 1,200株
オープンドア	4,900	723.00	3,542,700	貸付株式数 2,200株
マイネット	1,400	307.00	429,800	貸付株式数 600株
アカツキ	4,000	2,312.00	9,248,000	
ベネフィットジャパン	300	1,199.00	359,700	貸付株式数 200株
U B I C O Mホールディン グス	2,600	1,709.00	4,443,400	
カナミックネットワーク	8,800	388.00	3,414,400	
ノムラシステムコーポレー ション	4,900	118.00	578,200	貸付株式数 2,800株
レンゴー	75,200	935.50	70,349,600	
トーモク	4,700	2,174.00	10,217,800	
ザ・バック	6,100	3,215.00	19,611,500	貸付株式数 2,400株
チェンジホールディングス	18,000	1,560.00	28,080,000	
シンクロ・フード	2,900	721.00	2,090,900	貸付株式数 1,300株
オークネット	3,300	1,841.00	6,075,300	貸付株式数 1,500株
キャピタル・アセット・プ ラン	900	724.00	651,600	
セグエグループ	1,400	916.00	1,282,400	貸付株式数 500株
エイトレッド	700	1,378.00	964,600	
マクロミル	16,300	792.00	12,909,600	
ビーグリー	900	1,214.00	1,092,600	
オロ	3,000	2,494.00	7,482,000	貸付株式数 1,200株
ユーザーローカル	3,000	1,722.00	5,166,000	貸付株式数 1,200株
テモナ	1,000	239.00	239,000	貸付株式数 200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニーズウェル	2,500	729.00	1,822,500	貸付株式数 1,200株
マネーフワード	18,400	4,542.00	83,572,800	貸付株式数 6,700株
サインポスト	1,800	453.00	815,400	貸付株式数 800株
レゾナック・ホールディング	79,900	2,760.00	220,524,000	
住友化学	613,600	377.50	231,634,000	
住友精化	3,900	5,050.00	19,695,000	
日産化学	38,900	5,393.00	209,787,700	
ラサ工業	3,200	2,132.00	6,822,400	
クレハ	6,000	8,650.00	51,900,000	
多木化学	3,200	3,160.00	10,112,000	貸付株式数 1,200株
テイカ	7,100	1,325.00	9,407,500	
石原産業	13,700	1,373.00	18,810,100	
片倉コープアグリ	1,100	1,139.00	1,252,900	貸付株式数 400株
日本曹達	9,800	5,340.00	52,332,000	
東ソー	110,500	1,967.00	217,353,500	
トクヤマ	26,700	2,401.00	64,106,700	
セントラル硝子	8,800	2,719.00	23,927,200	
東亜合成	41,400	1,360.00	56,304,000	
大阪ソーダ	5,800	9,720.00	56,376,000	貸付株式数 2,300株
関東電化	16,000	830.00	13,280,000	
SUN ASTERISK	5,900	997.00	5,882,300	貸付株式数 2,300株
デンカ	30,100	2,645.00	79,614,500	
イビデン	43,500	7,071.00	307,588,500	
信越化学	750,000	5,212.00	3,909,000,000	
日本カーバイド	3,100	1,515.00	4,696,500	
電算システムHD	3,700	2,779.00	10,282,300	
堺化学	6,300	1,885.00	11,875,500	
第一稀元素化学工	9,000	995.00	8,955,000	貸付株式数 800株
エア・ウォーター	78,000	1,941.50	151,437,000	
日本酸素HLDS	80,200	3,883.00	311,416,600	
日本化学工業	3,000	2,029.00	6,087,000	
東邦アセチレン	1,000	1,877.00	1,877,000	
日本パーカラライジング	36,900	1,154.00	42,582,600	貸付株式数 1,900株
高圧ガス	11,800	809.00	9,546,200	
チタン工業	600	1,288.00	772,800	貸付株式数 200株
四国化成ホールディング	10,600	1,747.00	18,518,200	
戸田工業	1,900	1,632.00	3,100,800	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	4,500	3,245.00	14,602,500	
保土谷化学	2,600	3,600.00	9,360,000	
日本触媒	12,600	5,351.00	67,422,600	
大日精化	5,800	2,217.00	12,858,600	
カネカ	21,000	3,713.00	77,973,000	
協和キリン	100,100	2,437.00	243,943,700	
APIER GROUP	28,300	1,640.00	46,412,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
三菱瓦斯化学	61,800	2,337.50	144,457,500	
三井化学	68,200	4,328.00	295,169,600	
J S R	90,100	4,069.00	366,616,900	
東京応化工業	13,200	9,163.00	120,951,600	
大阪有機化学	6,900	2,669.00	18,416,100	
三菱ケミカルグループ	604,700	968.50	585,651,950	
KHネオケム	12,600	2,290.00	28,854,000	
ダイセル	106,300	1,421.00	151,052,300	
住友ベークライト	12,300	7,061.00	86,850,300	
積水化学	167,700	2,100.50	352,253,850	
日本ゼオン	56,700	1,374.00	77,905,800	
アイカ工業	20,800	3,325.00	69,160,000	
U B E	39,400	2,323.50	91,545,900	
積水樹脂	12,300	2,506.00	30,823,800	
タキロンシーアイ	20,900	589.00	12,310,100	
旭有機材	5,500	4,240.00	23,320,000	
ニチバン	4,400	1,758.00	7,735,200	
リケンテクノス	17,700	868.00	15,363,600	
大倉工業	3,800	2,818.00	10,708,400	貸付株式数 1,500株 (100株)
積水化成成品	11,600	483.00	5,602,800	
群栄化学	1,900	3,085.00	5,861,500	
タイガース ポリマー	2,100	916.00	1,923,600	
ミライアル	1,600	1,519.00	2,430,400	貸付株式数 600株
ダイキアクシス	1,900	774.00	1,470,600	貸付株式数 700株
ダイキョーニシカワ	18,400	770.00	14,168,000	
竹本容器	1,700	794.00	1,349,800	
森六ホールディングス	4,700	2,960.00	13,912,000	
恵和	6,000	1,360.00	8,160,000	貸付株式数 2,300株
日本化薬	63,100	1,350.00	85,185,000	
カーリットホールディングス	9,000	945.00	8,505,000	貸付株式数 100株
ソルクシーズ	3,600	419.00	1,508,400	
C Lホールディングス	2,000	850.00	1,700,000	貸付株式数 800株
プレステージ・インター	39,700	651.00	25,844,700	
フェイス	1,300	489.00	635,700	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	9,000	1,340.00	12,060,000	
ハイマックス	2,500	1,420.00	3,550,000	
アミューズ	5,200	1,509.00	7,846,800	
野村総合研究所	183,500	4,152.00	761,892,000	
ドリームインキュベータ	2,800	3,230.00	9,044,000	貸付株式数 100株
サイバネットシステム	5,900	1,092.00	6,442,800	
クイック	5,900	2,257.00	13,316,300	
T A C	2,200	202.00	444,400	貸付株式数 200株
C Eホールディングス	2,400	620.00	1,488,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本システム技術	2,700	2,708.00	7,311,600	
電通グループ	83,400	3,985.00	332,349,000	
インテージホールディングス	9,300	1,640.00	15,252,000	
テイクアンドギヴニーズ	2,900	1,144.00	3,317,600	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	2,700	1,216.00	3,283,200	
ぴあ	2,900	3,315.00	9,613,500	貸付株式数 1,100株
イオンファンタジー	3,000	2,602.00	7,806,000	貸付株式数 1,300株
ソースネクスト	38,000	187.00	7,106,000	貸付株式数 15,800株
シーティーエス	10,600	667.00	7,070,200	
ネクシィーズグループ	1,400	709.00	992,600	貸付株式数 500株
インフォコム	10,700	2,452.00	26,236,400	
メディカルシステムネットワーク	9,300	650.00	6,045,000	
日本精化	5,500	2,675.00	14,712,500	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	8,700	4,385.00	38,149,500	
トリケミカル	10,000	3,510.00	35,100,000	
シンプレクスHD	12,400	2,620.00	32,488,000	
HEROZ	2,800	1,379.00	3,861,200	貸付株式数 1,100株
ラクスル	19,900	1,430.00	28,457,000	貸付株式数 2,900株
メルカリ	50,200	2,829.50	142,040,900	
I P S	2,300	2,016.00	4,636,800	貸付株式数 900株
F I G	5,200	353.00	1,835,600	貸付株式数 2,800株
システムサポート	3,200	1,885.00	6,032,000	貸付株式数 1,100株
A D E K A	28,900	2,869.50	82,928,550	
日油	25,600	6,845.00	175,232,000	
ミヨシ油脂	1,800	1,465.00	2,637,000	貸付株式数 600株
新日本理化	6,200	195.00	1,209,000	貸付株式数 2,800株
ハリマ化成グループ	4,400	795.00	3,498,000	
イーソル	6,000	608.00	3,648,000	貸付株式数 2,300株
東海ソフト	700	1,153.00	807,100	
ウイングアーク1ST	8,600	3,285.00	28,251,000	
ヒト・コミュニケーションズHD	2,200	1,363.00	2,998,600	貸付株式数 800株
サーバーワークス	1,700	3,555.00	6,043,500	貸付株式数 300株
東名	400	1,781.00	712,400	貸付株式数 100株
ヴィッツ	500	940.00	470,000	貸付株式数 100株
トビラシステムズ	1,300	887.00	1,153,100	貸付株式数 100株
S a n s a n	27,100	1,546.00	41,896,600	
L i n k - U	1,100	753.00	828,300	貸付株式数 500株
ギフトィ	7,200	1,899.00	13,672,800	貸付株式数 3,000株
花王	187,000	5,696.00	1,065,152,000	
第一工業製薬	3,300	1,874.00	6,184,200	
石原ケミカル	3,700	1,981.00	7,329,700	
日華化学	1,800	985.00	1,773,000	貸付株式数 900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニイタカ	800	1,999.00	1,599,200	貸付株式数 300株 (300株)
三洋化成	5,100	4,285.00	21,853,500	
メドレー	11,100	4,425.00	49,117,500	
ベース	2,800	3,330.00	9,324,000	貸付株式数 1,100株
JMDC	14,100	4,314.00	60,827,400	
武田薬品	732,900	4,165.00	3,052,528,500	
アステラス製薬	726,500	1,797.50	1,305,883,750	
住友ファーマ	61,400	468.00	28,735,200	
塩野義製薬	104,400	6,978.00	728,503,200	
わかもと製薬	4,700	199.00	935,300	
日本新薬	21,700	5,331.00	115,682,700	
中外製薬	259,200	5,218.00	1,352,505,600	
科研製薬	14,200	3,378.00	47,967,600	
エーザイ	100,700	7,672.00	772,570,400	
理研ビタミン	7,100	2,253.00	15,996,300	
ロート製薬	80,200	3,090.00	247,818,000	
小野薬品	175,800	2,721.00	478,351,800	
久光製薬	18,400	4,618.00	84,971,200	
有機合成薬品	3,600	289.00	1,040,400	貸付株式数 600株
持田製薬	9,500	3,355.00	31,872,500	
参天製薬	150,900	1,399.00	211,109,100	
扶桑薬品	2,900	1,907.00	5,530,300	
日本ケミファ	500	1,622.00	811,000	
ツムラ	26,000	2,795.00	72,670,000	
テルモ	230,900	4,718.00	1,089,386,200	
HUグループHD	24,800	2,569.00	63,711,200	
キッセイ薬品工業	13,700	3,055.00	41,853,500	
生化学工業	13,900	792.00	11,008,800	
栄研化学	16,100	1,647.00	26,516,700	
鳥居薬品	4,400	3,660.00	16,104,000	
JCRファーマ	28,000	1,324.00	37,072,000	貸付株式数 9,900株
東和薬品	12,700	2,470.00	31,369,000	
富士製薬工業	6,000	1,560.00	9,360,000	
ゼリア新薬工業	11,400	2,026.00	23,096,400	
そーせいグループ	26,700	1,389.00	37,086,300	貸付株式数 10,600株
第一三共	721,400	4,000.00	2,885,600,000	
杏林製薬	17,800	1,828.00	32,538,400	
大幸薬品	17,000	301.00	5,117,000	貸付株式数 6,800株
ダイト	6,300	1,945.00	12,253,500	
大塚ホールディングス	172,300	5,689.00	980,214,700	
大正製薬HD	18,400	8,689.00	159,877,600	
ペプチドリーム	40,100	1,266.50	50,786,650	
大日本塗料	9,200	981.00	9,025,200	貸付株式数 2,300株
日本ペイントHOLD	439,200	1,104.50	485,096,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
関西ペイント	81,100	2,252.00	182,637,200	
神東塗料	3,800	128.00	486,400	貸付株式数 1,800 株
中国塗料	17,000	1,541.00	26,197,000	
日本特殊塗料	3,300	1,269.00	4,187,700	
藤倉化成	10,100	446.00	4,504,600	
太陽ホールディングス	14,400	2,990.00	43,056,000	貸付株式数 2,000 株
D I C	32,300	2,433.50	78,602,050	
サカタインクス	18,400	1,307.00	24,048,800	貸付株式数 4,700 株
東洋インキ S C ホールディング ン	18,000	2,667.00	48,006,000	
T&K TOKA	7,900	1,442.00	11,391,800	
アルプス技研	8,000	2,726.00	21,808,000	
サニックス	13,600	384.00	5,222,400	
日本空調サービス	8,900	801.00	7,128,900	
オリエンタルランド	449,200	5,025.00	2,257,230,000	
フォーカスシステムズ	5,500	991.00	5,450,500	
ダスキン	18,900	3,258.00	61,576,200	
パーク 2 4	52,800	1,802.50	95,172,000	
明光ネットワークジャパン	10,300	717.00	7,385,100	貸付株式数 3,700 株
ファルコホールディングス	3,800	2,117.00	8,044,600	
クレスコ	6,800	1,910.00	12,988,000	
フジ・メディア・HD	79,500	1,524.00	121,158,000	
秀英予備校	1,000	343.00	343,000	
田谷	800	414.00	331,200	貸付株式数 100 株 (100 株)
ラウンドワン	79,900	590.00	47,141,000	
リゾートトラスト	36,900	2,250.50	83,043,450	
オービック	27,700	22,695.00	628,651,500	
ジャストシステム	11,900	3,330.00	39,627,000	
TDCソフト	7,800	2,099.00	16,372,200	
L I N E ヤフー	1,178,900	430.60	507,634,340	
ビー・エム・エル	10,400	2,933.00	30,503,200	
トレンドマイクロ	39,200	7,514.00	294,548,800	
I D ホールディングス	5,600	1,531.00	8,573,600	
リソー教育	43,500	241.00	10,483,500	
日本オラル	15,800	11,435.00	180,673,000	
早稲田アカデミー	4,700	1,584.00	7,444,800	貸付株式数 1,700 株
アルファシステムズ	2,200	2,794.00	6,146,800	
フューチャー	17,700	1,804.00	31,930,800	
CAC HOLDINGS	4,400	1,788.00	7,867,200	
S B テクノロジー	3,500	2,494.00	8,729,000	
トーセ	1,300	715.00	929,500	貸付株式数 100 株
ユー・エス・エス	95,200	2,893.00	275,413,600	
オービックビジネスC	11,600	6,759.00	78,404,400	
アイティフォー	10,600	1,164.00	12,338,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
東京個別指導学院	10,100	480.00	4,848,000	貸付株式数 1,500株
東計電算	1,100	7,050.00	7,755,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	187,600	894.60	167,826,960	
楽天グループ	726,900	585.70	425,745,330	貸付株式数 290,300株
エックスネット	600	1,064.00	638,400	貸付株式数 300株
クリーク・アンド・リバー社	4,300	2,093.00	8,999,900	
SBIグローバルアセット	16,400	557.00	9,134,800	
テー・オー・ダブリュー	16,900	324.00	5,475,600	
大塚商会	41,100	6,035.00	248,038,500	
サイボウズ	11,400	2,082.00	23,734,800	
山田コンサルティングGP	3,700	1,850.00	6,845,000	
セントラルスポーツ	3,200	2,454.00	7,852,800	貸付株式数 1,200株
パラカ	2,900	1,934.00	5,608,600	
電通国際情報S	10,100	4,920.00	49,692,000	
ACCESS	8,600	731.00	6,286,600	
デジタルガレージ	13,200	3,095.00	40,854,000	
イーエムシステムズ	13,800	711.00	9,811,800	
ウェザーニューズ	2,600	5,870.00	15,262,000	貸付株式数 900株
C I J	13,700	618.00	8,466,600	
ビジネスエンジニアリング	1,400	4,420.00	6,188,000	
日本エンタープライズ	4,700	124.00	582,800	貸付株式数 2,100株
WOWOW	6,100	1,089.00	6,642,900	貸付株式数 2,300株
スカラ	7,800	765.00	5,967,000	
インテリジェント ウェイブ	2,400	1,029.00	2,469,600	貸付株式数 1,100株
フルキャストホールディングス	8,100	1,917.00	15,527,700	
エン・ジャパン	13,800	2,588.00	35,714,400	
セルソース	2,300	1,598.00	3,675,400	
あすか製薬HD	8,500	1,821.00	15,478,500	
サワイグループHD	18,900	4,918.00	92,950,200	
富士フイルムHLDGS	153,700	8,660.00	1,331,042,000	
コニカミノルタ	186,200	467.90	87,122,980	
資生堂	172,900	3,966.00	685,721,400	
ライオン	108,400	1,294.00	140,269,600	
高砂香料	6,200	3,515.00	21,793,000	貸付株式数 2,100株
マンダム	17,900	1,274.00	22,804,600	
ミルボン	11,200	3,696.00	41,395,200	
ファンケル	36,200	2,277.00	82,427,400	
コーセー	16,800	10,465.00	175,812,000	
コタ	7,400	1,572.00	11,632,800	
シーボン	600	1,493.00	895,800	
ポーラ・オルビスHD	42,400	1,558.50	66,080,400	
ノエビアホールディングス	7,400	5,220.00	38,628,000	
アジュバンホールディング	1,100	929.00	1,021,900	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
新日本製薬	4,700	1,575.00	7,402,500	貸付株式数 1,700 株
アクシージア	4,200	1,017.00	4,271,400	貸付株式数 1,600 株
エステー	6,200	1,517.00	9,405,400	
アグロカネショウ	3,300	1,348.00	4,448,400	
コニシ	13,800	2,582.00	35,631,600	
長谷川香料	15,800	3,220.00	50,876,000	
小林製薬	24,100	6,820.00	164,362,000	貸付株式数 9,600 株
荒川化学工業	6,900	1,018.00	7,024,200	
メック	6,800	4,045.00	27,506,000	貸付株式数 2,600 株
日本高純度化学	1,800	2,500.00	4,500,000	
タカラバイオ	22,300	1,222.00	27,250,600	
JCU	9,300	3,950.00	36,735,000	
新田ゼラチン	3,300	784.00	2,587,200	貸付株式数 1,500 株
OATアグリオ	2,400	1,926.00	4,622,400	
デクセリアルズ	20,800	4,633.00	96,366,400	
アース製薬	7,500	4,780.00	35,850,000	
北興化学	8,400	975.00	8,190,000	
大成ラミック	2,400	2,934.00	7,041,600	
クミアイ化学	32,900	1,089.00	35,828,100	
日本農薬	15,200	598.00	9,089,600	
富士興産	1,300	1,838.00	2,389,400	
ニチレキ	10,700	2,286.00	24,460,200	
ユシロ化学	4,300	1,718.00	7,387,400	
ビーピー・カストロール	1,700	894.00	1,519,800	
富士石油	24,100	365.00	8,796,500	貸付株式数 6,000 株
MORESCO	1,600	1,318.00	2,108,800	
出光興産	92,000	4,056.00	373,152,000	
ENEOSホールディングス	1,311,200	584.40	766,265,280	
コスモエネルギーHLDGS	24,600	5,635.00	138,621,000	
テスホールディングス	17,500	442.00	7,735,000	貸付株式数 6,700 株
インフロニアHD	93,300	1,561.50	145,687,950	
横浜ゴム	41,900	3,289.00	137,809,100	
TOYO TIRE	47,600	2,454.50	116,834,200	
ブリヂストン	242,400	6,098.00	1,478,155,200	貸付株式数 96,800 株
住友ゴム	81,200	1,709.50	138,811,400	
藤倉コンポジット	5,600	1,415.00	7,924,000	
オカモト	3,900	5,450.00	21,255,000	
アキレス	5,200	1,557.00	8,096,400	
フコク	4,300	1,402.00	6,028,600	
ニッタ	8,400	3,745.00	31,458,000	
クリエートメディック	1,500	914.00	1,371,000	
住友理工	12,900	1,034.00	13,338,600	
三ツ星ベルト	10,100	4,465.00	45,096,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
バンドー化学	12,300	1,560.00	19,188,000	
A G C	77,200	5,370.00	414,564,000	
日本板硝子	39,500	644.00	25,438,000	
石塚硝子	800	3,365.00	2,692,000	貸付株式数 300株
有沢製作所	14,500	1,095.00	15,877,500	
日本山村硝子	1,700	1,507.00	2,561,900	貸付株式数 600株
日本電気硝子	33,800	3,120.00	105,456,000	
オハラ	3,900	1,314.00	5,124,600	貸付株式数 1,400株
住友大阪セメント	13,800	3,608.00	49,790,400	
太平洋セメント	49,000	2,777.50	136,097,500	
リソルホールディングス	400	5,420.00	2,168,000	
日本ヒューム	7,200	949.00	6,832,800	貸付株式数 100株
日本コンクリート	15,800	323.00	5,103,400	
三谷セキサン	3,500	4,390.00	15,365,000	
アジアパイルHD	11,800	704.00	8,307,200	
東海カーボン	76,400	1,094.00	83,581,600	
日本カーボン	4,400	4,645.00	20,438,000	
東洋炭素	5,800	4,590.00	26,622,000	
ノリタケ	4,600	6,940.00	31,924,000	
T O T O	54,700	3,797.00	207,695,900	
日本碍子	96,300	1,804.00	173,725,200	
日本特殊陶業	69,400	3,433.00	238,250,200	
ダントーホールディングス	3,000	959.00	2,877,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	3,100	29,770.00	92,287,000	
品川リフラクトリーズ	10,200	1,705.00	17,391,000	
黒崎播磨	1,700	11,230.00	19,091,000	
ヨータイ	5,100	1,456.00	7,425,600	
東京窯業	4,800	421.00	2,020,800	
ニッカトー	2,100	571.00	1,199,100	
フジミインコーポレーテッド	22,200	2,929.00	65,023,800	
クニミネ工業	1,300	983.00	1,277,900	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	900	1,263.00	1,136,700	
ニチアス	20,900	3,155.00	65,939,500	
日本製鉄	381,500	3,457.00	1,318,845,500	
神戸製鋼所	171,300	1,731.50	296,605,950	
中山製鋼所	19,500	843.00	16,438,500	
合同製鐵	4,800	4,560.00	21,888,000	
J F Eホールディングス	236,900	2,180.00	516,442,000	
東京製鐵	23,900	1,794.00	42,876,600	
共英製鋼	9,700	2,080.00	20,176,000	
大和工業	16,100	7,462.00	120,138,200	
東京鐵鋼	3,800	3,960.00	15,048,000	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,900	1,907.00	7,437,300	貸付株式数 400株
淀川製鋼所	9,600	3,905.00	37,488,000	貸付株式数 3,700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
中部鋼鈑	5,600	1,964.00	10,998,400	
丸一鋼管	25,900	3,821.00	98,963,900	
モリ工業	1,500	4,185.00	6,277,500	
大同特殊鋼	10,700	6,827.00	73,048,900	
日本高周波	1,800	563.00	1,013,400	貸付株式数 900株
日本冶金工	6,200	4,180.00	25,916,000	
山陽特殊製鋼	8,400	2,616.00	21,974,400	
愛知製鋼	4,900	3,435.00	16,831,500	
日本金属	1,200	913.00	1,095,600	貸付株式数 400株
ミガロホールディングス	700	1,320.00	924,000	
大平洋金属	7,300	1,234.00	9,008,200	貸付株式数 2,200株
新日本電工	42,300	303.00	12,816,900	
栗本鉄工所	3,900	3,340.00	13,026,000	
虹 技	600	1,142.00	685,200	
日本鑄鉄管	500	1,096.00	548,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	23,000	2,553.50	58,730,500	
三菱製鋼	6,300	1,539.00	9,695,700	
日亜鋼業	4,700	308.00	1,447,600	
日本精線	1,300	4,705.00	6,116,500	貸付株式数 100株
エンビプロHD	4,500	631.00	2,839,500	貸付株式数 1,600株
大紀アルミニウム	10,700	1,207.00	12,914,900	
日本軽金属HD	24,800	1,689.00	41,887,200	
三井金属	24,800	4,540.00	112,592,000	
東邦亜鉛	5,400	1,198.00	6,469,200	貸付株式数 2,100株
三菱マテリアル	60,900	2,434.00	148,230,600	
住友鉱山	98,800	4,292.00	424,049,600	
DOWAホールディングス	21,000	5,256.00	110,376,000	貸付株式数 2,200株
古河機金	11,200	1,872.00	20,966,400	
エス・サイエンス	27,700	22.00	609,400	貸付株式数 15,200株
大阪チタニウム	14,800	2,902.00	42,949,600	貸付株式数 5,900株
東邦チタニウム	17,600	1,831.00	32,225,600	貸付株式数 7,000株
UACJ	11,900	3,465.00	41,233,500	
CKサンエツ	2,000	3,695.00	7,390,000	貸付株式数 100株
古河電工	28,400	2,378.50	67,549,400	
住友電工	318,800	1,834.00	584,679,200	
フジクラ	100,500	1,138.50	114,419,250	
SWCC	9,500	2,681.00	25,469,500	
タツタ電線	15,000	683.00	10,245,000	貸付株式数 900株
カナレ電気	800	1,591.00	1,272,800	貸付株式数 100株
平河ヒューテック	5,400	1,364.00	7,365,600	貸付株式数 1,600株
いよぎんホールディング	96,800	955.80	92,521,440	
しずおかフィナンシャル	180,800	1,196.00	216,236,800	
ちゅうぎんフィナンシャ	68,500	1,059.00	72,541,500	
楽天銀行	28,400	2,558.00	72,647,200	貸付株式数 11,200株
京都フィナンシャルG	25,800	8,849.00	228,304,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
リョービ	9,100	2,915.00	26,526,500	貸付株式数 3,500株
アーレステイ	5,200	817.00	4,248,400	貸付株式数 2,000株
AREホールディングス	31,800	1,909.00	60,706,200	
東洋製罐グループHD	50,800	2,294.50	116,560,600	
ホッカンホールディングス	4,200	1,575.00	6,615,000	
コロナ	4,600	924.00	4,250,400	
横河ブリッジHLDGS	13,400	2,724.00	36,501,600	
駒井ハルテック	800	2,216.00	1,772,800	
高田機工	300	3,350.00	1,005,000	
三和ホールディングス	85,600	2,121.00	181,557,600	
文化シヤッター	22,200	1,380.00	30,636,000	貸付株式数 400株
三協立山	9,700	818.00	7,934,600	貸付株式数 3,500株
アルインコ	6,400	1,022.00	6,540,800	貸付株式数 1,600株
東洋シヤッター	1,100	716.00	787,600	貸付株式数 300株
LIXIL	133,000	1,805.50	240,131,500	
日本フィルコン	3,000	469.00	1,407,000	
ノーリツ	14,100	1,498.00	21,121,800	
長府製作所	8,400	2,102.00	17,656,800	
リンナイ	41,700	3,005.00	125,308,500	
ユニプレス	14,800	990.00	14,652,000	
ダイニチ工業	2,300	735.00	1,690,500	
日東精工	12,300	564.00	6,937,200	
三洋工業	500	2,215.00	1,107,500	
岡 部	15,100	703.00	10,615,300	
ジーテクト	10,800	1,744.00	18,835,200	
東 プ レ	15,000	2,002.00	30,030,000	
高周波熱錬	13,100	1,003.00	13,139,300	貸付株式数 2,600株
東京製綱	5,500	1,380.00	7,590,000	
サンコール	6,500	475.00	3,087,500	貸付株式数 2,600株
モリテックスチル	4,100	295.00	1,209,500	貸付株式数 1,600株
パイオラックス	10,600	2,265.00	24,009,000	
エイチワン	8,600	768.00	6,604,800	
日本発条	75,400	1,125.00	84,825,000	
中央発條	6,300	722.00	4,548,600	
アドバネクス	600	929.00	557,400	貸付株式数 400株
三浦工業	34,800	2,866.00	99,736,800	
タ ク マ	28,200	1,632.00	46,022,400	
テクノプロ・ホールディング	50,200	3,434.00	172,386,800	
アトラグループ	1,400	196.00	274,400	貸付株式数 600株
アイ・アールジャパンHD	4,400	1,565.00	6,886,000	貸付株式数 1,700株
Keep 技研	5,200	5,880.00	30,576,000	
ファーストロジック	1,100	505.00	555,500	
三機サービス	700	1,117.00	781,900	
Gunosy	6,800	696.00	4,732,800	貸付株式数 1,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
デザインワン・ジャパン	1,300	147.00	191,100	貸付株式数 500株
イー・ガーディアン	3,200	1,539.00	4,924,800	
リブセンス	2,100	270.00	567,000	貸付株式数 1,000株
ジャパンマテリアル	25,900	2,597.00	67,262,300	
ベクトル	10,400	1,093.00	11,367,200	貸付株式数 4,100株
ウチヤマホールディングス	2,000	354.00	708,000	貸付株式数 200株
チャームケアコーポレーション	7,100	1,199.00	8,512,900	
キャリアリンク	3,100	2,188.00	6,782,800	貸付株式数 1,200株
I B J	6,500	739.00	4,803,500	貸付株式数 2,600株
アサンテ	4,100	1,616.00	6,625,600	貸付株式数 1,600株
バリューHR	7,400	1,498.00	11,085,200	貸付株式数 2,800株
M&Aキャピタルパートナー	6,900	2,267.00	15,642,300	貸付株式数 2,700株
ライドオンエクスプレスHD	3,300	1,017.00	3,356,100	
ERIホールディングス	1,200	1,723.00	2,067,600	
アビスト	700	3,040.00	2,128,000	
シグマクシス・ホールディング	11,400	1,326.00	15,116,400	
ウィルグループ	7,100	1,119.00	7,944,900	
エスクローAJ	5,500	142.00	781,000	貸付株式数 2,200株
メドピア	7,400	768.00	5,683,200	貸付株式数 2,900株
レアジョブ	900	967.00	870,300	
リクルートホールディングス	628,400	5,505.00	3,459,342,000	
エラン	11,200	1,019.00	11,412,800	
ツガミ	18,500	1,230.00	22,755,000	
オークマ	7,300	6,194.00	45,216,200	
芝浦機械	8,300	3,815.00	31,664,500	
アマダ	133,200	1,482.50	197,469,000	
アイダエンジニア	19,300	870.00	16,791,000	
FUJI	39,300	2,506.00	98,485,800	
牧野フライス	9,200	5,800.00	53,360,000	
オーエスジー	36,800	1,841.00	67,748,800	
ダイジェット	500	884.00	442,000	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	20,000	919.00	18,380,000	
DMG森精機	50,600	2,656.50	134,418,900	貸付株式数 17,500株
ソディック	20,500	751.00	15,395,500	
ディスコ	40,100	32,090.00	1,286,809,000	
日東工器	4,000	1,862.00	7,448,000	
日進工具	7,700	1,030.00	7,931,000	
パンチ工業	4,600	428.00	1,968,800	貸付株式数 2,100株
富士ダイス	4,300	655.00	2,816,500	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	2,100	323.00	678,300	貸付株式数 100株
日本郵政	995,500	1,304.50	1,298,629,750	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ベルシステム24HLDGS	9,000	1,664.00	14,976,000	
鎌倉新書	7,200	583.00	4,197,600	貸付株式数 3,700株 (1,300株)
SMN	900	293.00	263,700	
一蔵	600	589.00	353,400	貸付株式数 200株
グローバルキッズCOMP	900	634.00	570,600	
エアトリ	6,200	1,571.00	9,740,200	貸付株式数 2,400株
アトラエ	5,000	717.00	3,585,000	
ストライク	3,600	3,880.00	13,968,000	
ソラスト	23,400	587.00	13,735,800	
セラク	2,600	1,339.00	3,481,400	貸付株式数 1,000株
インソース	18,400	955.00	17,572,000	貸付株式数 4,800株
豊田自動織機	70,400	12,715.00	895,136,000	
豊和工業	2,500	775.00	1,937,500	貸付株式数 1,100株
石川製作所	1,200	1,203.00	1,443,600	貸付株式数 400株
リケンNPR	9,100	1,960.00	17,836,000	
東洋機械金属	3,900	667.00	2,601,300	
津田駒工業	800	356.00	284,800	貸付株式数 400株
エンシュウ	1,100	689.00	757,900	貸付株式数 400株
島精機製作所	13,300	1,534.00	20,402,200	
オプトラン	13,700	1,627.00	22,289,900	
NCホールディングス	1,100	1,902.00	2,092,200	
イワキポンプ	5,600	2,057.00	11,519,200	
フリーー	7,900	1,232.00	9,732,800	
ヤマシンフィルタ	20,000	345.00	6,900,000	貸付株式数 200株
日阪製作所	9,100	957.00	8,708,700	
やまびこ	13,700	1,486.00	20,358,200	
野村マイクロ・サイエンス	2,800	11,430.00	32,004,000	
平田機工	4,000	6,380.00	25,520,000	
PEGASUS	9,200	478.00	4,397,600	貸付株式数 100株
マルマエ	3,600	1,826.00	6,573,600	貸付株式数 1,400株
タツモ	5,000	3,640.00	18,200,000	貸付株式数 2,000株
ナブテスコ	52,400	2,767.50	145,017,000	
三井海洋開発	10,600	1,907.00	20,214,200	
レオン自動機	9,700	1,562.00	15,151,400	
SMC	25,000	74,450.00	1,861,250,000	
ホソカワミクロン	5,400	4,250.00	22,950,000	
ユニオンツール	3,700	3,385.00	12,524,500	
瑞光	6,000	1,433.00	8,598,000	貸付株式数 2,300株
オイレス工業	11,300	1,954.00	22,080,200	貸付株式数 3,600株
日精エーエスビー	3,300	4,985.00	16,450,500	
サトーホールディングス	11,900	2,039.00	24,264,100	
技研製作所	7,900	1,858.00	14,678,200	貸付株式数 1,300株
日本エアテック	3,900	1,400.00	5,460,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
カワタ	1,500	1,090.00	1,635,000	
日精樹脂工業	6,200	1,084.00	6,720,800	
オカダアイヨン	1,600	2,320.00	3,712,000	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,700	2,530.00	6,831,000	貸付株式数 800株
小松製作所	391,000	3,772.00	1,474,852,000	
住友重機械	49,400	3,529.00	174,332,600	
日立建機	33,300	3,835.00	127,705,500	
日工	12,300	673.00	8,277,900	
巴工業	3,300	2,876.00	9,490,800	貸付株式数 1,200株
井関農機	7,900	1,106.00	8,737,400	
TOWA	9,300	7,060.00	65,658,000	貸付株式数 3,700株
丸山製作所	800	2,531.00	2,024,800	
北川鉄工所	3,300	1,316.00	4,342,800	
シンニッタン	5,800	251.00	1,455,800	
ローツェ	4,400	14,560.00	64,064,000	貸付株式数 1,700株
タカキタ	1,500	478.00	717,000	貸付株式数 600株
クボタ	437,800	2,119.00	927,698,200	
荏原実業	4,400	2,952.00	12,988,800	
東洋エンジニア	12,000	706.00	8,472,000	
三菱化工機	3,000	3,285.00	9,855,000	
月島ホールディングス	11,300	1,328.00	15,006,400	
帝国電機製作所	5,900	3,015.00	17,788,500	
東京機械	1,200	440.00	528,000	
新東工業	16,900	1,087.00	18,370,300	
渋谷工業	7,900	2,537.00	20,042,300	
アイチ コーポレーション	11,600	933.00	10,822,800	
小森コーポレーション	21,100	1,169.00	24,665,900	
鶴見製作所	6,400	3,565.00	22,816,000	
日本ギア工業	1,800	491.00	883,800	貸付株式数 600株
酒井重工業	1,200	5,870.00	7,044,000	
荏原製作所	34,200	8,371.00	286,288,200	
石井鉄工所	500	2,729.00	1,364,500	
西島製作所	7,200	2,197.00	15,818,400	貸付株式数 2,500株
北越工業	8,400	2,249.00	18,891,600	貸付株式数 900株
ダイキン工業	99,600	22,155.00	2,206,638,000	
オルガノ	10,000	6,060.00	60,600,000	
トーヨーカネツ	3,200	3,715.00	11,888,000	
栗田工業	46,700	5,238.00	244,614,600	
椿本チエイン	11,900	3,775.00	44,922,500	
大同工業	2,000	737.00	1,474,000	
日機装	19,200	1,006.00	19,315,200	
木村化工機	6,400	716.00	4,582,400	
レイズネクスト	11,700	1,388.00	16,239,600	
アネスト岩田	12,900	1,094.00	14,112,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダイフク	140,800	2,783.00	391,846,400	
サムコ	2,200	4,785.00	10,527,000	貸付株式数 800株
加藤製作所	2,400	1,247.00	2,992,800	
油研工業	800	2,120.00	1,696,000	
タダノ	48,100	1,154.50	55,531,450	
フジテック	19,500	3,429.00	66,865,500	
CKD	23,100	2,409.00	55,647,900	
平和	24,600	2,104.00	51,758,400	
理想科学工業	6,700	2,761.00	18,498,700	
SANKYO	20,500	6,388.00	130,954,000	
日本金銭機械	10,100	1,121.00	11,322,100	貸付株式数 3,300株
マースグループHLDGS	4,200	2,383.00	10,008,600	
フクシマガリレイ	5,400	4,900.00	26,460,000	
オーイズミ	1,700	397.00	674,900	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,100	3,455.00	14,165,500	貸付株式数 1,700株
竹内製作所	15,100	4,325.00	65,307,500	
アマノ	23,700	3,147.00	74,583,900	
JUKI	13,000	505.00	6,565,000	貸付株式数 1,900株
サンデン	6,700	168.00	1,125,600	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	8,400	717.00	6,022,800	
ブラザー工業	111,500	2,496.00	278,304,000	
マックス	11,700	2,814.00	32,923,800	
モリタホールディングス	14,500	1,526.00	22,127,000	
グローリー	20,000	2,770.00	55,400,000	
新晃工業	8,400	2,479.00	20,823,600	
大和冷機工業	12,700	1,442.00	18,313,400	
セガサミーホールディングス	74,500	2,147.50	159,988,750	
TPR	10,600	1,729.00	18,327,400	
ツバキ・ナカシマ	16,700	742.00	12,391,400	貸付株式数 6,400株
ホンザキ	49,200	4,709.00	231,682,800	
大豊工業	7,200	873.00	6,285,600	
日本精工	154,500	775.10	119,752,950	
N T N	181,000	276.90	50,118,900	
ジェイテクト	74,300	1,355.50	100,713,650	
不二越	6,200	3,785.00	23,467,000	
ミネベアミツミ	145,100	2,813.00	408,166,300	
日本トムソン	22,800	590.00	13,452,000	
T H K	48,100	2,953.50	142,063,350	
ユーシン精機	6,600	672.00	4,435,200	
前澤給装工業	6,300	1,291.00	8,133,300	貸付株式数 1,000株
イーグル工業	9,200	1,657.00	15,244,400	
前澤工業	2,600	979.00	2,545,400	
日本ピラー工業	7,700	4,600.00	35,420,000	
キッツ	27,900	1,143.00	31,889,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日立	405,600	10,285.00	4,171,596,000	
三菱電機	928,300	2,009.00	1,864,954,700	
富士電機	50,700	6,201.00	314,390,700	
東洋電機製造	1,500	936.00	1,404,000	
安川電機	90,600	5,673.00	513,973,800	
シンフォニアテクノロジー	9,200	2,064.00	18,988,800	
明電舎	15,500	2,447.00	37,928,500	
オリジン	1,000	1,216.00	1,216,000	
山洋電気	3,600	6,090.00	21,924,000	
デンヨー	6,400	2,160.00	13,824,000	
PHCホールディングス	15,500	1,485.00	23,017,500	
ソシオネクスト	12,100	13,250.00	160,325,000	
ベイカレントコンサルティング	62,400	4,976.00	310,502,400	
ORCHESTRA HOLDINGS	1,800	1,278.00	2,300,400	
アイモバイル	11,300	459.00	5,186,700	
キャリアインデックス	1,600	233.00	372,800	貸付株式数 200株
MS-Japan	2,700	1,253.00	3,383,100	貸付株式数 600株
船場	1,000	895.00	895,000	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターSHD	27,500	2,350.00	64,625,000	
フルテック	600	1,235.00	741,000	
グリーンズ	1,700	1,941.00	3,299,700	貸付株式数 700株
ツナググループHLDGS	1,300	855.00	1,111,500	貸付株式数 100株
GAMEWITH	1,400	302.00	422,800	貸付株式数 600株
MS&CONSULTING	600	687.00	412,200	貸付株式数 100株
ウェルビー	4,200	745.00	3,129,000	
エル・ティール・エス	1,000	3,885.00	3,885,000	貸付株式数 300株
ミダックホールディングス	5,100	1,752.00	8,935,200	貸付株式数 1,800株
キュービーネットHLDGS	4,000	1,521.00	6,084,000	
RPAホールディングス	11,500	302.00	3,473,000	
三桜工業	12,600	873.00	10,999,800	
マキタ	95,100	3,924.00	373,172,400	
東芝テック	10,700	2,909.00	31,126,300	
芝浦メカトロニクス	4,700	6,700.00	31,490,000	貸付株式数 1,800株
マブチモーター	20,700	4,648.00	96,213,600	
ニデック	184,100	5,604.00	1,031,696,400	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,200	383.00	1,991,600	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,300	2,004.00	8,617,200	貸付株式数 1,700株
東光高岳	5,000	2,069.00	10,345,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダブル・スコープ	23,900	920.00	21,988,000	貸付株式数 9,500株
宮越ホールディングス	3,700	1,246.00	4,610,200	貸付株式数 1,400株
ダイヘン	8,400	5,830.00	48,972,000	
ヤーマン	14,400	1,061.00	15,278,400	貸付株式数 5,700株 (500株)
JVCケンウッド	65,800	767.00	50,468,600	
ミマキエンジニアリング	7,900	969.00	7,655,100	
IPEX	5,700	1,824.00	10,396,800	貸付株式数 900株
大崎電気	18,300	657.00	12,023,100	
オムロン	63,700	6,199.00	394,876,300	
日東工業	11,200	3,590.00	40,208,000	
IDEC	12,300	2,825.00	34,747,500	
正興電機製作所	1,500	1,141.00	1,711,500	
不二電機工業	900	1,132.00	1,018,800	貸付株式数 400株
ジーエス・ユアサコーポ	27,400	2,173.50	59,553,900	貸付株式数 10,900株
サクサホールディングス	1,100	2,700.00	2,970,000	
メルコホールディングス	2,600	3,460.00	8,996,000	
テクノメディカ	2,000	2,435.00	4,870,000	貸付株式数 500株
ダイヤモンドエレクトリック HD	3,100	714.00	2,213,400	貸付株式数 1,200株
日本電気	109,500	8,240.00	902,280,000	
富士通	76,700	21,120.00	1,619,904,000	
沖電気	37,700	956.00	36,041,200	
岩崎通信機	2,100	756.00	1,587,600	
電気興業	3,700	2,418.00	8,946,600	
サンケン電気	7,700	7,555.00	58,173,500	
ナカヨ	700	1,203.00	842,100	貸付株式数 300株
アイホン	4,500	2,768.00	12,456,000	
ルネサスエレクトロニクス	544,300	2,603.50	1,417,085,050	
セイコーエプソン	107,000	2,198.00	235,186,000	
ワコム	63,400	688.00	43,619,200	貸付株式数 22,600株
アルバック	19,800	6,508.00	128,858,400	
アクセル	2,900	2,110.00	6,119,000	貸付株式数 800株
EIZO	6,100	4,875.00	29,737,500	
ジャパンディスプレイ	61,700	29.00	1,789,300	
日本信号	18,900	957.00	18,087,300	
京三製作所	17,500	476.00	8,330,000	
能美防災	11,300	1,885.00	21,300,500	
ホーチキ	6,200	1,653.00	10,248,600	
星和電機	2,000	486.00	972,000	貸付株式数 1,000株
エレコム	19,900	1,624.00	32,317,600	
パナソニックホールディ ンク	985,200	1,530.00	1,507,356,000	
シャープ	140,600	925.60	130,139,360	貸付株式数 56,100株 (1,200株)
アンリツ	58,700	1,283.50	75,341,450	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
富士通ゼネラル	23,600	2,710.00	63,956,000	
ソニーグループ	584,000	12,820.00	7,486,880,000	※
T D K	132,100	6,870.00	907,527,000	
帝国通信工業	3,600	1,964.00	7,070,400	
タムラ製作所	33,200	569.00	18,890,800	貸付株式数 1,500 株
アルプスアルパイン	74,500	1,295.50	96,514,750	
池上通信機	1,400	928.00	1,299,200	貸付株式数 700 株
日本電波工業	10,000	1,250.00	12,500,000	貸付株式数 200 株
鈴木	4,500	1,234.00	5,553,000	
メイコー	8,300	4,355.00	36,146,500	
日本トリム	1,900	3,105.00	5,899,500	
ローランド ディー. ジー.	4,600	3,615.00	16,629,000	
フオスター電機	6,200	1,112.00	6,894,400	
S M K	2,200	2,516.00	5,535,200	
ヨコオ	7,400	1,566.00	11,588,400	
ティアック	7,400	102.00	754,800	貸付株式数 2,800 株
ホシデン	19,000	1,808.00	34,352,000	
ヒロセ電機	12,300	16,550.00	203,565,000	
日本航空電子	19,900	2,947.00	58,645,300	
T O A	9,500	1,050.00	9,975,000	
マクセル	18,400	1,658.00	30,507,200	
古野電気	10,800	1,810.00	19,548,000	
スミダコーポレーション	11,200	1,182.00	13,238,400	
アイコム	3,200	3,260.00	10,432,000	貸付株式数 1,000 株
リオン	3,400	2,229.00	7,578,600	
横河電機	91,200	2,801.00	255,451,200	
新電元工業	3,200	3,055.00	9,776,000	
アズビル	57,700	4,772.00	275,344,400	
東亜ディーケーケー	2,100	880.00	1,848,000	
日本光電工業	35,400	3,712.00	131,404,800	
チノール	3,400	2,066.00	7,024,400	貸付株式数 1,100 株
共和電業	4,200	435.00	1,827,000	
日本電子材料	5,100	1,572.00	8,017,200	
堀場製作所	15,800	9,957.00	157,320,600	
アドバンテスト	236,500	4,681.00	1,107,056,500	
小野測器	1,800	454.00	817,200	
エスペック	6,600	2,362.00	15,589,200	
キーエンス	82,600	63,350.00	5,232,710,000	※
日置電機	3,900	6,560.00	25,584,000	
シスメックス	71,200	8,181.00	582,487,200	
日本マイクロニクス	14,800	3,835.00	56,758,000	
メガチップス	6,500	4,230.00	27,495,000	
O B A R A G R O U P	4,500	3,700.00	16,650,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
IMAGICA GROUP	8,300	627.00	5,204,100	貸付株式数 1,300株
澤藤電機	500	1,259.00	629,500	貸付株式数 300株
デンソー	681,300	2,314.00	1,576,528,200	
原田工業	2,000	782.00	1,564,000	貸付株式数 500株
コーセル	9,900	1,264.00	12,513,600	
イリソ電子工業	7,600	3,975.00	30,210,000	
オプテックスグループ	15,200	1,712.00	26,022,400	
千代田インテグレ	3,200	3,040.00	9,728,000	
レーザーテック	37,800	33,040.00	1,248,912,000	
スタンレー電気	52,900	2,736.00	144,734,400	
ウシオ電機	42,000	1,905.00	80,010,000	
岡谷電機	3,400	299.00	1,016,600	貸付株式数 1,600株
ヘリオステクノH	4,600	500.00	2,300,000	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,200	1,585.00	1,902,000	貸付株式数 600株
日本セラミック	6,700	2,934.00	19,657,800	
遠藤照明	2,100	1,285.00	2,698,500	
古河電池	6,100	892.00	5,441,200	
双信電機	1,800	327.00	588,600	貸付株式数 900株
山一電機	7,400	1,895.00	14,023,000	
凶研	7,200	4,240.00	30,528,000	
日本電子	20,700	5,862.00	121,343,400	
カシオ	59,700	1,249.00	74,565,300	
ファナック	402,600	4,114.00	1,656,296,400	
日本シイエムケイ	17,500	751.00	13,142,500	
エンプラス	2,400	13,340.00	32,016,000	貸付株式数 900株
大真空	12,300	848.00	10,430,400	貸付株式数 2,100株
ローム	152,700	2,825.50	431,453,850	
浜松ホトニクス	66,300	5,856.00	388,252,800	
三井ハイテック	7,300	7,399.00	54,012,700	貸付株式数 3,000株
新光電気工業	29,200	5,519.00	161,154,800	
京セラ	128,300	8,190.00	1,050,777,000	
協栄産業	500	2,477.00	1,238,500	貸付株式数 200株
太陽誘電	40,200	3,834.00	154,126,800	
村田製作所	751,300	2,883.50	2,166,373,550	
双葉電子工業	15,700	553.00	8,682,100	
日東電工	53,200	10,515.00	559,398,000	
北陸電気工業	1,700	1,402.00	2,383,400	
東海理化電機	23,300	2,478.00	57,737,400	
ニチコン	21,700	1,471.00	31,920,700	
日本ケミコン	8,800	1,385.00	12,188,000	
KOA	12,500	1,619.00	20,237,500	貸付株式数 3,800株
三井E&S	21,700	543.00	11,783,100	
日立造船	73,600	901.00	66,313,600	
三菱重工業	145,900	8,268.00	1,206,301,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
川崎重工業	67,400	3,363.00	226,666,200	
I H I	62,100	2,856.00	177,357,600	
名村造船所	18,000	1,029.00	18,522,000	貸付株式数 1,700 株
サノヤスホールディングス	7,400	138.00	1,021,200	貸付株式数 1,900 株
スプリックス	1,300	790.00	1,027,000	
マネジメントソリューションズ	3,600	2,919.00	10,508,400	貸付株式数 1,400 株
プロレド・パートナーズ	2,000	383.00	766,000	貸付株式数 200 株
AND FACTORY	1,400	348.00	487,200	貸付株式数 500 株
テノ.ホールディングス	600	478.00	286,800	貸付株式数 200 株
フロンティア・マネジメント	2,100	1,565.00	3,286,500	
ピアラ	900	323.00	290,700	
コプロ・ホールディングス	1,500	1,469.00	2,203,500	貸付株式数 200 株
ギークス	600	464.00	278,400	貸付株式数 200 株
アンビスホールディングス	9,100	2,875.00	26,162,500	
カーブスホールディングス	23,100	667.00	15,407,700	
フォーラムエンジニアリング	11,600	795.00	9,222,000	
FAST FITNESS JAP	2,900	1,115.00	3,233,500	
日本車輛	2,800	2,094.00	5,863,200	貸付株式数 300 株
三菱ロジスネクスト	13,200	1,324.00	17,476,800	
近畿車輛	700	1,755.00	1,228,500	貸付株式数 300 株
一家ホールディングス	1,200	672.00	806,400	貸付株式数 600 株
フルサト・マルカHD	7,800	2,700.00	21,060,000	
ヤマエグループHD	4,900	3,465.00	16,978,500	
ジャパクラフトホールディング	2,800	178.00	498,400	貸付株式数 1,800 株
F P G	27,500	1,628.00	44,770,000	
島根銀行	1,400	514.00	719,600	貸付株式数 800 株
じもとホールディングス	4,100	557.00	2,283,700	
全国保証	21,300	4,997.00	106,436,100	
めぶきフィナンシャルG	403,900	445.00	179,735,500	
ジャパンインベストメントA	6,700	1,579.00	10,579,300	貸付株式数 2,500 株
東京きらぼしFG	10,400	4,300.00	44,720,000	
九州フィナンシャルG	157,500	832.80	131,166,000	
かんぽ生命保険	80,900	2,765.00	223,688,500	
ゆうちょ銀行	893,800	1,459.50	1,304,501,100	貸付株式数 25,200 株
あんしん保証	2,100	250.00	525,000	貸付株式数 600 株
富山第一銀行	25,800	787.00	20,304,600	
コンコルディア・フィナンシャル	436,600	693.90	302,956,740	
ジェイリース	2,100	1,867.00	3,920,700	貸付株式数 800 株
西日本フィナンシャルHD	45,900	1,633.00	74,954,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
イントラスト	1,800	851.00	1,531,800	
日本モーゲージサービス	2,700	527.00	1,422,900	貸付株式数 1,200 株
C a s a	2,000	878.00	1,756,000	貸付株式数 700 株
アルヒ	7,700	837.00	6,444,900	
プレミアグループ	13,700	1,769.00	24,235,300	
日産自動車	1,173,200	582.90	683,858,280	
いすゞ自動車	240,100	1,955.50	469,515,550	
トヨタ自動車	4,533,800	2,794.50	12,669,704,100	※
日野自動車	124,200	477.40	59,293,080	
三菱自動車工業	322,200	481.40	155,107,080	
エフテック	3,200	636.00	2,035,200	貸付株式数 1,200 株
レシップホールディングス	1,900	586.00	1,113,400	
GMB	900	1,325.00	1,192,500	貸付株式数 400 株
ファルテック	800	548.00	438,400	
武蔵精密工業	20,200	1,614.00	32,602,800	
日産車体	9,700	896.00	8,691,200	貸付株式数 400 株
新明和工業	23,800	1,184.00	28,179,200	
極東開発工業	13,700	1,900.00	26,030,000	
トピー工業	6,700	2,763.00	18,512,100	
ティラド	1,800	3,165.00	5,697,000	
タチエス	15,200	1,760.00	26,752,000	
N O K	32,100	1,885.00	60,508,500	
フタバ産業	22,100	856.00	18,917,600	
カヤバ	8,000	4,755.00	38,040,000	
市光工業	14,900	539.00	8,031,100	
大同メタル工業	16,000	579.00	9,264,000	
プレス工業	33,000	620.00	20,460,000	
ミクニ	5,800	456.00	2,644,800	
太平洋工業	18,900	1,397.00	26,403,300	貸付株式数 4,700 株
河西工業	7,200	221.00	1,591,200	貸付株式数 2,800 株
アイシン	63,700	5,451.00	347,228,700	
マ ッ ダ	273,200	1,578.50	431,246,200	
今仙電機製作所	2,800	614.00	1,719,200	
本田技研	2,013,700	1,509.00	3,038,673,300	
スズキ	151,700	6,021.00	913,385,700	
S U B A R U	261,300	2,621.00	684,867,300	
安永	2,000	708.00	1,416,000	貸付株式数 1,200 株
ヤマハ発動機	119,000	3,777.00	449,463,000	
小糸製作所	89,400	2,236.50	199,943,100	
T B K	4,900	388.00	1,901,200	
エクセディ	13,500	2,548.00	34,398,000	
ミツバ	15,400	933.00	14,368,200	
豊田合成	24,100	2,958.00	71,287,800	
愛三工業	13,600	1,312.00	17,843,200	
盟和産業	600	993.00	595,800	貸付株式数 200 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本プラスト	3,800	572.00	2,173,600	
ヨロズ	7,700	902.00	6,945,400	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	14,700	1,828.00	26,871,600	
新家工業	1,000	2,893.00	2,893,000	
シマノ	33,500	22,755.00	762,292,500	
テイ・エス テック	29,400	1,826.00	53,684,400	
33FG	7,400	1,868.00	13,823,200	
第四北越フィナンシャルG	12,800	3,940.00	50,432,000	
ひろぎんHLDGS	115,800	927.00	107,346,600	
マーキュリアホールディングス	2,400	807.00	1,936,800	貸付株式数 100株
おきなわFG	7,000	2,398.00	16,786,000	
ダイレクトマーケティングミクス	8,800	461.00	4,056,800	
ポピンズ	1,300	1,141.00	1,483,300	
LITALICO	6,600	2,141.00	14,130,600	
コンフィデンス・インターワーク	400	1,543.00	617,200	貸付株式数 100株
十六FG	10,600	3,830.00	40,598,000	
北國FHD	8,600	4,530.00	38,958,000	
ネットプロHD	27,000	243.00	6,561,000	
プロクレアホールディングス	9,300	1,897.00	17,642,100	
あいちフィナンシャルグル	12,500	2,345.00	29,312,500	
ジャムコ	3,500	1,488.00	5,208,000	貸付株式数 1,300株
小野建	8,500	1,687.00	14,339,500	
はるやまHLDGS	2,200	528.00	1,161,600	貸付株式数 1,100株
南陽	1,000	2,058.00	2,058,000	
ノジマ	25,300	1,396.00	35,318,800	
佐鳥電機	4,200	1,964.00	8,248,800	
カップ・クリエイト	13,600	1,654.00	22,494,400	貸付株式数 5,100株
エコートレーディング	900	1,492.00	1,342,800	貸付株式数 400株
伯東	5,000	5,470.00	27,350,000	貸付株式数 1,900株
コンドーテック	6,600	1,169.00	7,715,400	貸付株式数 2,200株
中山福	2,500	357.00	892,500	
ライトオン	3,600	471.00	1,695,600	貸付株式数 1,700株
ナガイレーベン	11,000	2,272.00	24,992,000	
三菱食品	8,100	4,860.00	39,366,000	
良品計画	95,400	2,336.50	222,902,100	
パリミキホールディングス	5,900	519.00	3,062,100	
松田産業	6,600	2,557.00	16,876,200	
第一興商	33,800	2,235.00	75,543,000	
メディパルHD	90,500	2,340.00	211,770,000	
アドヴァングループ	8,200	1,039.00	8,519,800	
SPK	3,900	1,829.00	7,133,100	
萩原電気HLDGS	3,700	4,940.00	18,278,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アルビス	2,800	2,581.00	7,226,800	貸付株式数 1,100株
アズワン	13,700	5,072.00	69,486,400	
スズデン	3,000	2,283.00	6,849,000	
尾家産業	1,200	1,890.00	2,268,000	貸付株式数 100株
シモジマ	5,900	1,262.00	7,445,800	貸付株式数 200株
ドウシシャ	8,000	2,110.00	16,880,000	
小津産業	1,100	1,600.00	1,760,000	貸付株式数 600株
コナカ	5,200	413.00	2,147,600	
高速	5,100	2,039.00	10,398,900	
ハウス ローゼ	600	1,605.00	963,000	
G-7ホールディングス	9,500	1,203.00	11,428,500	
たけびし	3,300	1,888.00	6,230,400	
イオン北海道	25,800	892.00	23,013,600	貸付株式数 4,600株
コジマ	14,200	723.00	10,266,600	貸付株式数 5,600株
ヒマラヤ	1,500	918.00	1,377,000	貸付株式数 900株
コーナン商事	10,700	3,700.00	39,590,000	
ネットワンシステムズ	33,400	2,056.00	68,670,400	
エコス	3,200	2,227.00	7,126,400	
ワタミ	9,200	1,040.00	9,568,000	貸付株式数 3,900株
マルシェ	1,700	273.00	464,100	貸付株式数 300株
リックス	1,500	3,280.00	4,920,000	
システムソフト	28,000	67.00	1,876,000	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	176,400	3,204.00	565,185,600	
丸文	7,800	1,508.00	11,762,400	
西松屋チェーン	17,200	2,157.00	37,100,400	貸付株式数 7,200株
ゼンショーホールディングス	43,000	8,214.00	353,202,000	
ハピネット	7,400	2,577.00	19,069,800	
幸楽苑ホールディングス	6,300	1,159.00	7,301,700	貸付株式数 2,500株
ハークスレイ	1,700	689.00	1,171,300	
橋本総業HLDS	3,400	1,200.00	4,080,000	
日本ライフライン	25,600	1,164.00	29,798,400	
サイゼリヤ	12,900	5,740.00	74,046,000	
タカショー	7,500	550.00	4,125,000	貸付株式数 2,900株
VTホールディングス	33,000	524.00	17,292,000	
アルゴグラフィックス	7,600	3,735.00	28,386,000	
魚力	3,000	2,205.00	6,615,000	貸付株式数 900株
IDOM	23,100	922.00	21,298,200	
日本エム・ディ・エム	6,500	703.00	4,569,500	
ポプラ	1,200	196.00	235,200	貸付株式数 200株
フジ・コーポレーション	4,300	1,600.00	6,880,000	
ユナイテッドアローズ	10,300	1,959.00	20,177,700	貸付株式数 2,900株
進和	5,400	2,499.00	13,494,600	貸付株式数 2,000株
エスケイジャパン	1,200	811.00	973,200	
ダイトロン	3,400	2,964.00	10,077,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ハイデイ日高	12,900	2,749.00	35,462,100	貸付株式数 4,700株
シークス	12,500	1,518.00	18,975,000	貸付株式数 4,900株
YU-WA CREATION H	2,700	159.00	429,300	
コロワイド	37,500	2,234.00	83,775,000	貸付株式数 15,000株
田中商事	1,300	700.00	910,000	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	4,600	1,748.00	8,040,800	
壺番屋	6,900	5,330.00	36,777,000	貸付株式数 100株
白銅	2,400	2,299.00	5,517,600	貸付株式数 1,100株
トップカルチャー	1,600	170.00	272,000	貸付株式数 400株
PLANT	1,100	1,430.00	1,573,000	
スギホールディングス	17,600	6,414.00	112,886,400	
ダイコー通産	500	1,194.00	597,000	貸付株式数 200株
薬王堂ホールディングス	4,200	2,711.00	11,386,200	
島津製作所	109,700	3,835.00	420,699,500	
J M S	7,500	517.00	3,877,500	
クボテック	1,200	277.00	332,400	貸付株式数 400株
長野計器	6,000	2,083.00	12,498,000	
ブイ・テクノロジー	4,400	2,657.00	11,690,800	
スター精密	15,600	1,877.00	29,281,200	
東京計器	6,300	1,762.00	11,100,600	貸付株式数 1,600株
愛知時計	3,600	2,352.00	8,467,200	
インターアクション	4,000	1,016.00	4,064,000	貸付株式数 1,200株
オーバル	4,000	486.00	1,944,000	貸付株式数 1,600株
東京精密	16,900	8,577.00	144,951,300	
マニー	33,000	2,193.00	72,369,000	
ニコン	119,400	1,424.50	170,085,300	
トプコン	40,100	1,517.00	60,831,700	
オリンパス	508,300	2,166.00	1,100,977,800	
理研計器	5,800	6,630.00	38,454,000	
SCREENホールディングス	28,200	10,770.00	303,714,000	
キヤノン電子	9,100	1,971.00	17,936,100	
タムロン	5,100	4,415.00	22,516,500	
HOYA	164,000	16,665.00	2,733,060,000	
シード	2,300	852.00	1,959,600	
ノーリツ鋼機	7,800	2,993.00	23,345,400	
A&Dホロンホールディングス	12,000	1,870.00	22,440,000	
朝日インテック	92,200	2,866.50	264,291,300	貸付株式数 22,300株
キヤノン	411,900	3,807.00	1,568,103,300	貸付株式数 159,400株
リコー	207,100	1,207.00	249,969,700	
シチズン時計	76,000	867.00	65,892,000	
リズム	1,000	2,491.00	2,491,000	貸付株式数 400株
大研医器	3,800	516.00	1,960,800	
メニコン	28,400	2,154.00	61,173,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
シンシア	500	561.00	280,500	貸付株式数 200株
KYORITSU	6,700	167.00	1,118,900	
中本パックス	1,500	1,634.00	2,451,000	貸付株式数 100株
スノーピーク	11,800	1,012.00	11,941,600	貸付株式数 4,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	17,100	2,763.00	47,247,300	
トランザクション	5,400	2,112.00	11,404,800	貸付株式数 1,900株
粧美堂	1,200	612.00	734,400	
ニホンフラッシュ	7,700	896.00	6,899,200	
前田工織	6,900	2,959.00	20,417,100	貸付株式数 2,600株
永大産業	5,300	222.00	1,176,600	
アートネイチャー	7,400	790.00	5,846,000	
バンダイナムコHLDGS	226,200	2,943.00	665,706,600	
アイフィスジャパン	1,400	625.00	875,000	
SHOEI	18,700	1,985.00	37,119,500	
フランスベッドHLDGS	10,600	1,251.00	13,260,600	貸付株式数 3,400株
マーベラス	13,300	697.00	9,270,100	
パイロットコーポレーション	11,600	4,469.00	51,840,400	
萩原工業	5,500	1,591.00	8,750,500	貸付株式数 1,900株 (500株)
エイベックス	14,100	1,392.00	19,627,200	
フジシールインターナショナル	16,700	1,675.00	27,972,500	
タカラトミー	37,600	2,078.50	78,151,600	
広済堂ホールディングス	18,500	635.00	11,747,500	貸付株式数 1,400株
エステールホールディングス	1,000	629.00	629,000	貸付株式数 700株
レック	10,500	994.00	10,437,000	
タカノ	1,700	842.00	1,431,400	貸付株式数 800株
三光合成	10,400	540.00	5,616,000	
プロネクス	8,500	1,209.00	10,276,500	
ホクシン	3,400	117.00	397,800	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,700	982.00	1,669,400	貸付株式数 600株
きもと	7,600	191.00	1,451,600	
TOPPANホールディングス	101,500	3,464.00	351,596,000	
大日本印刷	90,300	4,153.00	375,015,900	
共同印刷	2,300	3,600.00	8,280,000	
NISSHA	14,100	1,475.00	20,797,500	
光村印刷	400	1,266.00	506,400	
藤森工業	6,500	3,885.00	25,252,500	
ヴィア・ホールディングス	7,100	215.00	1,526,500	貸付株式数 2,800株
TAKARA & COMPANY	5,300	2,460.00	13,038,000	
前澤化成工業	5,300	1,580.00	8,374,000	貸付株式数 2,000株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
未来工業	2,900	3,145.00	9,120,500	
アシックス	70,400	5,290.00	372,416,000	
ツ ツ ミ	1,900	2,144.00	4,073,600	
ウェーブロックHLDGS	1,700	644.00	1,094,800	貸付株式数 200株
ジェイ エス ピー	5,800	1,783.00	10,341,400	貸付株式数 1,400株
ニ チ ハ	10,400	2,776.00	28,870,400	
ローランド	6,100	4,540.00	27,694,000	
エフピコ	15,700	2,791.00	43,818,700	
小松ウオール工業	3,300	2,927.00	9,659,100	
ヤマハ	52,100	3,461.00	180,318,100	
河合楽器	2,500	3,155.00	7,887,500	
クリナップ	7,900	696.00	5,498,400	
ビジョン	52,600	1,659.00	87,263,400	
天馬	6,000	2,336.00	14,016,000	
キングジム	7,100	870.00	6,177,000	貸付株式数 2,200株
象印マホービン	22,400	1,556.00	34,854,400	
リンテック	16,600	2,494.00	41,400,400	
信越ポリマー	17,800	1,429.00	25,436,200	
東 リ	11,300	338.00	3,819,400	
イトーキ	16,900	1,320.00	22,308,000	
任 天 堂	521,300	6,912.00	3,603,225,600	
三菱鉛筆	11,700	1,888.00	22,089,600	
松 風	3,700	2,673.00	9,890,100	
タカラスタANDARD	17,300	1,777.00	30,742,100	
コ ク ヨ	33,800	2,302.50	77,824,500	
ナカバヤシ	8,700	528.00	4,593,600	
ニ フ コ	24,800	3,612.00	89,577,600	
立川ブラインド	3,800	1,484.00	5,639,200	貸付株式数 1,500株
グローブライド	7,400	2,024.00	14,977,600	
オカムラ	24,800	2,131.00	52,848,800	
バルカー	6,900	3,905.00	26,944,500	
MUTOHホールディングス	600	1,930.00	1,158,000	
伊 藤 忠	587,300	5,738.00	3,369,927,400	
丸 紅	728,400	2,307.00	1,680,418,800	
スクロール	13,000	925.00	12,025,000	
高 島	3,300	957.00	3,158,100	
ヨンドシーホールディングス	8,300	1,955.00	16,226,500	貸付株式数 100株
三陽商会	2,700	2,698.00	7,284,600	貸付株式数 200株
長瀬産業	40,000	2,323.50	92,940,000	
ナイガイ	1,500	269.00	403,500	貸付株式数 600株 (100株)
蝶 理	5,500	2,785.00	15,317,500	
豊田通商	76,500	8,190.00	626,535,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
オンワードホールディングス	48,700	501.00	24,398,700	
三共生興	12,100	742.00	8,978,200	
兼松	36,500	2,054.00	74,971,000	
美津濃	8,200	4,045.00	33,169,000	
ツカモトコーポレーション	700	1,223.00	856,100	
ルックホールディングス	2,000	2,483.00	4,966,000	貸付株式数 800株
三井物産	658,200	5,392.00	3,549,014,400	
日本紙パルプ	4,200	4,995.00	20,979,000	
東京エレクトロン	174,800	24,025.00	4,199,570,000	
カメイ	9,300	1,705.00	15,856,500	
東都水産	300	6,860.00	2,058,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	900	2,390.00	2,151,000	
スターゼン	6,200	2,463.00	15,270,600	
セイコーグループ	11,500	2,505.00	28,807,500	
山善	26,500	1,200.00	31,800,000	
椿本興業	1,800	6,040.00	10,872,000	
住友商事	528,900	3,100.00	1,639,590,000	
BIPROGY	27,100	4,273.00	115,798,300	
内田洋行	3,500	7,200.00	25,200,000	
三菱商事	577,100	6,886.00	3,973,910,600	
第一実業	8,200	1,916.00	15,711,200	
キャノンマーケティングJPN	20,200	3,731.00	75,366,200	
西華産業	3,500	2,677.00	9,369,500	
佐藤商事	6,000	1,524.00	9,144,000	
菱洋エレクトロ	8,300	3,710.00	30,793,000	
東京産業	8,100	869.00	7,038,900	
ユアサ商事	6,800	4,430.00	30,124,000	
神鋼商事	2,200	5,710.00	12,562,000	
トルク	2,500	287.00	717,500	貸付株式数 1,000株
阪和興業	15,700	4,560.00	71,592,000	
正栄食品	5,800	4,515.00	26,187,000	貸付株式数 2,100株
カナデン	6,600	1,473.00	9,721,800	
RYODEN	7,000	2,606.00	18,242,000	貸付株式数 2,400株
ニプロ	68,700	1,118.00	76,806,600	
岩谷産業	19,900	7,106.00	141,409,400	
ナイス	2,500	1,619.00	4,047,500	
ニチモウ	800	4,095.00	3,276,000	
極東貿易	5,200	1,888.00	9,817,600	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	16,400	497.00	8,150,800	貸付株式数 5,100株
三愛オブリ	21,000	1,617.00	33,957,000	
稲畑産業	17,300	3,165.00	54,754,500	
GSIクレオス	4,700	2,052.00	9,644,400	
明和産業	10,300	659.00	6,787,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
クワザワホールディングス	1,700	689.00	1,171,300	
ゴールドウイン	14,600	11,535.00	168,411,000	
ユニ・チャーム	172,500	4,763.00	821,617,500	
デサント	14,300	4,255.00	60,846,500	
キング	1,700	674.00	1,145,800	
ワキタ	14,500	1,485.00	21,532,500	
ヤマトインターナショナル	3,500	300.00	1,050,000	
東邦ホールディングス	24,100	3,230.00	77,843,000	貸付株式数 7,900 株
サンゲツ	20,100	2,868.00	57,646,800	
ミツウロコグループ	11,100	1,312.00	14,563,200	
シナネンホールディングス	2,400	4,065.00	9,756,000	
伊藤忠エネクス	21,600	1,528.00	33,004,800	
サンリオ	24,800	6,069.00	150,511,200	
サンワ テクノス	4,500	2,233.00	10,048,500	
リョーサン	6,200	4,945.00	30,659,000	
新光商事	11,700	1,208.00	14,133,600	
トーホー	3,400	3,095.00	10,523,000	貸付株式数 1,100 株
三信電気	3,500	2,296.00	8,036,000	
東陽テクニカ	8,800	1,388.00	12,214,400	
モスフード サービス	12,700	3,335.00	42,354,500	
加賀電子	8,000	6,630.00	53,040,000	
三益半導体	6,600	2,776.00	18,321,600	
都築電気	4,300	2,093.00	8,999,900	貸付株式数 1,600 株
ソーダニツカ	6,500	1,034.00	6,721,000	
立花エレテック	5,800	2,905.00	16,849,000	貸付株式数 2,000 株
木曽路	13,200	2,491.00	32,881,200	貸付株式数 1,500 株
SRSホールディングス	14,100	1,037.00	14,621,700	貸付株式数 5,200 株
千趣会	15,700	398.00	6,248,600	貸付株式数 6,000 株
タカキュー	3,300	80.00	264,000	貸付株式数 600 株
リテールパートナーズ	12,900	1,778.00	22,936,200	貸付株式数 1,800 株
上新電機	8,600	2,313.00	19,891,800	
日本瓦斯	46,300	2,237.00	103,573,100	
ロイヤルホールディングス	15,400	2,676.00	41,210,400	貸付株式数 6,100 株
東天紅	400	825.00	330,000	貸付株式数 100 株
いなげや	8,300	1,501.00	12,458,300	
チヨダ	8,200	843.00	6,912,600	貸付株式数 1,300 株
ライフコーポレーション	9,200	3,405.00	31,326,000	
リンガーハット	11,200	2,312.00	25,894,400	貸付株式数 4,400 株 (600 株)
MrMaxHD	10,800	628.00	6,782,400	
テンアライド	6,200	309.00	1,915,800	貸付株式数 600 株
AOKIホールディングス	18,700	1,183.00	22,122,100	
オークワ	12,400	830.00	10,292,000	貸付株式数 200 株
コメリ	13,400	3,155.00	42,277,000	貸付株式数 5,000 株
青山商事	18,700	1,581.00	29,564,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
しまむら	10,300	16,555.00	170,516,500	
はせがわ	2,200	368.00	809,600	
高島屋	60,400	1,992.50	120,347,000	
松屋	14,800	859.00	12,713,200	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	38,600	1,646.00	63,535,600	
近鉄百貨店	3,700	2,643.00	9,779,100	
丸井グループ	58,100	2,364.50	137,377,450	
クレディセゾン	51,600	2,490.50	128,509,800	
アクシアル リテイリング	5,900	3,895.00	22,980,500	
井筒屋	2,300	352.00	809,600	貸付株式数 1,000株
イオン	296,100	3,061.00	906,362,100	
イズミ	15,500	3,534.00	54,777,000	
フオーバル	3,400	1,390.00	4,726,000	貸付株式数 1,300株
平和堂	14,600	2,322.00	33,901,200	貸付株式数 5,200株
フジ	13,400	1,875.00	25,125,000	貸付株式数 3,300株
ヤオコー	9,800	8,067.00	79,056,600	貸付株式数 3,900株
ゼビオホールディングス	11,800	944.00	11,139,200	
ケーズホールディングス	61,700	1,259.50	77,711,150	
PALTAC	11,800	4,755.00	56,109,000	
三谷産業	15,000	334.00	5,010,000	
OLYMPICグループ	2,100	511.00	1,073,100	貸付株式数 100株
日産東京販売HD	7,100	438.00	3,109,800	
あおぞら銀行	58,500	3,040.00	177,840,000	貸付株式数 23,300株
三菱UFJフィナンシャル G	5,094,300	1,255.00	6,393,346,500	※
りそなホールディングス	949,400	768.50	729,613,900	
三井住友トラストHD	146,300	5,559.00	813,281,700	
三井住友フィナンシャルG	578,500	7,258.00	4,198,753,000	※
千葉銀行	226,800	1,106.50	250,954,200	
群馬銀行	157,900	747.80	118,077,620	
武蔵野銀行	11,400	2,856.00	32,558,400	
千葉興業銀行	13,500	830.00	11,205,000	
筑波銀行	35,800	267.00	9,558,600	
七十七銀行	23,700	3,430.00	81,291,000	
秋田銀行	5,500	1,977.00	10,873,500	
山形銀行	9,100	1,059.00	9,636,900	
岩手銀行	5,200	2,475.00	12,870,000	
東邦銀行	64,400	291.00	18,740,400	
東北銀行	2,200	1,163.00	2,558,600	
ふくおかフィナンシャルG	70,900	3,433.00	243,399,700	
スルガ銀行	63,000	751.00	47,313,000	
八十二銀行	174,600	801.10	139,872,060	
山梨中央銀行	9,100	1,794.00	16,325,400	
大垣共立銀行	15,600	1,897.00	29,593,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
福井銀行	7,300	1,554.00	11,344,200	
清水銀行	3,200	1,532.00	4,902,400	
富山銀行	800	1,707.00	1,365,600	
滋賀銀行	13,500	3,745.00	50,557,500	
南都銀行	12,300	2,486.00	30,577,800	
百五銀行	76,700	541.00	41,494,700	
紀陽銀行	29,200	1,591.00	46,457,200	
ほくほくフィナンシャルG	50,400	1,568.00	79,027,200	
山陰合同銀行	51,000	958.00	48,858,000	
鳥取銀行	1,600	1,325.00	2,120,000	
百十四銀行	8,000	2,597.00	20,776,000	
四国銀行	12,100	1,001.00	12,112,100	
阿波銀行	11,500	2,495.00	28,692,500	
大分銀行	4,900	2,642.00	12,945,800	
宮崎銀行	4,900	2,646.00	12,965,400	
佐賀銀行	4,800	1,875.00	9,000,000	
琉球銀行	17,400	1,119.00	19,470,600	
セブン銀行	255,400	300.30	76,696,620	
みずほフィナンシャルG	1,098,500	2,512.00	2,759,432,000	
高知銀行	1,600	964.00	1,542,400	
山口フィナンシャルG	79,900	1,298.50	103,750,150	
芙蓉総合リース	7,500	12,000.00	90,000,000	
みずほリース	13,700	4,960.00	67,952,000	
東京センチュリー	15,200	5,892.00	89,558,400	
SBIホールディングス	119,100	3,207.00	381,953,700	
日本証券金融	29,900	1,559.00	46,614,100	
アイフル	120,100	379.00	45,517,900	
日本アジア投資	3,400	236.00	802,400	
名古屋銀行	5,300	5,560.00	29,468,000	
北洋銀行	123,400	365.00	45,041,000	
大光銀行	1,500	1,308.00	1,962,000	貸付株式数 300株
愛媛銀行	11,100	1,008.00	11,188,800	
トマト銀行	1,700	1,145.00	1,946,500	
京葉銀行	34,100	701.00	23,904,100	
栃木銀行	40,700	318.00	12,942,600	
北日本銀行	2,700	2,116.00	5,713,200	
東和銀行	15,200	622.00	9,454,400	
福島銀行	5,000	252.00	1,260,000	
大東銀行	2,000	766.00	1,532,000	貸付株式数 500株
リコーリース	7,800	4,640.00	36,192,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	47,100	1,267.00	59,675,700	
アコム	146,300	348.50	50,985,550	
ジャックス	8,700	5,370.00	46,719,000	
オリコ	26,800	1,082.00	28,997,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
オリックス	495,600	2,698.50	1,337,376,600	
三菱HCキャピタル	363,100	964.40	350,173,640	
ジャフコグループ	24,300	1,703.00	41,382,900	貸付株式数 10,400株
九州リースサービス	1,800	940.00	1,692,000	貸付株式数 1,200株
トモニホールディングス	66,100	490.00	32,389,000	
大和証券G本社	630,400	955.40	602,284,160	
野村ホールディングス	1,368,200	607.30	830,907,860	
岡三証券グループ	71,500	714.00	51,051,000	貸付株式数 24,800株
丸三証券	27,100	849.00	23,007,900	貸付株式数 10,400株
東洋証券	21,600	299.00	6,458,400	
東海東京HD	96,900	553.00	53,585,700	
光世証券	1,100	513.00	564,300	貸付株式数 200株
水戸証券	24,200	436.00	10,551,200	
いちよし証券	15,500	732.00	11,346,000	
松井証券	40,300	742.00	29,902,600	
SOMP Oホールディングス	128,000	6,757.00	864,896,000	
日本取引所グループ	212,300	3,019.00	640,933,700	
マネックスG	79,700	661.00	52,681,700	貸付株式数 33,900株
極東証券	11,300	1,033.00	11,672,900	
岩井コスモホールディング	9,400	1,760.00	16,544,000	
アイザワ証券グループ	11,800	1,198.00	14,136,400	
フィデアホール	8,500	1,468.00	12,478,000	
池田泉州HD	113,100	342.00	38,680,200	
アニコムホールディングス	27,000	603.00	16,281,000	
MS&AD	180,500	5,533.00	998,706,500	
マネーパートナーズGP	4,900	286.00	1,401,400	
スパークス・グループ	9,100	1,489.00	13,549,900	
小林洋行	2,100	233.00	489,300	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	396,200	3,081.00	1,220,692,200	
東京海上HD	801,900	3,648.00	2,925,331,200	
アドバンテッジリスクマネ	2,300	487.00	1,120,100	貸付株式数 900株
イー・ギャランティ	13,300	1,942.00	25,828,600	
アサックス	2,300	698.00	1,605,400	貸付株式数 1,300株
NECキャピタルソリューション	4,000	3,365.00	13,460,000	
T&Dホールディングス	235,400	2,186.50	514,702,100	
アドバンスクリエイト	4,600	1,002.00	4,609,200	貸付株式数 1,800株
三井不動産	376,100	3,472.00	1,305,819,200	
三菱地所	531,700	1,996.50	1,061,539,050	
平和不動産	13,200	4,035.00	53,262,000	
東京建物	71,100	2,101.50	149,416,650	
京阪神ビルディング	15,100	1,418.00	21,411,800	
住友不動産	117,700	4,174.00	491,279,800	
太平洋興発	1,800	795.00	1,431,000	貸付株式数 800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
テーオーシー	14,500	600.00	8,700,000	
東京楽天地	1,300	4,300.00	5,590,000	貸付株式数 500株
スターツコーポレーション	11,700	2,789.00	32,631,300	
フジ住宅	10,200	715.00	7,293,000	
空港施設	11,300	565.00	6,384,500	
明和地所	4,000	1,184.00	4,736,000	
ゴールドクレスト	6,600	2,007.00	13,246,200	貸付株式数 800株
リログループ	42,600	1,553.00	66,157,800	
エスリード	3,800	3,180.00	12,084,000	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	13,000	495.00	6,435,000	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	15,200	915.00	13,908,000	
MIRARTHホールディング	37,300	466.00	17,381,800	
AVANTIA	2,500	861.00	2,152,500	貸付株式数 900株
イオンモール	42,100	1,719.50	72,390,950	
毎日コムネット	1,600	743.00	1,188,800	貸付株式数 100株
ファースト住建	1,900	1,073.00	2,038,700	貸付株式数 900株
ランド	444,700	7.00	3,112,900	貸付株式数 171,300株
カチタス	21,900	2,150.00	47,085,000	
東祥	5,900	816.00	4,814,400	貸付株式数 2,000株
トーセイ	13,500	1,801.00	24,313,500	
穴吹興産	900	2,022.00	1,819,800	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	12,000	1,560.00	18,720,000	
インテリックス	1,100	501.00	551,100	
ランドビジネス	1,600	262.00	419,200	貸付株式数 700株
サンネクスタグループ	1,300	943.00	1,225,900	貸付株式数 200株
グランディハウス	5,300	590.00	3,127,000	
東武鉄道	90,600	3,655.00	331,143,000	
相鉄ホールディングス	29,500	2,682.50	79,133,750	
東急	231,500	1,735.50	401,768,250	
京浜急行	102,100	1,262.00	128,850,200	
小田急電鉄	136,500	2,079.50	283,851,750	
京王電鉄	39,700	4,263.00	169,241,100	
京成電鉄	53,200	5,960.00	317,072,000	
富士急行	10,200	4,330.00	44,166,000	貸付株式数 3,700株
東日本旅客鉄道	151,700	7,995.00	1,212,841,500	
西日本旅客鉄道	97,900	5,847.00	572,421,300	
東海旅客鉄道	318,000	3,550.00	1,128,900,000	
西武ホールディングス	99,900	1,784.50	178,271,550	
鴻池運輸	14,000	1,969.00	27,566,000	
西日本鉄道	22,000	2,367.50	52,085,000	
ハマキョウレックス	7,000	4,005.00	28,035,000	
サカイ引越センター	9,100	2,612.00	23,769,200	
近鉄グループHLDGS	82,400	4,146.00	341,630,400	
阪急阪神HLDGS	109,900	4,471.00	491,362,900	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
南海電鉄	36,700	2,802.50	102,851,750	貸付株式数 1,300株
京阪ホールディングス	45,400	3,692.00	167,616,800	
神戸電鉄	2,200	2,938.00	6,463,600	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	85,000	2,164.50	183,982,500	
山陽電鉄	6,100	2,123.00	12,950,300	貸付株式数 2,300株
アルプス物流	6,500	1,613.00	10,484,500	貸付株式数 2,200株
トランコム	2,400	7,560.00	18,144,000	
ヤマトホールディングス	105,600	2,628.50	277,569,600	
山 九	21,000	5,039.00	105,819,000	
日 新	6,300	2,510.00	15,813,000	
丸 運	2,600	260.00	676,000	貸付株式数 1,300株
丸全昭和運輸	5,100	3,740.00	19,074,000	
センコーグループHLDGS	43,500	1,057.00	45,979,500	
トナミホールディングス	1,800	4,630.00	8,334,000	
ニッコンホールディングス	26,400	3,217.00	84,928,800	
日石輸送	500	2,844.00	1,422,000	
福山通運	9,400	3,665.00	34,451,000	
セイノーホールディングス	46,300	2,083.00	96,442,900	
エスライングループ本社	1,300	859.00	1,116,700	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,300	3,045.00	7,003,500	
AZ-COM丸和ホールディング	19,900	1,501.00	29,869,900	貸付株式数 7,900株
C&Fロジホールディングス	7,900	1,511.00	11,936,900	貸付株式数 800株
日本郵船	236,300	3,974.00	939,056,200	
商船三井	178,900	4,061.00	726,512,900	
川崎汽船	69,700	5,189.00	361,673,300	貸付株式数 27,800株
NSユニテッド海運	4,400	4,865.00	21,406,000	貸付株式数 1,500株
明海グループ	5,000	692.00	3,460,000	
飯野海運	30,200	1,223.00	36,934,600	
共栄タンカー	800	826.00	660,800	貸付株式数 200株
九州旅客鉄道	58,200	3,091.00	179,896,200	
SGホールディングス	138,400	2,137.50	295,830,000	
NIPPON EXPRESS	28,000	8,071.00	225,988,000	
ID&Eホールディングス	5,100	3,275.00	16,702,500	
日本航空	202,400	2,811.00	568,946,400	
ANAホールディングス	224,300	3,052.00	684,563,600	
ビーウィズ	2,100	2,271.00	4,769,100	貸付株式数 800株
パスコ	900	1,689.00	1,520,100	
TREホールディングス	16,200	1,122.00	18,176,400	
人・夢・技術グループ	3,200	1,854.00	5,932,800	
西本WISMETTACHD	2,200	6,190.00	13,618,000	貸付株式数 700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
シルバーライフ	1,700	1,034.00	1,757,800	貸付株式数 600株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400	2,122.00	848,800	
GENKY DRUG STORES	3,800	5,100.00	19,380,000	貸付株式数 1,300株
コア商事HLDGS	4,800	735.00	3,528,000	貸付株式数 1,800株
KPPグループホールディングン	22,600	709.00	16,023,400	
ナルミヤ・インターナショナル	800	1,128.00	902,400	貸付株式数 100株
ブックオフGHD	4,400	1,085.00	4,774,000	貸付株式数 1,700株
ギフトホールディングス	3,700	2,032.00	7,518,400	
三菱倉庫	20,300	4,431.00	89,949,300	
三井倉庫HOLD	7,700	4,835.00	37,229,500	
住友倉庫	22,200	2,439.00	54,145,800	
渋沢倉庫	3,700	2,833.00	10,482,100	
ヤマタネ	3,900	2,248.00	8,767,200	
東陽倉庫	1,200	1,518.00	1,821,600	
乾汽船	9,600	1,214.00	11,654,400	貸付株式数 1,800株
日本トランスシティ	16,400	622.00	10,200,800	
ケイヒン	800	1,761.00	1,408,800	
中央倉庫	4,400	1,124.00	4,945,600	貸付株式数 1,500株
川西倉庫	800	1,085.00	868,000	貸付株式数 200株
安田倉庫	5,500	1,125.00	6,187,500	
ファイブホールディングス	700	1,084.00	758,800	貸付株式数 400株
NISSOHD	7,300	786.00	5,737,800	
大栄環境	15,400	2,321.00	35,743,400	
日本管財ホールディングク	8,900	2,488.00	22,143,200	
東洋埠頭	1,300	1,375.00	1,787,500	
上組	39,500	3,239.00	127,940,500	
サンリツ	1,100	736.00	809,600	貸付株式数 300株
キムラユニティー	2,100	1,423.00	2,988,300	
キューソー流通システム	3,200	902.00	2,886,400	貸付株式数 1,200株
東海運	2,600	285.00	741,000	
エアアイテイー	5,100	1,664.00	8,486,400	
内外トランスライン	3,300	2,519.00	8,312,700	貸付株式数 1,200株
ショーエイコーポ	1,400	585.00	819,000	貸付株式数 600株
日本コンセプト	3,000	1,683.00	5,049,000	
TBSホールディングス	42,400	2,746.50	116,451,600	
日本テレビHLD S	73,200	1,441.00	105,481,200	
朝日放送グループHD	7,600	643.00	4,886,800	貸付株式数 2,600株
テレビ朝日HD	19,900	1,675.00	33,332,500	
スカパーJ SATHD	64,200	678.00	43,527,600	
テレビ東京HD	5,900	2,990.00	17,641,000	
日本BS放送	1,600	887.00	1,419,200	
ビジョン	12,500	1,162.00	14,525,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スマートバリュー	1,100	420.00	462,000	貸付株式数 400株
USEN-NEXT HL DGS	9,300	3,775.00	35,107,500	貸付株式数 3,300株
ワイヤレスゲート	2,000	191.00	382,000	貸付株式数 100株
日本通信	81,600	227.00	18,523,200	
クロップス	600	1,001.00	600,600	
日本電信電話	24,635,400	173.10	4,264,387,740	
KDDI	640,000	4,625.00	2,960,000,000	
ソフトバンク	1,332,400	1,798.50	2,396,321,400	
光通信	8,300	22,990.00	190,817,000	
エムティーアイ	5,600	602.00	3,371,200	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	30,600	2,376.50	72,720,900	
ファイバーゲート	4,500	961.00	4,324,500	貸付株式数 200株
アイドママーケティングコミュ	1,200	235.00	282,000	貸付株式数 600株
KADOKAWA	43,800	2,664.00	116,683,200	
学研ホールディングス	13,700	977.00	13,384,900	
ゼンリン	14,000	894.00	12,516,000	
昭文社ホールディングス	1,900	357.00	678,300	
インプレスホールディングス	4,600	182.00	837,200	貸付株式数 1,800株
東京電力HD	744,300	630.90	469,578,870	貸付株式数 255,600株
中部電力	304,300	1,827.00	555,956,100	
関西電力	318,900	1,971.00	628,551,900	
中国電力	143,500	976.40	140,113,400	
北陸電力	84,400	722.30	60,962,120	
東北電力	217,400	946.90	205,856,060	
四国電力	76,900	1,023.00	78,668,700	
九州電力	190,400	990.60	188,610,240	
北海道電力	79,700	625.80	49,876,260	
沖縄電力	21,000	1,084.00	22,764,000	
電源開発	67,800	2,297.50	155,770,500	
エフオン	5,300	476.00	2,522,800	
イーレックス	14,600	659.00	9,621,400	貸付株式数 5,800株
レノバ	22,000	1,055.00	23,210,000	貸付株式数 8,800株
東京瓦斯	174,500	3,427.00	598,011,500	
大阪瓦斯	167,200	2,880.00	481,536,000	
東邦瓦斯	35,700	2,635.50	94,087,350	
北海道瓦斯	4,900	2,261.00	11,078,900	貸付株式数 1,000株
広島ガス	17,100	374.00	6,395,400	
西部ガスHLDGS	8,500	1,873.00	15,920,500	
静岡ガス	16,400	1,020.00	16,728,000	
メタウォーター	9,900	2,049.00	20,285,100	
アイネット	5,000	1,900.00	9,500,000	
松竹	4,300	9,378.00	40,325,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
東 宝	46,100	5,131.00	236,539,100	
エイチ・アイ・エス	24,700	1,722.00	42,533,400	貸付株式数 9,800 株
東 映	2,700	17,720.00	47,844,000	
ラックランド	3,800	2,735.00	10,393,000	貸付株式数 1,500 株
NTTデータグループ	216,600	1,797.00	389,230,200	
共立メンテナンス	13,300	5,739.00	76,328,700	貸付株式数 5,300 株
イチネンホールディングス	8,900	1,543.00	13,732,700	
建設技術研究所	4,400	4,855.00	21,362,000	
スペース	5,500	907.00	4,988,500	
アインホールディングス	12,000	4,500.00	54,000,000	
燦ホールディングス	8,000	1,104.00	8,832,000	
ピー・シー・エー	4,800	1,173.00	5,630,400	
スバル興業	500	13,230.00	6,615,000	貸付株式数 100 株
東京テアトル	1,700	1,092.00	1,856,400	
タナベコンサルティンググループ	2,500	1,040.00	2,600,000	
ビジネスB太田昭和	3,200	2,138.00	6,841,600	
ナ ガ ロ	2,600	6,690.00	17,394,000	貸付株式数 1,000 株
東京都競馬	7,100	4,410.00	31,311,000	貸付株式数 2,800 株
常磐興産	1,800	1,236.00	2,224,800	貸付株式数 700 株
カナモト	13,200	2,580.00	34,056,000	
D T S	17,600	3,515.00	61,864,000	
スクウェア・エニックス・HD	37,800	5,132.00	193,989,600	
シーイーシー	10,500	1,795.00	18,847,500	
カプコン	74,000	4,983.00	368,742,000	
ニシオホールディングス	7,900	3,640.00	28,756,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,503.00	6,312,600	貸付株式数 1,200 株
アゴーラ ホスピタリティーG	29,800	23.00	685,400	貸付株式数 15,600 株
日本空港ビルデング	28,800	6,500.00	187,200,000	
トランス・コスモス	10,600	3,100.00	32,860,000	貸付株式数 3,200 株
乃村工藝社	37,000	840.00	31,080,000	
ジャステック	5,100	1,463.00	7,461,300	貸付株式数 1,500 株
S C S K	58,000	2,724.00	157,992,000	
藤田観光	3,400	3,970.00	13,498,000	貸付株式数 1,300 株
KNT-CTホールディングス	5,100	1,245.00	6,349,500	貸付株式数 1,900 株
トーカイ	7,500	1,915.00	14,362,500	
白 洋 舎	700	2,430.00	1,701,000	貸付株式数 100 株
セコム	86,400	10,295.00	889,488,000	
NSW	3,700	2,935.00	10,859,500	
セントラル警備保障	4,600	2,454.00	11,288,400	貸付株式数 100 株
アイネス	6,400	1,666.00	10,662,400	
丹青社	16,400	890.00	14,596,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メイテックグループホール デ	30,600	2,867.50	87,745,500	
TKC	13,100	3,540.00	46,374,000	
富士ソフト	16,600	5,990.00	99,434,000	貸付株式数 6,600 株
応用地質	7,900	2,091.00	16,518,900	
船井総研ホールディン グ	17,600	2,521.00	44,369,600	
NSD	29,500	2,800.00	82,600,000	
進学会ホールディングス	1,200	275.00	330,000	
丸紅建材リース	400	2,546.00	1,018,400	
オ オ バ	2,900	918.00	2,662,200	貸付株式数 1,300 株
コナミグループ	31,000	7,315.00	226,765,000	
いであ	1,200	1,756.00	2,107,200	
学 究 社	3,400	1,934.00	6,575,600	
ベネッセホールディングス	28,600	2,608.00	74,588,800	
イオンディライト	9,400	3,515.00	33,041,000	貸付株式数 3,200 株
ナック	3,600	985.00	3,546,000	貸付株式数 1,200 株
福井コンピュータHLDS	5,100	2,643.00	13,479,300	
ダイセキ	17,300	3,920.00	67,816,000	貸付株式数 5,900 株
ステップ	3,100	1,875.00	5,812,500	
泉州電業	4,400	3,395.00	14,938,000	貸付株式数 700 株
元気寿司	4,900	3,190.00	15,631,000	貸付株式数 1,800 株
トラスコ中山	18,300	2,377.00	43,499,100	
ヤマダホールディングス	268,600	428.50	115,095,100	
オートバックスセブン	30,300	1,545.50	46,828,650	
モリト	6,200	1,295.00	8,029,000	
アーケランズ	25,900	1,648.00	42,683,200	
ニトリホールディングス	31,800	17,060.00	542,508,000	
グルメ杵屋	6,900	1,060.00	7,314,000	貸付株式数 2,500 株
愛 眼	3,500	172.00	602,000	貸付株式数 1,800 株
ケーユーホールディングス	4,000	1,126.00	4,504,000	
吉野家ホールディングス	32,200	3,270.00	105,294,000	貸付株式数 13,200 株
加藤産業	10,900	4,680.00	51,012,000	
北恵	1,200	830.00	996,000	貸付株式数 400 株
イノテック	5,400	1,729.00	9,336,600	
イエローハット	13,900	1,778.00	24,714,200	
松屋フーズHLDGS	4,000	5,000.00	20,000,000	貸付株式数 200 株
JBCCHホールディングス	5,500	3,175.00	17,462,500	
JKホールディングス	6,600	967.00	6,382,200	
サガミホールディングス	13,000	1,380.00	17,940,000	貸付株式数 500 株
日 伝	5,900	2,651.00	15,640,900	
関西フードマーケット	5,900	1,415.00	8,348,500	貸付株式数 1,000 株 (1,000 株)
ミロク情報サービス	7,500	1,737.00	13,027,500	貸付株式数 2,700 株
北沢産業	2,900	280.00	812,000	貸付株式数 1,400 株
杉本商事	4,200	2,246.00	9,433,200	貸付株式数 400 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
因幡電機産業	22,600	3,280.00	74,128,000	
王将フードサービス	6,500	8,010.00	52,065,000	貸付株式数 1,500 株
ミニストップ	6,400	1,512.00	9,676,800	貸付株式数 2,400 株
アークス	16,000	2,718.00	43,488,000	
バローホールディングス	16,600	2,371.00	39,358,600	
東 テ ク	2,900	4,745.00	13,760,500	
ミスミグループ本社	131,900	2,400.00	316,560,000	
アルテック	2,500	232.00	580,000	
ベ ル ク	4,300	6,370.00	27,391,000	
大 庄	3,600	1,261.00	4,539,600	貸付株式数 1,400 株
タキヒヨー	1,200	1,018.00	1,221,600	貸付株式数 700 株
ファーストリテイリング	39,300	37,490.00	1,473,357,000	貸付株式数 15,200 株
ソフトバンクグループ	408,500	6,020.00	2,459,170,000	
蔵王産業	800	2,401.00	1,920,800	
スズケン	33,200	5,043.00	167,427,600	
サンドラッグ	29,500	4,475.00	132,012,500	
サックスパーホールディング グ	7,400	895.00	6,623,000	
ジェコス	5,100	1,060.00	5,406,000	
ヤマザワ	1,000	1,259.00	1,259,000	
や ま や	1,000	3,040.00	3,040,000	貸付株式数 400 株
グローセル	8,900	641.00	5,704,900	
ベルーナ	20,900	626.00	13,083,400	
合計			278,401,688,320	

(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
トヨタ自動車	60,000 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。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月30日現在 金額(円)	2023年11月30日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	298,172,503	309,769,003
国債証券	104,845,798,810	93,894,775,530
地方債証券	2,911,753,400	6,120,781,600
特殊債券	2,016,980,400	2,795,288,600
社債券	2,780,464,900	8,088,307,100
未収入金	100,751,000	-
未収利息	218,481,441	221,388,521
前払費用	3,435,238	9,434,239
流動資産合計	113,175,837,692	111,439,744,593
資産合計	113,175,837,692	111,439,744,593
負債の部		
流動負債		
未払金	-	96,080,000
未払解約金	99,099,215	13,606,818
流動負債合計	99,099,215	109,686,818
負債合計	99,099,215	109,686,818
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	83,142,525,531	82,851,732,167
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	29,934,212,946	28,478,325,608
元本等合計	113,076,738,477	111,330,057,775
純資産合計	113,076,738,477	111,330,057,775
負債純資産合計	113,175,837,692	111,439,744,593

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 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首	2021 年 12 月 1 日	2022 年 12 月 1 日
期首元本額	66,960,247,306 円	83,142,525,531 円
期中追加設定元本額	28,030,628,143 円	20,248,665,071 円
期中一部解約元本額	11,848,349,918 円	20,539,458,435 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファン ド 30VA (一般投資家私募)	52,917,204 円	45,308,502 円
ダイワ国内重視バランスファン ド 50VA (一般投資家私募)	281,234,952 円	236,159,177 円
ダイワ国際分散バランスファン ド 30VA (一般投資家私募)	46,312,087 円	37,299,453 円
ダイワ国際分散バランスファン ド 50VA (一般投資家私募)	572,435,304 円	523,999,150 円
DCダイワ日本債券インデック ス	10,377,310,449 円	10,596,563,344 円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	1,548,164,674 円	9,631,665,187 円
ダイワ・バランスファンド 35 VA	8,977,064,441 円	8,365,243,656 円
ダイワ・バランスファンド 25 VA (適格機関投資家専用)	1,543,317,679 円	1,477,234,743 円
ダイワ国内バランスファンド 2 5VA (適格機関投資家専用)	189,833,127 円	197,493,843 円
ダイワ国内バランスファンド 3 0VA (適格機関投資家専用)	241,971,948 円	212,842,015 円
ダイワ・ノーロード 日本債券フ ァンド	63,243,630 円	65,102,953 円
ダイワファンドラップ 日本債券 インデックス	26,333,485,063 円	27,224,231,107 円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	22,413,934,040円	13,853,994,971円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	2,111,247,399円	2,120,651,560円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	872,287,058円	819,920,641円
ダイワ投信倶楽部日本債券イン デックス	6,396,124,679円	6,233,967,736円
ダイワライフスタイル25	432,831,898円	445,077,928円
ダイワライフスタイル50	548,823,097円	599,475,391円
ダイワライフスタイル75	139,986,802円	165,500,810円
計	83,142,525,531円	82,851,732,167円
2. 期末日における受益権の総数	83,142,525,531口	82,851,732,167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12月1日 至2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年11月30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	2022年11月30日現在	2023年11月30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	△4,707,923,020	△1,845,271,090
地方債証券	△97,363,200	△52,707,100
特殊債証券	△79,586,200	△37,764,000
社債証券	△92,144,400	△85,938,200
合計	△4,977,016,820	△2,021,680,390

(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

2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3600円	1.3437円
(1万口当たり純資産額)	(13,600円)	(13,437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	4 4 3 2年国債	200,000,000	200,080,000	
	4 4 5 2年国債	100,000,000	100,040,000	
	4 4 8 2年国債	240,000,000	240,050,400	
	4 4 9 2年国債	550,000,000	550,038,500	
	4 5 0 2年国債	180,000,000	180,000,000	
	4 5 2 2年国債	40,000,000	40,000,000	
	4 5 3 2年国債	70,000,000	69,974,100	
	1 4 2 5年国債	980,000,000	981,283,800	
	1 4 3 5年国債	2,470,000,000	2,474,001,400	
	1 4 4 5年国債	1,300,000,000	1,302,210,000	
	1 4 5 5年国債	1,770,000,000	1,773,026,700	
	1 4 6 5年国債	1,080,000,000	1,081,652,400	
	1 4 7 5年国債	1,630,000,000	1,628,679,700	
	1 4 8 5年国債	1,200,000,000	1,198,464,000	
	1 4 9 5年国債	860,000,000	858,555,200	
	1 5 0 5年国債	1,050,000,000	1,047,438,000	
	1 5 1 5年国債	800,000,000	797,368,000	
	1 5 2 5年国債	200,000,000	199,966,000	
	1 5 3 5年国債	750,000,000	746,812,500	
	1 5 4 5年国債	730,000,000	728,751,700	
	1 5 5 5年国債	730,000,000	733,817,900	
	1 5 6 5年国債	360,000,000	360,432,000	
	1 5 7 5年国債	200,000,000	200,042,000	
	1 5 8 5年国債	500,000,000	497,975,000	
	1 6 1 5年国債	280,000,000	281,008,000	
	1 6 2 5年国債	200,000,000	200,474,000	
	1 4 0年国債	70,000,000	81,582,200	
	2 4 0年国債	110,000,000	123,442,000	
	3 4 0年国債	150,000,000	168,058,500	
	4 4 0年国債	180,000,000	201,668,400	
	5 4 0年国債	185,000,000	199,026,700	
	6 4 0年国債	285,000,000	299,663,250	
	7 4 0年国債	121,000,000	121,363,000	
	8 4 0年国債	230,000,000	213,720,600	
9 4 0年国債	220,000,000	149,171,000		
1 0 4 0年国債	230,000,000	183,089,200		
1 1 4 0年国債	320,000,000	244,364,800		
1 2 4 0年国債	380,000,000	257,529,800		
1 3 4 0年国債	360,000,000	241,106,400		

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 4 4 0年国債	430,000,000	307,299,500	
	1 5 4 0年国債	430,000,000	338,212,200	
	1 6 4 0年国債	500,000,000	430,565,000	
	3 3 7 1 0年国債	400,000,000	401,368,000	
	3 3 8 1 0年国債	580,000,000	583,201,600	
	3 3 9 1 0年国債	590,000,000	593,746,500	
	3 4 0 1 0年国債	760,000,000	765,411,200	
	3 4 1 1 0年国債	500,000,000	502,820,000	
	3 4 2 1 0年国債	710,000,000	710,972,700	
	3 4 3 1 0年国債	780,000,000	780,889,200	
	3 4 4 1 0年国債	780,000,000	780,756,600	
	3 4 5 1 0年国債	950,000,000	950,427,500	
	3 4 6 1 0年国債	780,000,000	779,867,400	
	3 4 7 1 0年国債	1,100,000,000	1,099,021,000	
	3 4 8 1 0年国債	1,050,000,000	1,048,204,500	
	3 4 9 1 0年国債	1,250,000,000	1,246,475,000	
	3 5 0 1 0年国債	900,000,000	896,355,000	
	3 5 1 1 0年国債	600,000,000	596,754,000	
	3 5 3 1 0年国債	930,000,000	922,346,100	
	3 5 4 1 0年国債	730,000,000	723,138,000	
	3 5 5 1 0年国債	430,000,000	425,420,500	
	3 5 6 1 0年国債	700,000,000	691,614,000	
	3 5 7 1 0年国債	750,000,000	739,762,500	
	3 5 8 1 0年国債	450,000,000	442,926,000	
	3 5 9 1 0年国債	800,000,000	785,680,000	
	3 6 0 1 0年国債	1,000,000,000	979,480,000	
	3 6 1 1 0年国債	430,000,000	419,998,200	
	3 6 2 1 0年国債	790,000,000	769,641,700	
	3 6 3 1 0年国債	1,200,000,000	1,165,920,000	
	3 6 4 1 0年国債	1,000,000,000	968,500,000	
	3 6 5 1 0年国債	800,000,000	772,832,000	
	3 6 6 1 0年国債	950,000,000	923,238,500	
	3 6 7 1 0年国債	900,000,000	872,487,000	
	3 6 8 1 0年国債	700,000,000	676,585,000	
	3 6 9 1 0年国債	680,000,000	673,288,400	
	3 7 0 1 0年国債	1,130,000,000	1,116,598,200	
	3 7 1 1 0年国債	650,000,000	635,095,500	
	3 7 2 1 0年国債	120,000,000	121,434,000	
	1 3 0年国債	16,000,000	18,291,680	
	2 3 0年国債	184,000,000	207,220,800	
	3 3 0年国債	30,000,000	33,698,700	
	4 3 0年国債	36,000,000	42,116,760	
	5 3 0年国債	28,000,000	31,539,200	
	6 3 0年国債	24,000,000	27,516,000	
	7 3 0年国債	55,000,000	62,887,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	8 30年国債	27,000,000	29,835,540	
	9 30年国債	43,000,000	45,973,020	
	10 30年国債	45,000,000	46,899,000	
	11 30年国債	40,000,000	43,895,200	
	12 30年国債	60,000,000	68,111,400	
	13 30年国債	75,000,000	84,473,250	
	14 30年国債	82,000,000	95,666,120	
	15 30年国債	50,000,000	58,929,000	
	16 30年国債	250,000,000	295,045,000	
	17 30年国債	130,000,000	152,201,400	
	18 30年国債	80,000,000	92,915,200	
	19 30年国債	57,000,000	66,250,530	
	21 30年国債	60,000,000	69,816,000	
	22 30年国債	170,000,000	201,793,400	
	24 30年国債	92,000,000	109,399,960	
	25 30年国債	150,000,000	174,732,000	
	26 30年国債	180,000,000	211,941,000	
	27 30年国債	150,000,000	178,588,500	
	28 30年国債	270,000,000	321,467,400	
	29 30年国債	200,000,000	235,496,000	
	30 30年国債	220,000,000	255,574,000	
	31 30年国債	300,000,000	343,731,000	
	32 30年国債	285,000,000	330,212,400	
	33 30年国債	280,000,000	311,102,400	
	34 30年国債	270,000,000	307,794,600	
	35 30年国債	250,000,000	276,697,500	
	36 30年国債	350,000,000	386,501,500	
	37 30年国債	450,000,000	488,947,500	
	38 30年国債	260,000,000	277,274,400	
	39 30年国債	270,000,000	292,064,400	
	40 30年国債	240,000,000	255,081,600	
	41 30年国債	210,000,000	219,347,100	
	42 30年国債	205,000,000	213,874,450	
	43 30年国債	260,000,000	270,933,000	
	44 30年国債	300,000,000	312,483,000	
	45 30年国債	250,000,000	251,002,500	
	46 30年国債	210,000,000	210,508,200	
	47 30年国債	370,000,000	377,252,000	
	48 30年国債	280,000,000	274,722,000	
	49 30年国債	220,000,000	215,461,400	
	50 30年国債	310,000,000	267,917,500	
	51 30年国債	340,000,000	260,705,200	
	52 30年国債	350,000,000	280,521,500	
	53 30年国債	250,000,000	204,455,000	
	54 30年国債	310,000,000	264,761,700	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	5 5 3 0年国債	260,000,000	221,390,000	
	5 6 3 0年国債	340,000,000	288,632,800	
	5 7 3 0年国債	320,000,000	270,832,000	
	5 8 3 0年国債	430,000,000	362,825,400	
	5 9 3 0年国債	300,000,000	246,117,000	
	6 0 3 0年国債	220,000,000	188,799,600	
	6 1 3 0年国債	300,000,000	244,287,000	
	6 2 3 0年国債	280,000,000	215,600,000	
	6 3 3 0年国債	300,000,000	223,752,000	
	6 4 3 0年国債	260,000,000	193,141,000	
	6 5 3 0年国債	270,000,000	199,945,800	
	6 6 3 0年国債	270,000,000	198,976,500	
	6 7 3 0年国債	300,000,000	233,022,000	
	6 8 3 0年国債	340,000,000	263,374,200	
	6 9 3 0年国債	310,000,000	246,167,900	
	7 0 3 0年国債	330,000,000	261,399,600	
	7 1 3 0年国債	310,000,000	244,940,300	
	7 2 3 0年国債	320,000,000	252,204,800	
	7 3 3 0年国債	310,000,000	243,709,600	
	7 4 3 0年国債	320,000,000	272,256,000	
	7 5 3 0年国債	330,000,000	302,590,200	
	7 6 3 0年国債	310,000,000	290,891,600	
	7 7 3 0年国債	275,000,000	270,440,500	
	7 8 3 0年国債	240,000,000	224,599,200	
	7 9 3 0年国債	290,000,000	257,926,000	
	8 0 3 0年国債	80,000,000	82,232,800	
	7 4 2 0年国債	73,000,000	74,632,280	
	7 5 2 0年国債	80,000,000	82,208,000	
	7 6 2 0年国債	51,000,000	52,275,000	
	7 7 2 0年国債	130,000,000	133,419,000	
	7 8 2 0年国債	61,000,000	62,806,820	
	7 9 2 0年国債	50,000,000	51,558,500	
	8 0 2 0年国債	53,000,000	54,734,160	
	8 2 2 0年国債	87,000,000	90,285,120	
	8 3 2 0年国債	93,000,000	96,957,150	
	8 5 2 0年国債	58,000,000	60,743,400	
	8 6 2 0年国債	80,000,000	84,152,000	
	8 7 2 0年国債	55,000,000	57,728,000	
	8 9 2 0年国債	78,000,000	82,261,140	
	9 0 2 0年国債	20,000,000	21,194,400	
	9 2 2 0年国債	310,000,000	329,065,000	
	9 3 2 0年国債	100,000,000	106,246,000	
	9 4 2 0年国債	130,000,000	138,547,500	
	9 5 2 0年国債	50,000,000	53,853,500	
	9 6 2 0年国債	55,000,000	58,850,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	97 20年国債	40,000,000	43,116,800	
	98 20年国債	320,000,000	343,721,600	
	99 20年国債	100,000,000	107,788,000	
	100 20年国債	155,000,000	168,283,500	
	101 20年国債	350,000,000	382,980,500	
	108 20年国債	300,000,000	324,612,000	
	109 20年国債	55,000,000	59,682,700	
	110 20年国債	260,000,000	284,853,400	
	111 20年国債	200,000,000	220,988,000	
	112 20年国債	150,000,000	164,920,500	
	113 20年国債	310,000,000	341,920,700	
	114 20年国債	70,000,000	77,420,000	
	115 20年国債	180,000,000	200,149,200	
	116 20年国債	200,000,000	223,008,000	
	117 20年国債	200,000,000	221,774,000	
	118 20年国債	95,000,000	104,970,250	
	119 20年国債	93,000,000	101,537,400	
	120 20年国債	317,000,000	342,046,170	
	121 20年国債	200,000,000	220,012,000	
	122 20年国債	200,000,000	218,686,000	
	123 20年国債	200,000,000	223,088,000	
	124 20年国債	300,000,000	332,577,000	
	125 20年国債	130,000,000	146,230,500	
	126 20年国債	110,000,000	122,134,100	
	127 20年国債	250,000,000	275,810,000	
	128 20年国債	250,000,000	276,167,500	
	129 20年国債	200,000,000	219,476,000	
	130 20年国債	140,000,000	153,783,000	
	131 20年国債	150,000,000	163,639,500	
	132 20年国債	100,000,000	109,203,000	
	133 20年国債	100,000,000	109,977,000	
	134 20年国債	30,000,000	33,041,700	
	135 20年国債	92,000,000	100,595,560	
	136 20年国債	550,000,000	597,014,000	
	138 20年国債	300,000,000	323,406,000	
	139 20年国債	370,000,000	401,890,300	
	140 20年国債	570,000,000	624,246,900	
	141 20年国債	400,000,000	438,340,000	
	142 20年国債	240,000,000	265,068,000	
	143 20年国債	210,000,000	228,293,100	
	144 20年国債	140,000,000	150,963,400	
	145 20年国債	340,000,000	373,109,200	
	146 20年国債	20,000,000	21,945,200	
	147 20年国債	480,000,000	522,038,400	
	148 20年国債	360,000,000	387,849,600	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 4 9 20年国債	532,000,000	572,969,320	
	1 5 0 20年国債	480,000,000	511,689,600	
	1 5 1 20年国債	480,000,000	501,019,200	
	1 5 2 20年国債	520,000,000	542,110,400	
	1 5 3 20年国債	570,000,000	599,816,700	
	1 5 4 20年国債	630,000,000	655,055,100	
	1 5 5 20年国債	480,000,000	487,334,400	
	1 5 6 20年国債	330,000,000	311,209,800	
	1 5 7 20年国債	560,000,000	512,898,400	
	1 5 8 20年国債	350,000,000	331,831,500	
	1 5 9 20年国債	500,000,000	478,290,000	
	1 6 0 20年国債	460,000,000	444,323,200	
	1 6 1 20年国債	470,000,000	446,495,300	
	1 6 2 20年国債	530,000,000	501,549,600	
	1 6 3 20年国債	480,000,000	452,438,400	
	1 6 4 20年国債	430,000,000	398,119,800	
	1 6 5 20年国債	370,000,000	341,084,500	
	1 6 6 20年国債	600,000,000	567,276,000	
	1 6 7 20年国債	400,000,000	365,700,000	
	1 6 8 20年国債	420,000,000	376,324,200	
	1 6 9 20年国債	400,000,000	350,980,000	
	1 7 0 20年国債	420,000,000	366,618,000	
	1 7 1 20年国債	350,000,000	303,919,000	
	1 7 2 20年国債	200,000,000	175,790,000	
	1 7 3 20年国債	510,000,000	445,964,400	
	1 7 4 20年国債	600,000,000	521,928,000	
	1 7 5 20年国債	400,000,000	352,380,000	
	1 7 6 20年国債	480,000,000	421,008,000	
	1 7 7 20年国債	530,000,000	454,363,700	
	1 7 8 20年国債	510,000,000	443,322,600	
	1 7 9 20年国債	440,000,000	380,740,800	
	1 8 0 20年国債	490,000,000	446,194,000	
	1 8 1 20年国債	500,000,000	462,160,000	
	1 8 2 20年国債	340,000,000	324,574,200	
	1 8 3 20年国債	390,000,000	390,585,000	
	1 8 4 20年国債	400,000,000	379,460,000	
	1 8 5 20年国債	440,000,000	415,905,600	
	1 8 6 20年国債	170,000,000	171,836,000	
	2 7 メキシコ国債	100,000,000	97,203,900	
	1 1 フィリピン共和国	100,000,000	98,493,900	
国債証券 合計			93,894,775,530	
地方債証券	7 5 1 東京都公債	100,000,000	100,480,900	
	7 9 6 東京都公債	100,000,000	97,735,600	
	8 0 8 東京都公債	100,000,000	97,100,800	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	8 2 7 東京都公債	100,000,000	96,800,500	
	4 東京都5年	200,000,000	199,640,200	
	1 6 東京都20年	100,000,000	108,126,900	
	3-5 北海道公債	100,000,000	96,225,600	
	3 7-2 宮城県公債	100,000,000	95,959,700	
	2 2 2 神奈川県公債	100,000,000	99,722,900	
	3 1 神奈川県20年	100,000,000	99,956,900	
	4 2 0 大阪府公債	200,000,000	199,501,400	
	7 大阪府20年	200,000,000	217,828,800	
	2-1 京都府公債	200,000,000	195,446,600	
	2 6-1 7 兵庫県公債	100,000,000	100,457,000	
	3 兵庫県公債12年	200,000,000	201,271,800	
	1 9 兵庫県公債20年	100,000,000	107,108,100	
	2-1 静岡県公債	100,000,000	97,746,600	
	8 静岡県20年	200,000,000	220,437,400	
	2 1-5 愛知県公債	100,000,000	110,189,600	
	2 7-1 2 愛知県15年	100,000,000	101,374,000	
	2 9-5 広島県公債	100,000,000	99,798,500	
	2-7 埼玉県公債	100,000,000	97,106,600	
	4 埼玉県30年	100,000,000	95,063,500	
	9 埼玉県20年	100,000,000	110,407,500	
	1 2 埼玉県20年	100,000,000	108,405,800	
	2 9-1 福岡県公債	100,000,000	99,869,300	
	5-1 福岡県公債	100,000,000	99,066,000	
	2 2-1 福岡県15年	100,000,000	103,036,200	
	1 3 千葉県20年	100,000,000	108,350,600	
	1 6 千葉県20年	100,000,000	106,961,100	
	2 8-2 新潟県公債	100,000,000	99,918,200	
	1 5 3 共同発行地方	200,000,000	201,360,000	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	99,976,900	
	1 9 5 共同発行地方	100,000,000	97,835,700	
	1 9 6 共同発行地方	100,000,000	97,948,500	
	2 4 4 共同発行地方	200,000,000	196,232,400	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	97,085,600	
	2 7-1 滋賀県公債	100,000,000	100,679,300	
	1 1 名古屋市20年	200,000,000	219,899,400	
	1 0 京都市20年	100,000,000	108,783,600	
	2 0-1 神戸市20年	100,000,000	109,132,300	
	1 9 横浜市20年	100,000,000	110,025,700	
	2 6-5 札幌市15年	100,000,000	103,001,700	
	2-4 札幌市公債	100,000,000	97,166,400	
	4 川崎市公債30年	100,000,000	110,607,400	
	1 北九州市15年	100,000,000	102,862,700	
	2 3-4 福岡市20年	100,000,000	109,350,800	
	1-5 千葉市公債	100,000,000	97,531,700	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	3-2 徳島県公債	100,000,000	95,796,100	
	1-1 山梨県公債	100,000,000	97,694,700	
	2-2 岡山県公債	100,000,000	96,716,100	
地方債証券	合計		6,120,781,600	
特殊債券	47 日本政策投資CO	100,000,000	103,072,000	
	174 日本政策投資	300,000,000	294,632,700	
	247 道路機構	200,000,000	169,224,600	
	86 政保道路機構	100,000,000	108,948,800	
	223 政保道路機構	100,000,000	106,060,500	
	236 政保道路機構	100,000,000	100,307,500	
	261 政保道路機構	200,000,000	201,098,600	
	284 政保道路機構	200,000,000	179,730,600	
	298 政保道路機構	100,000,000	93,974,500	
	F143 地方公共団体	100,000,000	103,919,500	
	1 地方公共団15年	100,000,000	104,096,400	
	31 地方公共団20	100,000,000	108,294,000	
	F192 地方公共団体	100,000,000	103,546,200	
	F221 地方公共団体	200,000,000	208,144,400	
	F226 地方公共団体	100,000,000	103,311,100	
	71 地方公共団体	100,000,000	100,496,300	
	129 地方公共団体	200,000,000	194,647,800	
	127 都市再生	100,000,000	99,579,300	
	80 住宅支援機構	100,000,000	103,814,900	
	123 住宅支援機構	100,000,000	108,839,800	
	19 利付商工債	100,000,000	99,549,100	
特殊債券	合計		2,795,288,600	
社債券	20 成田国際空港	100,000,000	99,525,100	
	63 中日本高速道	100,000,000	100,700,200	
	101 中日本高速道	400,000,000	399,133,600	
	32 大和ハウス工業	300,000,000	299,927,400	
	22 積水ハウス	100,000,000	99,385,800	
	12 アサヒグループHD	100,000,000	99,718,200	
	11 サントリーホールディング	100,000,000	99,413,100	
	11 日本たばこ産業	100,000,000	100,667,800	
	11 ヒューリック	100,000,000	99,874,000	
	5 野村不動産HD	100,000,000	101,005,900	
	23 森ビル	100,000,000	90,065,400	
	14 セブンアンドアイ	100,000,000	99,761,400	
	18 セブンアンドアイ	100,000,000	100,833,200	
	35 東レ	300,000,000	299,706,000	
	1 レゾナックHD	100,000,000	99,335,500	
	4 アステラス製薬	300,000,000	299,652,600	
	20 ZHD	100,000,000	97,475,300	
	18 楽天グループ	100,000,000	66,261,200	
	2 AGC	100,000,000	97,810,500	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	7 日本製鉄	100,000,000	100,120,800	
	3 2 住友電工	100,000,000	99,137,100	
	1 6 クボタ	100,000,000	99,785,600	
	6 2 日本電気	200,000,000	197,093,800	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,049,200	
	1 5 デンソー	100,000,000	99,468,200	
	3 1 トヨタ自動車	100,000,000	97,542,300	
	6 楽天カード	100,000,000	89,980,800	
	3 オリックス銀行	200,000,000	198,928,000	
	1 日生2021基金	100,000,000	99,662,200	
	7 凸版印刷	100,000,000	102,483,800	
	3 1 豊田通商	200,000,000	197,633,600	
	6 3 住友商事	100,000,000	96,415,800	
	2 6 りそなホールディング	100,000,000	99,576,000	
	2 7 りそなホールディング	200,000,000	199,767,400	
	3 6 芙蓉総合リース	100,000,000	99,632,200	
	1 6 NTTファイナンス	100,000,000	99,802,000	
	5 6 日産フィナンシャル	100,000,000	98,884,500	
	8 1 ホンダファイナンス	100,000,000	99,434,900	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	99,568,700	
	4 2 リコーリース	100,000,000	99,460,600	
	2 2 イオンFS	200,000,000	198,496,400	
	3 6 三井住友F&L	200,000,000	199,344,600	
	1 SOMPOHD	100,000,000	100,021,500	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,610,900	
	8 2 三井不動産	100,000,000	99,294,100	
	1 4 3 三菱地所	100,000,000	98,829,400	
	1 1 1 住友不動産	100,000,000	99,952,600	
	1 3 NTTファイナンス	100,000,000	102,570,500	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	92,674,800	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	108,001,200	
	6 7 阪急阪神HLDG	100,000,000	97,374,900	
	6 8 名古屋鉄道	200,000,000	198,549,400	
	1 5 ソフトバンク	100,000,000	96,982,000	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	99,917,800	
	5 3 8 関西電力	100,000,000	95,470,400	
	4 4 8 中国電力	100,000,000	96,688,500	
	5 6 0 東北電力	200,000,000	192,045,200	
	3 3 2 北海道電力	100,000,000	92,124,000	
	3 4 沖縄電力	100,000,000	98,982,900	
	8 5 電源開発	100,000,000	100,570,400	
	1 1 東京電力パワー	100,000,000	99,838,900	
	1 6 JERA	100,000,000	99,812,000	
	6 5 東京瓦斯	100,000,000	96,250,400	
	5 0 大阪瓦斯	100,000,000	99,314,200	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	4 ファーストリテイリング	100,000,000	100,910,400	
社債券 合計			8,088,307,100	
合計			110,899,152,830	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月30日現在 金額(円)	2023年11月30日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,031,852,254	4,412,640,617
コール・ローン	17,666,040,102	21,476,693,013
株式	267,590,825,704	373,664,357,535
投資証券	6,560,957,279	7,914,490,575
派生商品評価勘定	654,308,499	767,966,339
未収入金	1,175,053	2,191,526
未収配当金	373,891,289	501,157,490
差入委託証拠金	4,463,843,737	7,673,160,653
流動資産合計	299,342,893,917	416,412,657,748
資産合計	299,342,893,917	416,412,657,748
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	869,807,209	430,202,473
未払金	5,561,220	-
未払解約金	94,261,100	112,438,900
流動負債合計	969,629,529	542,641,373
負債合計	969,629,529	542,641,373
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	69,133,888,947	78,806,686,628
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	229,239,375,441	337,063,329,747
元本等合計	298,373,264,388	415,870,016,375
純資産合計	298,373,264,388	415,870,016,375
負債純資産合計	299,342,893,917	416,412,657,748

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 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首	2021 年 12 月 1 日	2022 年 12 月 1 日
期首元本額	61,024,141,090 円	69,133,888,947 円
期中追加設定元本額	13,890,679,058 円	14,051,097,197 円
期中一部解約元本額	5,780,931,201 円	4,378,299,516 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	308,081,421 円	253,960,411 円
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA (一般投資家私募)	3,459,588 円	2,398,033 円
ダイワ国内重視バランスファンド 50VA (一般投資家私募)	38,681,400 円	27,113,381 円
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA (一般投資家私募)	6,474,561 円	4,173,336 円
ダイワ国際分散バランスファンド 50VA (一般投資家私募)	180,994,510 円	132,412,472 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)	67,499,826 円	99,283,243 円
ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用)	-円	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)	507,554,812 円	751,588,780 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)	2,997,935,211 円	4,575,264,354 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)	637,435,268 円	565,403,560 円
D-I's 外国株式インデックス	18,410,629 円	20,741,287 円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	45,911,834 円	52,732,027 円
i F r e e 外国株式インデック ス (為替ヘッジなし)	5,903,409,265 円	7,602,914,266 円
i F r e e 8資産バランス	1,346,263,819 円	1,483,695,864 円
i F r e e 年金バランス	249,849,751 円	320,411,034 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	3,052,677 円
DCダイワ外国株式インデック ス	43,789,686,887 円	47,516,377,923 円
ダイワ・ライフ・バランス30	521,693,855 円	507,111,516 円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,000,508,647 円	1,075,299,438 円
ダイワ・ライフ・バランス70	822,473,467 円	1,029,409,746 円
大和DC海外株式インデックス ファンド	1,893,327,736 円	2,012,098,874 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	12,179,865 円	12,430,841 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	12,114,090 円	12,894,554 円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	1,381,872,090 円	2,126,545,615 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	1,875,196 円	2,059,357 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,222,293 円	2,504,278 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	4,706,722 円	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)	4,098,586 円	11,365,941 円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	72,721,941 円	54,089,276 円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	53,797,340 円	34,472,185 円
ダイワ・バランスファンド35 VA	1,210,030,069 円	912,121,494 円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	62,518,246 円	48,039,078 円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	173,081,567 円	140,584,660 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,145,121,735 円	1,397,074,322 円
ダイワ・ノーロード 外国株式フ ァンド	424,216,950 円	429,662,271 円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワS MA専用)	1,263,595,028 円	2,299,488,278 円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,883,082,448 円	3,021,971,653 円
ダイワライフスタイル25	10,488,019 円	8,689,227 円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
ダイワライフスタイル50	43,394,568円	39,113,782円
ダイワライフスタイル75	33,119,707円	32,628,804円
ダイワバランスファンド2023-08 (適格機関投資家専用)	-円	89,653,999円
計	69,133,888,947円	78,806,686,628円
2. 期末日における受益権の総数	69,133,888,947口	78,806,686,628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12月1日 至2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年11月30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11月30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11月30日現在	2023年11月30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	△39,581,029,860	39,406,570,740
投資証券	△1,505,805,187	△350,897,450
合計	△41,086,835,047	39,055,673,290

(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11月30日現在				2023年11月30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								
株価指数 先物取引								
買建	23,750,625,017	-	24,154,881,137	404,256,120	33,591,785,481	-	34,198,119,607	606,334,126
合計	23,750,625,017	-	24,154,881,137	404,256,120	33,591,785,481	-	34,198,119,607	606,334,126

- (注)
- 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。
 - 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。
 - 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。
 - 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11月30日現在				2023年11月30日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	17,573,621,210	-	16,953,866,380	△619,754,830	21,334,077,040	-	21,065,506,780	△268,570,260
アメリカ・ドル	12,336,972,570	-	11,834,462,290	△502,510,280	14,981,847,160	-	14,646,268,980	△335,578,180
イギリス・ポンド	828,018,030	-	813,955,170	△14,062,860	1,079,899,470	-	1,101,174,230	21,274,760
イスラエル・シケル	32,484,240	-	32,263,680	△220,560	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	594,996,870	-	584,194,590	△10,802,280	630,276,320	-	642,564,780	12,288,460
カナダ・ドル	847,777,660	-	806,418,570	△41,359,090	1,248,114,090	-	1,243,166,100	△4,947,990
スイス・フラン	829,345,070	-	815,725,680	△13,619,390	1,013,961,080	-	1,027,848,170	13,887,090
ユーロ	2,104,026,770	-	2,066,846,400	△37,180,370	2,379,978,920	-	2,404,484,520	24,505,600
合計	17,573,621,210	-	16,953,866,380	△619,754,830	21,334,077,040	-	21,065,506,780	△268,570,260

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
1口当たり純資産額	4.3159円	5.2771円
(1万口当たり純資産額)	(43,159円)	(52,771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	5,700	190.640	1,086,648.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	14,800	288.910	4,275,868.000	
	FIRST SOLAR INC	4,900	155.430	761,607.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,600	137.880	1,185,768.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,200	124.470	771,714.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,100	114.260	354,206.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	31.220	658,742.000	
	ABBOTT LABORATORIES	84,066	103.630	8,711,759.580	
	HOWMET AEROSPACE INC	18,983	51.590	979,332.970	
	VERISK ANALYTICS INC	7,100	238.260	1,691,646.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	16,600	45.340	752,644.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	28,800	90.180	2,597,184.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	552.460	1,215,412.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	28,700	58.180	1,669,766.000	
	QORVO INC	4,820	95.890	462,189.800	
	AFLAC INC	27,800	81.630	2,269,314.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,900	155.730	918,807.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,900	83.600	660,440.000	
	ADOBE INC	22,020	617.390	13,594,927.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,400	74.750	702,650.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,600	438.350	2,454,760.000	
	GARMIN LTD	7,400	121.000	895,400.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,700	266.480	2,851,336.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,200	194.260	6,255,172.000	
	WR BERKLEY CORP	10,142	70.570	715,720.940	
	AUTOZONE INC	920	2,596.510	2,388,789.200	
	DOLLAR TREE INC	10,271	121.120	1,244,023.520	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	58,300	9.690	564,927.000	
	CELANESE CORP	4,950	137.440	680,328.000	
	DR HORTON INC	14,916	127.260	1,898,210.160	
	DENTSPLY SIRONA INC	10,300	31.330	322,699.000	
	AUTODESK INC	10,300	213.850	2,202,655.000	
	MOODY'S CORP	8,000	361.890	2,895,120.000	
	DEVON ENERGY CORP	31,000	44.880	1,391,280.000	
	ALBEMARLE CORP	5,700	123.380	703,266.000	
	ATMOS ENERGY CORP	7,000	112.050	784,350.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	12,200	49.940	609,268.000	
	CITIGROUP INC	94,173	45.750	4,308,414.750	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,000	229.160	4,583,200.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	24,900	79.215	1,972,453.500	
DOMINO'S PIZZA INC	1,730	388.860	672,727.800		
HESS CORP	13,400	139.560	1,870,104.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DAVITA INC	2,750	99.610	273,927.500	
	DANAHER CORP	33,950	222.520	7,554,554.000	
	FORTIVE CORP	17,100	67.710	1,157,841.000	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	27,100	112.690	3,053,899.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,300	73.190	1,924,897.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	15,195	130.430	1,981,883.850	
	APPLE INC	760,400	189.370	143,996,948.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,400	88.890	1,102,236.000	
	BOEING CO/THE	27,700	224.430	6,216,711.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,615	100.660	766,525.900	
	BECTON DICKINSON AND CO	13,699	235.690	3,228,717.310	
	LEIDOS HOLDINGS INC	6,300	106.220	669,186.000	
	NISOURCE INC	20,000	25.810	516,200.000	
	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,500	81.570	448,635.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,571	47.550	1,786,501.050	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	203,404	37.760	7,680,535.040	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	62,750	358.690	22,507,797.500	
	ANSYS INC	4,200	298.860	1,255,212.000	
	TRUIST FINANCIAL CORP	64,417	32.130	2,069,718.210	
	BLACKSTONE GROUP INC/THE	34,200	111.370	3,808,854.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	101,600	48.720	4,949,952.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	141,270	154.320	21,800,786.400	
	T ROWE PRICE GROUP INC	10,900	99.160	1,080,844.000	
	LKQ CORP	12,900	44.390	572,631.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,012	58.230	874,148.760	
	CADENCE DESIGN SYS INC	13,200	275.210	3,632,772.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,000	348.350	1,741,750.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	10,600	128.880	1,366,128.000	
	SERVICENOW INC	9,900	678.930	6,721,407.000	
	CATERPILLAR INC	24,900	249.450	6,211,305.000	
	BROWN & BROWN INC	11,700	72.970	853,749.000	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	12,100	35.370	427,977.000	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	2,500	197.100	492,750.000	
	CMS ENERGY CORP	14,100	56.750	800,175.000	
	MOSAIC CO/THE	16,100	36.420	586,362.000	
	DELTA AIR LINES INC	7,800	36.640	285,792.000	
	CORNING INC	39,100	28.220	1,103,402.000	
	CISCO SYSTEMS INC	197,050	48.050	9,468,252.500	
	MORGAN STANLEY	60,552	78.550	4,756,359.600	
	DECKERS OUTDOOR CORP	1,300	654.990	851,487.000	
	MSCI INC	3,900	526.570	2,053,623.000	
	FAIR ISAAC CORP	1,200	1,075.100	1,290,120.000	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	1,500	401.150	601,725.000	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,200	223.610	715,552.000	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,800	56.000	604,800.000	
	BROADCOM INC	19,912	940.830	18,733,806.960	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	2,300	232.070	533,761.000	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	127.950	396,645.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,000	164.010	984,060.000	
	ARAMARK	12,000	27.780	333,360.000	
	DTE ENERGY COMPANY	10,000	104.140	1,041,400.000	
	CENTENE CORP	26,507	70.480	1,868,213.360	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,100	179.500	915,450.000	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,400	27.240	637,416.000	
	DARLING INGREDIENTS INC	7,500	41.640	312,300.000	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,400	245.020	2,548,208.000	
	GARTNER INC	3,850	430.120	1,655,962.000	
	SPLUNK INC	7,600	150.600	1,144,560.000	
	DOMINION ENERGY INC	40,441	46.730	1,889,807.930	
	MONSTER BEVERAGE CORP	38,000	54.710	2,078,980.000	
	SMITH (A. O.) CORP	6,000	75.100	450,600.000	
	DEERE & CO	13,500	363.940	4,913,190.000	
	QUANTA SERVICES INC	7,000	185.610	1,299,270.000	
	POOL CORP	1,900	345.320	656,108.000	
	GLOBAL PAYMENTS INC	12,684	116.360	1,475,910.240	
	BURLINGTON STORES INC	3,100	171.520	531,712.000	
	NASDAQ INC	16,600	55.700	924,620.000	
	VAIL RESORTS INC	1,900	215.220	408,918.000	
	TARGA RESOURCES CORP	10,400	88.010	915,304.000	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,400	110.870	376,958.000	
	WESTLAKE CORP	1,800	128.770	231,786.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	16,800	89.940	1,510,992.000	
	COGNEX CORP	8,400	37.610	315,924.000	
	WEBSTER FINANCIAL CORP	8,500	44.540	378,590.000	
	TELEFLEX INC	2,300	221.250	508,875.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,000	182.050	728,200.000	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,600	348.920	1,256,112.000	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,100	304.490	334,939.000	
	CATALENT INC	8,700	39.570	344,259.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,000	173.360	1,213,520.000	
	MOLINA HEALTHCARE INC	2,800	350.820	982,296.000	
	CARLISLE COS INC	2,500	275.110	687,775.000	
	IDEX CORP	3,700	198.300	733,710.000	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	38,100	77.880	2,967,228.000	
	ROLLINS INC	11,607	40.190	466,485.330	
	AECOM	6,400	87.800	561,920.000	
	WATSCO INC	1,600	380.450	608,720.000	
	GRACO INC	8,000	80.100	640,800.000	
	AMETEK INC	11,200	152.880	1,712,256.000	
	TORO CO	4,900	82.510	404,299.000	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	11,800	94.660	1,116,988.000	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,850	53.230	417,855.500	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HEICO CORP	2,100	168.770	354,417.000	
	GENERAC HOLDINGS INC	3,000	115.600	346,800.000	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,800	454.390	817,902.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,600	94.000	1,184,400.000	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	2,000	407.310	814,620.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	21,360	587.860	12,556,689.600	
	EPAM SYSTEMS INC	2,800	261.980	733,544.000	
	RPM INTERNATIONAL INC	6,200	101.260	627,812.000	
	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,800	270.250	756,700.000	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,300	2,189.110	2,845,843.000	
	CUMMINS INC	6,800	223.950	1,522,860.000	
	CDW CORP/DE	6,500	212.090	1,378,585.000	
	COSTAR GROUP INC	19,800	83.940	1,662,012.000	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,800	383.910	1,842,768.000	
	MERCADOLIBRE INC	2,190	1,610.580	3,527,170.200	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,500	156.010	546,035.000	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,816	166.660	2,135,914.560	
	DEXCOM INC	18,700	116.180	2,172,566.000	
	NORDSON CORP	2,490	232.600	579,174.000	
	COPART INC	41,500	50.220	2,084,130.000	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,300	153.790	1,276,457.000	
	SEAGEN INC	6,800	213.520	1,451,936.000	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	3,500	216.480	757,680.000	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,800	216.820	823,916.000	
	TRANSDIGM GROUP INC	2,690	952.820	2,563,085.800	
	BIO-TECHNE CORP	7,620	63.120	480,974.400	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,600	113.540	522,284.000	
	KINDER MORGAN INC	97,481	17.320	1,688,370.920	
	HCA HEALTHCARE INC	10,200	249.080	2,540,616.000	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,800	237.090	426,762.000	
	COTERRA ENERGY INC	36,600	26.090	954,894.000	
	T-MOBILE US INC	26,027	149.550	3,892,337.850	
	ZILLOW GROUP INC - C	7,450	42.290	315,060.500	
	COCA-COLA CO/THE	198,750	58.230	11,573,212.500	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,700	59.700	638,790.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	119.520	878,472.000	
	FRANKLIN RESOURCES INC	14,000	24.590	344,260.000	
	CSX CORP	99,100	31.730	3,144,443.000	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,300	214.090	920,587.000	
	EXPEDIA GROUP INC	6,825	135.750	926,493.750	
	AMAZON.COM INC	446,700	146.320	65,361,144.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29,300	67.430	1,975,699.000	
	EXXON MOBIL CORP	195,505	102.340	20,007,981.700	
	AES CORP	32,400	17.220	557,928.000	
	EVEREST GROUP LTD	2,100	402.340	844,914.000	
	EOG RESOURCES INC	28,300	123.240	3,487,692.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EQT CORP	17,500	39.750	695,625.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,300	115.700	844,610.000	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	1,442.370	721,185.000	
	CENCORA INC	8,300	199.520	1,656,016.000	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,300	127.590	1,824,537.000	
	FORD MOTOR CO	190,123	10.590	2,013,402.570	
	EXACT SCIENCES CORP	8,700	65.060	566,022.000	
	ENTEGRIS INC	7,200	104.510	752,472.000	
	AERCAP HOLDINGS NV	8,200	66.480	545,136.000	
	FORTINET INC	32,300	53.600	1,731,280.000	
	MARKEL CORP	610	1,415.160	863,247.600	
	NEXTERA ENERGY INC	97,880	58.360	5,712,276.800	
	FREEPORT-MCMORAN INC	69,308	37.170	2,576,178.360	
	INSULET CORP	3,400	188.920	642,328.000	
	US BANCORP	74,100	37.790	2,800,239.000	
	UNITED RENTALS INC	3,300	476.220	1,571,526.000	
	F5 NETWORKS INC	2,900	170.050	493,145.000	
	SUPER MICRO COMPUTER INC	2,500	287.630	719,075.000	
	FASTENAL CO	27,600	59.640	1,646,064.000	
	FISERV INC	29,833	129.360	3,859,196.880	
	GENERAL ELECTRIC CO	52,706	118.860	6,264,635.160	
	AXON ENTERPRISE INC	3,400	225.860	767,924.000	
	PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	155.030	341,066.000	
	GENERAL MOTORS CO	67,300	31.600	2,126,680.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	11,300	244.830	2,766,579.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,150	340.260	5,495,199.000	
	FIRST HORIZON CORP	25,700	12.650	325,105.000	
	ALPHABET INC-CL A	287,300	134.990	38,782,627.000	
	ALPHABET INC-CL C	255,440	136.400	34,842,016.000	
	OWENS CORNING	4,400	134.140	590,216.000	
	GENERAL MILLS INC	28,300	62.590	1,771,297.000	
	FIRSTENERGY CORP	26,318	36.980	973,239.640	
	GENUINE PARTS CO	6,850	133.860	916,941.000	
	FIFTH THIRD BANCORP	33,000	28.410	937,530.000	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,250	188.660	1,745,105.000	
	HALLIBURTON CO	43,600	37.300	1,626,280.000	
	REPLIGEN CORP	2,600	159.490	414,674.000	
	HOME DEPOT INC	48,650	311.020	15,131,123.000	
	ASSURANT INC	2,650	163.800	434,070.000	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,800	11.130	776,874.000	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,910	233.750	446,462.500	
	HERSHEY CO/THE	7,100	185.720	1,318,612.000	
	HUMANA INC	6,000	482.410	2,894,460.000	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,600	204.330	2,574,558.000	
	HENRY SCHEIN INC	6,300	66.660	419,958.000	
	HP INC	47,300	29.070	1,375,011.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	62,500	16.520	1,032,500.000	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,000	82.380	1,482,840.000	
	KRAFT HEINZ CO/THE	41,803	35.080	1,466,449.240	
	ENPHASE ENERGY INC	6,600	100.960	666,336.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,900	156.410	6,866,399.000	
	HUBBELL INC	2,600	294.660	766,116.000	
	INTERNATIONAL PAPER CO	16,000	35.790	572,640.000	
	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	6,100	68.040	415,044.000	
	ZOETIS INC	22,400	175.790	3,937,696.000	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,999	222.630	2,448,707.370	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	59.060	401,608.000	
	CHENIERE ENERGY INC	11,700	180.440	2,111,148.000	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	113.810	261,763.000	
	ALLEGION PLC	4,350	104.590	454,966.500	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,800	134.890	917,252.000	
	WASTE CONNECTIONS INC	12,537	132.640	1,662,907.680	
	JUNIPER NETWORKS INC	15,600	28.040	437,424.000	
	JM SMUCKER CO/THE	5,000	108.580	542,900.000	
	JOHNSON & JOHNSON	116,500	152.110	17,720,815.000	
	ABBVIE INC	85,272	138.500	11,810,172.000	
	HOLOGIC INC	11,900	70.600	840,140.000	
	KIMBERLY-CLARK CORP	16,300	121.770	1,984,851.000	
	KROGER CO	33,000	43.640	1,440,120.000	
	KLA CORP	6,600	544.070	3,590,862.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	11,000	445.010	4,895,110.000	
	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,400	237.230	806,582.000	
	BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	32.050	336,525.000	
	LOWE'S COS INC	28,300	199.920	5,657,736.000	
	ELI LILLY & CO	38,985	591.860	23,073,662.100	
	LAM RESEARCH CORP	6,480	713.990	4,626,655.200	
	LOEWS CORP	9,400	68.510	643,994.000	
	MCDONALD'S CORP	35,350	280.380	9,911,433.000	
	3M CO	26,690	98.470	2,628,164.300	
	META PLATFORMS INC CLASS A	107,000	332.200	35,545,400.000	
	S&P GLOBAL INC	15,939	414.640	6,608,946.960	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,000	462.730	1,388,190.000	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,720	78.550	213,656.000	
	PHILLIPS 66	22,200	122.220	2,713,284.000	
	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,300	195.550	1,427,515.000	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	39.430	632,851.500	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,100	64.280	777,788.000	
	METLIFE INC	31,500	63.160	1,989,540.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	41,600	56.100	2,333,760.000	
	ARISTA NETWORKS INC	12,700	219.300	2,785,110.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,098	319.040	2,583,585.920	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,100	1,092.430	1,201,673.000	
	BAKER HUGHES CO	49,023	33.340	1,634,426.820	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	5,600	270.560	1,515,136.000	
	MERCK & CO. INC.	122,721	101.130	12,410,774.730	
	DUPONT DE NEMOURS INC	22,551	71.440	1,611,043.440	
	MASCO CORP	10,900	60.370	658,033.000	
	M & T BANK CORP	7,999	127.730	1,021,712.270	
	MARSH & MCLENNAN COS	23,870	196.330	4,686,397.100	
	HEICO CORP-CLASS A	3,620	135.990	492,283.800	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,402	202.480	2,511,156.960	
	WORKDAY INC-CLASS A	10,000	263.490	2,634,900.000	
	BLOCK INC CLASS A	26,312	63.730	1,676,863.760	
	TRANSUNION	9,300	58.790	546,747.000	
	VISTRA CORP	17,600	34.920	614,592.000	
	NETAPP INC	10,300	89.540	922,262.000	
	NIKE INC -CL B	59,600	110.370	6,578,052.000	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	11,000	215.080	2,365,880.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,300	82.980	2,182,374.000	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,605	103.750	996,518.750	
	ALLY FINANCIAL INC	14,200	28.640	406,688.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	7,000	467.410	3,271,870.000	
	APTIV PLC	13,700	82.270	1,127,099.000	
	NEWMONT CORP	38,411	40.380	1,551,036.180	
	MCKESSON CORP	6,500	456.700	2,968,550.000	
	XYLEM INC	11,600	103.500	1,200,600.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	75,100	93.650	7,033,115.000	
	NUCOR CORP	12,200	163.780	1,998,116.000	
	GODADDY INC - CLASS A	7,000	97.920	685,440.000	
	EVERGY INC	11,150	50.640	564,636.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	60.330	2,022,502.920	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,250	286.970	358,712.500	
	OKTA INC	7,500	70.770	530,775.000	
	LIBERTY BROADBAND-C	5,800	82.410	477,978.000	
	WIX.COM LTD	2,810	102.110	286,929.100	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	16,800	29.960	503,328.000	
	KKR & CO INC	29,200	74.740	2,182,408.000	
	PAYCHEX INC	15,700	121.150	1,902,055.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	973.940	2,824,426.000	
	ALTRIA GROUP INC	86,300	41.760	3,603,888.000	
	P G & E CORP	92,000	17.170	1,579,640.000	
	PFIZER INC	273,113	30.080	8,215,239.040	
	CIGNA CORP	14,300	262.870	3,759,041.000	
	DELL TECHNOLOGIES -C	12,401	75.060	930,819.060	
	XCEL ENERGY INC	26,600	60.000	1,596,000.000	
	STERIS PLC	4,800	197.440	947,712.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SEA LTD-ADR	19,000	36.740	698,060.000	
	FOX CORP - CLASS B	6,533	27.690	180,898.770	
	FOX CORP - CLASS A	13,699	29.580	405,216.420	
	STRYKER CORP	16,480	294.370	4,851,217.600	
	DOW INC	34,218	51.330	1,756,409.940	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,300	95.010	503,553.000	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,500	67.950	781,425.000	
	PARKER HANNIFIN CORP	6,200	428.060	2,653,972.000	
	UBER TECHNOLOGIES INC	88,100	56.400	4,968,840.000	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,300	229.880	2,597,644.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	113,967	151.130	17,223,832.710	
	EXELON CORP	48,122	38.390	1,847,403.580	
	INGERSOLL-RAND INC	19,608	69.600	1,364,716.800	
	NVR INC	160	6,107.110	977,137.600	
	CONOCOPHILLIPS	58,502	113.970	6,667,472.940	
	TWILIO INC - A	8,300	66.130	548,879.000	
	DOCUSIGN INC	9,800	43.620	427,476.000	
	PAYCOM SOFTWARE INC	2,500	181.290	453,225.000	
	CERIDIAN HCM HOLDING INC	7,100	69.130	490,823.000	
	PEPSICO INC	66,600	167.160	11,132,856.000	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,220	199.260	442,357.200	
	DROPBOX INC-CLASS A	12,600	28.080	353,808.000	
	MONGODB INC	3,400	420.510	1,429,734.000	
	SNAP INC - A	49,700	12.980	645,106.000	
	CORTEVA INC	34,368	45.500	1,563,744.000	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,600	96.600	1,700,160.000	
	AMCOR PLC	71,100	9.490	674,739.000	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,800	234.440	2,531,952.000	
	ROKU INC	6,000	106.750	640,500.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,400	131.220	1,233,468.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	30,500	333.340	10,166,870.000	
	PENTAIR PLC	7,975	63.720	508,167.000	
	QUALCOMM INC	53,900	127.910	6,894,349.000	
	INVESCO LTD	16,700	14.280	238,476.000	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,800	74.170	875,206.000	
	DATADOG INC - CLASS A	12,200	116.650	1,423,130.000	
	PINTEREST INC- CLASS A	28,700	33.280	955,136.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,200	808.590	4,204,668.000	
	REPUBLIC SERVICES INC	10,700	159.930	1,711,251.000	
	BOOKING HOLDINGS INC	1,800	3,126.290	5,627,322.000	
	ROSS STORES INC	16,500	129.200	2,131,800.000	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	4,330	161.850	700,810.500	
	RESMED INC	7,100	158.850	1,127,835.000	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	5,430	135.270	734,516.100	
	ROBERT HALF INTL INC	5,200	80.500	418,600.000	
	MODERNA INC	15,700	79.010	1,240,457.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HUBSPOT INC	2,280	496.520	1,132,065.600	
	REVVITY INC	6,100	89.410	545,401.000	
	CARRIER GLOBAL CORP	40,387	52.210	2,108,605.270	
	OTIS WORLDWIDE CORP	20,038	84.330	1,689,804.540	
	BILL HOLDINGS INC	4,500	67.940	305,730.000	
	AVANTOR INC	32,700	20.860	682,122.000	
	CARLYLE GROUP INC/THE	10,200	34.520	352,104.000	
	DYNATRACE INC	12,200	53.430	651,846.000	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,500	70.370	1,512,955.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	45,385	16.470	747,490.950	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	13,200	14.220	187,704.000	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,400	26.900	494,960.000	
	MATCH GROUP INC	13,500	32.480	438,480.000	
	CHEVRON CORP	87,818	143.910	12,637,888.380	
	ZSCALER INC	4,200	199.840	839,328.000	
	EDISON INTERNATIONAL	18,500	65.780	1,216,930.000	
	ETSY INC	6,000	77.200	463,200.000	
	TESLA INC	137,950	244.140	33,679,113.000	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	12,600	175.320	2,209,032.000	
	GEN DIGITAL INC	27,900	21.770	607,383.000	
	UNITY SOFTWARE INC	11,300	30.360	343,068.000	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	7,402	91.460	676,986.920	
	SYNOPSIS INC	7,400	552.460	4,088,204.000	
	CHEWY INC - CLASS A	5,750	17.730	101,947.500	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	13,300	78.310	1,041,523.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,005	398.900	1,996,494.500	
	VIATRIS INC	58,021	9.130	529,731.730	
	DOORDASH INC - A	12,250	94.960	1,163,260.000	
	ROBLOX CORP -CLASS A	20,300	38.680	785,204.000	
	AIRBNB INC-CLASS A	19,900	126.480	2,516,952.000	
	CBRE GROUP INC - A	15,000	79.380	1,190,700.000	
	SOUTHERN CO/THE	52,700	70.230	3,701,121.000	
	SYSCO CORP	24,500	71.710	1,756,895.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	11,203	177.440	1,987,860.320	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	54.540	158,166.000	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	5,300	57.880	306,764.000	
	STEEL DYNAMICS INC	8,150	115.490	941,243.500	
	SCHLUMBERGER LTD	68,952	51.870	3,576,540.240	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,400	32.370	239,538.000	
	AT&T INC	345,891	16.300	5,638,023.300	
	APA CORP	14,900	36.310	541,019.000	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	6,950	25.330	176,043.500	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,900	71.620	1,496,858.000	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,400	45.030	468,312.000	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,900	273.720	3,257,268.000	
	SEMPRA ENERGY	30,400	72.950	2,217,680.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	52.630	552,615.000	
	CLARIVATE PLC	17,500	7.700	134,750.000	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	87,700	19.840	1,739,968.000	
	UIPATH INC - CLASS A	17,500	19.870	347,725.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,850	78.480	694,548.000	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,100	127.820	1,035,342.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	43,900	153.200	6,725,480.000	
	SALESFORCE.COM INC	46,966	230.350	10,818,618.100	
	WESTROCK CO	12,400	40.100	497,240.000	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	19,209	92.270	1,772,414.430	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,234	52.760	1,753,425.840	
	TERADYNE INC	7,500	92.760	695,700.000	
	UNION PACIFIC CORP	29,480	221.470	6,528,935.600	
	MARATHON OIL CORP	29,900	25.300	756,470.000	
	MARATHON PETROLEUM CORP	22,188	147.420	3,270,954.960	
	RTX CORP	70,679	80.950	5,721,465.050	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	35,100	152.290	5,345,379.000	
	IQVIA HOLDINGS INC	9,004	213.810	1,925,145.240	
	AMEREN CORPORATION	12,700	76.990	977,773.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	44,966	534.980	24,055,910.680	
	TOAST INC CLASS A	14,400	15.270	219,888.000	
	VERISIGN INC	4,500	211.700	952,650.000	
	LUCID GROUP INC	44,900	4.360	195,764.000	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	30,900	17.320	535,188.000	
	ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	22,200	8.920	198,024.000	
	VALERO ENERGY CORP	17,642	124.080	2,189,019.360	
	ULTA BEAUTY INC	2,400	420.010	1,008,024.000	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	12,488	44.390	554,342.320	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,130	135.750	424,897.500	
	ELEVANCE HEALTH INC	11,500	465.360	5,351,640.000	
	WALT DISNEY CO/THE	88,362	92.500	8,173,485.000	
	WELLS FARGO & CO	177,122	43.780	7,754,401.160	
	WASTE MANAGEMENT INC	19,700	169.740	3,343,878.000	
	WILLIAMS COS INC	58,900	36.440	2,146,316.000	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,300	200.190	1,061,007.000	
	WHIRLPOOL CORP	2,700	109.630	296,001.000	
	WALMART INC	71,600	156.080	11,175,328.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,100	113.920	1,150,592.000	
	WYNN RESORTS LTD	5,000	83.670	418,350.000	
	GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	97,400	3.080	299,992.000	
	WABTEC CORP	8,711	115.200	1,003,507.200	
	TJX COMPANIES INC	55,600	88.100	4,898,360.000	
	WATERS CORP	2,900	279.740	811,246.000	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,500	236.620	591,550.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,500	19.980	709,290.000	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,063	240.770	1,219,018.510	
	WESTERN DIGITAL CORP	15,500	47.320	733,460.000	
	WEC ENERGY GROUP INC	15,300	82.970	1,269,441.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,100	63.290	1,525,289.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	78,250	254.230	19,893,497.500	
	PPL CORP	35,700	26.030	929,271.000	
	CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	15,724	120.580	1,895,999.920	
	PULTEGROUP INC	10,850	88.010	954,908.500	
	WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	111,853	10.780	1,205,775.340	
	PPG INDUSTRIES INC	11,400	139.550	1,590,870.000	
	NORTHERN TRUST CORP	10,100	78.280	790,628.000	
	FERGUSON PLC	9,900	168.680	1,669,932.000	
	NVIDIA CORP	119,480	481.400	57,517,672.000	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,313	132.380	2,556,654.940	
	DRAFTKINGS INC CLASS A	21,600	38.270	826,632.000	
	ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,400	186.580	261,212.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	13,800	47.090	649,842.000	
	NETFLIX INC	21,490	477.190	10,254,813.100	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,700	492.920	9,217,604.000	
	NRG ENERGY INC	11,150	46.850	522,377.500	
	GLOBE LIFE INC	4,255	120.260	511,706.300	
	TEXTRON INC	9,800	74.830	733,334.000	
	NEWS CORP - CLASS A	17,887	22.340	399,595.580	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,652.070	578,224.500	
	OMNICOM GROUP	9,700	79.790	773,963.000	
	JACOBS SOLUTIONS INC	6,120	126.200	772,344.000	
	ORACLE CORP	78,833	116.210	9,161,182.930	
	MASTERCARD INC - A	40,900	409.820	16,761,638.000	
	ONEOK INC	21,600	67.390	1,455,624.000	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	5,200	525.830	2,734,316.000	
	U HAUL NON VOTING SERIES N	4,600	53.650	246,790.000	
	ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	7,800	111.150	866,970.000	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,500	79.765	438,707.500	
	HF SINCLAIR CORP	7,300	52.730	384,929.000	
	OVINTIV INC	12,100	43.920	531,432.000	
	YUM! BRANDS INC	13,600	125.520	1,707,072.000	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,200	157.010	1,287,482.000	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,200	60.100	552,920.000	
	BANK OF AMERICA CORP	346,801	30.310	10,511,538.310	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,300	399.100	917,930.000	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,100	89.740	816,634.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	30,600	167.430	5,123,358.000	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	20,035	67.710	1,356,569.850	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	LINDE PLC	23,746	411.390	9,768,866.940	
	ANALOG DEVICES INC	24,191	182.710	4,419,937.610	
	ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	15,400	21.300	328,020.000	
	MONDAYCOM LTD	1,100	175.000	192,500.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	77,927	123.850	9,651,258.950	
	LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	8,028	26.940	216,274.320	
	LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	9,600	63.380	608,448.000	
	CONFLUENT INC CLASS A	8,500	21.220	180,370.000	
	KENVUE INC	74,100	20.080	1,487,928.000	
	GLOBAL E ONLINE LTD	4,700	34.370	161,539.000	
	VERALTO CORP	11,316	74.220	839,873.520	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	34,972	64.830	2,267,234.760	
	BUNGE GLOBAL LTD	7,300	108.100	789,130.000	
	LIBERTY GLOBAL LTD CLASS C	12,973	16.890	219,113.970	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,700	96.000	739,200.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,100	105.910	1,175,601.000	
	AVERY DENNISON CORP	3,930	192.360	755,974.800	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,500	70.120	1,717,940.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	27,600	88.310	2,437,356.000	
	AON PLC-CLASS A	9,900	322.100	3,188,790.000	
	AMGEN INC	25,800	266.600	6,878,280.000	
	EATON CORP PLC	19,336	225.800	4,366,068.800	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,000	237.950	1,903,600.000	
	APPLIED MATERIALS INC	40,600	149.360	6,064,016.000	
	CME GROUP INC	17,400	214.840	3,738,216.000	
	ECOLAB INC	12,400	188.630	2,339,012.000	
	EQUIFAX INC	5,900	216.600	1,277,940.000	
	GILEAD SCIENCES INC	60,300	75.230	4,536,369.000	
	KEURIG DR PEPPER INC	44,100	31.730	1,399,293.000	
	HORMEL FOODS CORP	14,500	30.470	441,815.000	
	STATE STREET CORP	16,713	71.740	1,198,990.620	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	72,740	59.610	4,336,031.400	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	24,400	36.400	888,160.000	
	CAMPBELL SOUP CO	9,400	39.760	373,744.000	
	CROWN HOLDINGS INC	5,780	84.070	485,924.600	
	CARDINAL HEALTH INC	12,300	105.300	1,295,190.000	
	FEDEX CORP	11,500	253.930	2,920,195.000	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	18,454	110.130	2,032,339.020	
	FMC CORP	6,050	52.680	318,714.000	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,313	75.230	926,306.990	
	INTEL CORP	201,700	44.940	9,064,398.000	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,700	30.640	572,968.000	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,050	76.980	1,158,549.000	
	WOLFSPEED INC	5,800	36.250	210,250.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ILLINOIS TOOL WORKS	14,700	240.830	3,540,201.000	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	4.700	181,420.000	
	ILLUMINA INC	7,600	101.570	771,932.000	
	SEALED AIR CORP	6,700	33.160	222,172.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	17,000	310.760	5,282,920.000	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,850	146.170	708,924.500	
	SNAP-ON INC	2,600	271.840	706,784.000	
	CARMAX INC	7,700	63.160	486,332.000	
	DUKE ENERGY CORP	37,328	90.710	3,386,022.880	
	TARGET CORP	22,300	131.320	2,928,436.000	
	DOVER CORP	6,800	140.770	957,236.000	
	WW GRAINGER INC	2,200	775.690	1,706,518.000	
	JABIL INC	6,800	115.240	783,632.000	
	CINTAS CORP	4,400	549.080	2,415,952.000	
	CONAGRA BRANDS INC	23,100	28.020	647,262.000	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,000	97.530	682,710.000	
	CLOROX COMPANY	6,000	142.340	854,040.000	
	ENTERGY CORP	10,200	100.590	1,026,018.000	
	MICROSOFT CORP	341,600	378.850	129,415,160.000	
	INCYTE CORP	9,200	53.390	491,188.000	
	CVS HEALTH CORP	61,969	66.900	4,145,726.100	
	MEDTRONIC PLC	64,298	78.860	5,070,540.280	
	MICRON TECHNOLOGY INC	53,000	76.690	4,064,570.000	
	BLACKROCK INC	7,200	747.300	5,380,560.000	
	CENTERPOINT ENERGY INC	30,500	27.890	850,645.000	
	HASBRO INC	6,400	46.430	297,152.000	
	KELLOGG CO	13,300	51.660	687,078.000	
	KEYCORP	45,300	12.440	563,532.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	65,911	70.440	4,642,770.840	
	COOPER COS INC/THE	2,400	331.590	795,816.000	
	CHUBB LTD	19,999	225.080	4,501,374.920	
	ARROW ELECTRONICS INC	2,900	119.580	346,782.000	
	ALLSTATE CORP	12,700	135.490	1,720,723.000	
	EBAY INC	25,900	40.640	1,052,576.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	51,250	57.970	2,970,962.500	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,800	83.190	482,502.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,200	125.600	1,406,720.000	
	TRIMBLE INC	12,000	45.920	551,040.000	
	LENNAR CORP-A	12,200	126.840	1,547,448.000	
	LEAR CORP	2,900	134.810	390,949.000	
	PROGRESSIVE CORP	28,300	163.000	4,612,900.000	
	PACCAR INC	25,255	91.310	2,306,034.050	
	BIOGEN INC	7,000	232.060	1,624,420.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	4,000	466.740	1,866,960.000	
	STARBUCKS CORP	55,400	99.850	5,531,690.000	
	PTC INC	5,400	155.490	839,646.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EVERSOURCE ENERGY	16,900	59.710	1,009,099.000	
	INTUIT INC	13,480	577.230	7,781,060.400	
	BORGWARNER INC	11,400	34.160	389,424.000	
	BEST BUY CO INC	9,550	70.780	675,949.000	
	BALL CORP	15,204	54.820	833,483.280	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,497	55.440	3,852,913.680	
	ELECTRONIC ARTS INC	12,800	137.310	1,757,568.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,400	212.680	1,361,152.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,500	351.000	4,387,500.000	
	VF CORP	16,000	17.130	274,080.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	27,125	14.410	390,871.250	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	87.800	219,500.000	
	CARNIVAL CORP	48,700	14.910	726,117.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	25,000	16.900	422,500.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	200,990	41.630	8,367,213.700	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	39.460	343,302.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	57,600	3.190	183,744.000	
	アメリカ・ドル 小計				1,905,237,535.260 (280,203,284,311)
イギリス・ポンド	SHELL PLC	316,434	25.535	8,080,142.190	
	HALEON PLC	264,482	3.311	875,699.900	
	WISE PLC CLASS A	30,273	7.812	236,492.670	
	BP PLC	818,883	4.719	3,864,718.310	
	UNILEVER PLC	119,031	37.535	4,467,828.580	
	BARCLAYS PLC	736,615	1.403	1,033,470.840	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	398,738	2.634	1,050,275.890	
	PRUDENTIAL PLC	130,355	8.542	1,113,492.410	
	NATWEST GROUP PLC	275,393	2.064	568,411.150	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,388	16.065	134,753.220	
	BAE SYSTEMS PLC	144,309	10.350	1,493,598.150	
	AVIVA PLC	127,014	4.156	527,870.180	
	GSK	193,876	14.010	2,716,202.760	
	INFORMA PLC	66,343	7.380	489,611.340	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	70,266	5.230	367,491.180	
	AUTO TRADER GROUP PLC	43,578	7.182	312,977.190	
	DCC PLC	4,696	53.620	251,799.520	
	OCADO GROUP PLC	27,677	5.936	164,290.670	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,502	91.760	321,343.520	
	HALMA PLC	18,019	21.240	382,723.560	
	ENTAIN PLC	30,469	8.002	243,812.930	
	JD SPORTS FASHION PLC	123,236	1.573	193,850.220	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	35,703	4.637	165,554.810	
	M&G PLC	104,504	2.104	219,876.410	
ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	18.340	167,645.940		
RELX PLC	89,622	30.460	2,729,886.120		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DIAGEO PLC	106,361	27.400	2,914,291.400	
	RIO TINTO PLC	53,307	54.000	2,878,578.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	112,254	6.404	718,874.610	
	TESCO PLC	338,702	2.844	963,268.480	
	SMITH & NEPHEW PLC	41,344	10.215	422,328.960	
	GLENCORE PLC	497,895	4.439	2,210,404.850	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,956	7.104	120,455.420	
	SMITHS GROUP PLC	16,614	16.365	271,888.110	
	PEARSON PLC	30,619	9.274	283,960.600	
	SAINSBURY (J) PLC	78,274	2.835	221,906.790	
	NEXT PLC	5,620	79.300	445,666.000	
	TAYLOR WIMPEY PLC	167,629	1.291	216,409.030	
	WHITBREAD PLC	9,218	31.100	286,679.800	
	BUNZL PLC	15,999	29.430	470,850.570	
	VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.708	811,193.690	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,627	44.500	294,901.500	
	KINGFISHER PLC	85,779	2.201	188,799.570	
	WPP PLC	50,889	7.030	357,749.670	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,280	11.250	363,150.000	
	SEVERN TRENT PLC	11,946	27.160	324,453.360	
	RENTOKIL INITIAL PLC	119,317	4.346	518,551.680	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,978	53.900	1,831,414.200	
	ST JAMES' S PLACE PLC	26,055	6.474	168,680.070	
	SCHRODERS PLC	39,815	4.010	159,658.150	
	SSE PLC	51,622	18.305	944,940.710	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,260	5.082	235,093.320	
	ASTRAZENECA PLC	73,382	100.320	7,361,682.240	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	283,052	2.285	646,773.820	
	3I GROUP PLC	46,084	22.310	1,028,134.040	
	ASHTAD GROUP PLC	20,746	47.340	982,115.640	
	SAGE GROUP PLC/THE	48,536	11.300	548,456.800	
	NATIONAL GRID PLC	174,349	10.255	1,787,948.990	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,016,079	0.434	1,310,486.320	
	IMPERIAL BRANDS PLC	40,812	18.345	748,696.140	
	CRH PLC	33,942	49.230	1,670,964.660	
	CENTRICA PLC	279,988	1.474	412,702.310	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,918	46.460	228,490.280	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	100,593	25.145	2,529,410.980	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,469	23.880	393,279.720	
	HSBC HOLDINGS PLC	934,951	5.948	5,561,088.540	
	ANGLO AMERICAN PLC	60,164	21.385	1,286,607.140	
	MONDI PLC	22,986	14.000	321,804.000	
	COMPASS GROUP PLC	82,031	20.170	1,654,565.270	
	PERSIMMON PLC	15,188	12.590	191,216.920	
	BT GROUP PLC	345,300	1.225	423,165.150	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	COCA-COLA HBC AG-DI	10,136	21.790	220,863.440	
	BURBERRY GROUP PLC	17,870	14.500	259,115.000	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,005	61.160	489,585.800	
	INTERTEK GROUP PLC	7,660	39.840	305,174.400	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,886	89.100	1,682,742.600	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,866	17.225	135,491.850	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,779	27.030	264,326.370	
	ANTOFAGASTA PLC	18,717	14.185	265,500.640	
	ABRDN PLC	90,862	1.672	151,921.260	
	EXPERIAN PLC	43,565	29.180	1,271,226.700	
イギリス・ポンド 小計				84,931,505.220 (15,868,602,435)	
イスラエル・シ ュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,314	18.530	1,191,738.420	
	AZRIELI GROUP LTD	2,207	221.700	489,291.900	
	ICL GROUP LTD	38,090	19.430	740,088.700	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,383	759.100	1,049,835.300	
	BANK HAPOALIM BM	66,050	32.000	2,113,600.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	79,801	28.800	2,298,268.800	
	NICE LTD	3,290	717.800	2,361,562.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,029	136.400	1,095,155.600	
イスラエル・シケル 小計				11,339,540.720 (452,599,625)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	100,640	4.560	458,918.400	
	TELSTRA GROUP LTD	182,347	3.780	689,271.660	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	135,560	24.180	3,277,840.800	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	124,781	3.420	426,751.020	
	BHP GROUP LTD	228,501	46.190	10,554,461.190	
	SOUTH32 LTD	205,649	3.060	629,285.940	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	85,646	31.000	2,655,026.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	76,385	24.780	1,892,820.300	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	141,629	28.100	3,979,774.900	
	WESTPAC BANKING CORP	158,275	21.150	3,347,516.250	
	SANTOS LTD	144,925	6.940	1,005,779.500	
	RIO TINTO LTD	16,744	124.580	2,085,967.520	
	ORIGIN ENERGY LTD	75,281	8.400	632,360.400	
	AURIZON HOLDINGS LTD	83,843	3.550	297,642.650	
	PILBARA MINERALS LTD	122,421	3.560	435,818.760	
	XERO LTD	6,482	102.080	661,682.560	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	33.500	347,998.000	
	COLES GROUP LTD	60,347	15.200	917,274.400	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,381	66.000	487,146.000	
	IDP EDUCATION LTD	11,169	22.890	255,658.410	
IGO LTD	30,405	8.530	259,354.650		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	51,949	12.670	658,193.830		
REECE LTD	10,500	18.840	197,820.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	64,915	4.890	317,434.350	
	SEEK LTD	16,268	23.380	380,345.840	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	30,976	10.620	328,965.120	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	75,526	103.330	7,804,101.580	
	AMPOL LTD	10,454	34.150	357,004.100	
	ORICA LTD	19,499	15.470	301,649.530	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	67,299	15.170	1,020,925.830	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,970	34.280	1,884,371.600	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	5.200	203,226.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	19,914	47.550	946,910.700	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,561	165.580	2,742,170.380	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,526	40.300	1,068,997.800	
	CSL LTD	21,758	262.200	5,704,947.600	
	WESFARMERS LTD	51,174	52.720	2,697,893.280	
	COCHLEAR LTD	2,968	267.000	792,456.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,666	20.310	419,726.460	
	SUNCORP GROUP LTD	57,284	13.630	780,780.920	
	ASX LTD	8,754	58.080	508,432.320	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	23.280	585,934.320	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	110,468	5.760	636,295.680	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,599	28.910	566,607.090	
	BRAMBLES LTD	62,638	13.060	818,052.280	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,602	61.230	465,470.460	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,291	49.000	406,259.000	
	REA GROUP LTD	2,395	158.440	379,463.800	
	オーストラリア・ドル 小計			68,272,785.580 (6,653,182,955)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	35,800	76.230	2,729,034.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	16,181	48.520	785,102.120	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	78.230	743,185.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	900	3,215.720	2,894,148.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,587	94.690	1,286,553.030	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,900	66.680	1,393,612.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	8,150	208.890	1,702,453.500	
	BCE INC	4,930	53.120	261,881.600	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,800	154.990	1,363,912.000	
	SUNCOR ENERGY INC	60,630	44.830	2,718,042.900	
	METRO INC/CN	10,700	69.180	740,226.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	15,500	89.520	1,387,560.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	54,800	59.710	3,272,108.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,700	53.360	2,225,112.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	84,600	83.300	7,047,180.000	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	12,500	43.050	538,125.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	63,750	118.810	7,574,137.500	
	TOURMALINE OIL CORP	14,800	65.330	966,884.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TC ENERGY CORP	46,850	50.410	2,361,708.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,329	45.040	1,140,818.160	
	BARRICK GOLD CORP	80,700	23.640	1,907,748.000	
	CAE INC	14,200	26.450	375,590.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,241	189.080	1,369,128.280	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	36.720	260,712.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	101.240	354,340.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,950	56.210	390,659.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	21.500	378,400.000	
	HYDRO ONE LTD	15,200	37.540	570,608.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	7,360	120.460	886,585.600	
	STANTEC INC	5,800	97.010	562,658.000	
	NORTHLAND POWER INC	11,200	21.880	245,056.000	
	WSP GLOBAL INC	5,700	186.430	1,062,651.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,700	110.550	409,035.000	
	PARKLAND CORP	6,600	43.720	288,552.000	
	QUEBECOR INC -CL B	6,800	29.730	202,164.000	
	EMERA INC	12,600	47.500	598,500.000	
	TFI INTERNATIONAL INC	3,500	158.710	555,485.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,100	30.200	184,220.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,300	57.420	935,946.000	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	95.000	152,000.000	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,700	11.020	294,234.000	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	22,617	72.600	1,641,994.200	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	8.260	242,018.000	
	AIR CANADA	7,600	17.450	132,620.000	
	KINROSS GOLD CORP	56,100	7.930	444,873.000	
	BANK OF MONTREAL	32,800	110.100	3,611,280.000	
	POWER CORP OF CANADA	26,600	37.330	992,978.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	55,200	99.720	5,504,544.000	
	NUTRIEN LTD	23,119	75.470	1,744,790.930	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,300	36.120	227,556.000	
	CAMECO CORP	20,000	60.080	1,201,600.000	
	FIRSTSERVICE CORP	1,800	212.270	382,086.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,800	37.330	403,164.000	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	28.100	73,060.000	
	TELUS CORP	10,800	23.860	257,688.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,900	50.400	1,053,360.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	140.510	337,224.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,900	90.180	4,590,162.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	1,229.350	1,229,350.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	12,500	73.730	921,625.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,137	162.170	508,727.290	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	21.280	361,760.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	109.880	417,544.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,000	68.380	1,846,260.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ENBRIDGE INC	93,100	46.920	4,368,252.000	
	BROOKFIELD CORP	64,725	48.360	3,130,101.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	84,600	26.240	2,219,904.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	42,820	96.950	4,151,399.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,700	89.100	418,770.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	48.620	403,546.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,950	155.530	4,036,003.500	
	CGI INC - CLASS A	9,700	137.050	1,329,385.000	
	ONEX CORPORATION	3,200	93.180	298,176.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	33.500	120,600.000	
	TMX GROUP LTD	12,500	28.700	358,750.000	
	OPEN TEXT CORP	12,100	55.330	669,493.000	
	SAPUTO INC	11,700	26.050	304,785.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	27,100	11.360	307,856.000	
	FORTIS INC	22,300	54.360	1,212,228.000	
	RB GLOBAL INC	8,400	85.880	721,392.000	
	LUNDIN MINING CORP	30,400	9.310	283,024.000	
	CENOVUS ENERGY INC	65,900	24.010	1,582,259.000	
	DOLLARAMA INC	12,800	97.400	1,246,720.000	
	ALTAGAS LTD	13,000	27.040	351,520.000	
	KEYERA CORP	10,200	32.990	336,498.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	21.680	620,048.000	
カナダ・ドル 小計				111,713,029.610 (12,088,466,934)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	135,300	3.060	414,018.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	65,700	27.320	1,794,924.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	31.760	2,991,792.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,375	6.370	492,878.750	
	KEPPEL CORP LTD	75,700	6.430	486,751.000	
	UOL GROUP LTD	22,900	5.940	136,026.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,600	6.230	153,258.000	
	SEATRIUM	2,306,022	0.107	246,744.350	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	29.000	147,900.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	176,100	12.690	2,234,709.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	314,400	0.910	286,104.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,350	2.290	983,211.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	81,200	3.720	302,064.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	46,500	5.160	239,940.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	44,600	9.560	426,376.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	99,900	3.680	367,632.000	
シンガポール・ドル 小計				11,704,328.600 (1,291,923,791)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	18,940	25.980	492,061.200	
	AVOLTA AG	4,854	30.870	149,842.980	
	UBS GROUP AG-REG	152,627	23.900	3,647,785.300	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	249.200	360,592.400	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	326	614.500	200,327.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,458	42.020	313,385.160	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,581	236.400	7,702,148.400	
	SIKA AG-REG	6,789	236.800	1,607,635.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	107,400.000	537,000.000	
	ABB LTD-REG	74,342	34.090	2,534,318.780	
	SWISS RE AG	13,988	102.750	1,437,267.000	
	NESTLE SA-REG	123,371	99.130	12,229,767.230	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,052	1,144.000	1,203,488.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,893	196.150	371,311.950	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,536	43.400	413,862.400	
	SGS SA-REG	6,925	74.480	515,774.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,091	186.600	203,580.600	
	TEMENOS AG - REG	2,973	72.920	216,791.160	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	118.100	215,886.800	
	VAT GROUP AG	1,255	389.000	488,195.000	
	BKW AG	942	150.900	142,147.800	
	ALCON INC	23,173	65.420	1,515,977.660	
	SIG GROUP N AG	14,178	20.260	287,246.280	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,342	229.800	308,391.600	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,977	435.500	3,038,483.500	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,134	129.800	276,993.200	
	CLARIANT AG-REG	9,678	13.070	126,491.460	
	NOVARTIS AG-REG	94,701	84.840	8,034,432.840	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,453.000	231,027.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,575	65.800	103,635.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	24,207	109.500	2,650,666.500	
	SWISSCOM AG-REG	1,201	511.400	614,191.400	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	106.100	142,598.400	
	GEBERIT AG-REG	1,559	486.400	758,297.600	
	GIVAUDAN-REG	428	3,245.000	1,388,860.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,176	122.000	631,472.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,415	251.800	608,097.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,619	75.060	571,882.140	
	LONZA GROUP AG-REG	3,453	341.800	1,180,235.400	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	43.850	99,495.650	
	HOLCIM LTD	24,669	63.900	1,576,349.100	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	561.000	769,692.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,519	256.200	645,367.800	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,575	87.300	312,097.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	10,880.000	478,720.000	
スイス・フラン	小計			61,333,869.390 (10,338,437,024)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	10,255	239.300	2,454,021.500	
	VOLVO CAR CLASS B	28,514	34.380	980,311.320	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ERICSSON LM-B SHS	152,246	52.580	8,005,094.680	
	VOLVO AB-B SHS	78,458	242.200	19,002,527.600	
	SKF AB-B SHARES	17,719	195.500	3,464,064.500	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	81.900	2,156,672.700	
	GETINGE AB-B SHS	11,892	225.900	2,686,402.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	82,504	126.800	10,461,507.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,834	99.240	7,525,766.160	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,333	193.250	8,374,102.250	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	175.040	6,116,947.840	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	31,500	159.400	5,021,100.000	
	SKANSKA AB-B SHS	17,689	168.200	2,975,289.800	
	SANDVIK AB	55,435	204.400	11,330,914.000	
	INVESTOR AB-B SHS	89,989	215.500	19,392,629.500	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	139,653	161.750	22,588,872.750	
	VOLVO AB-A SHS	10,411	245.400	2,554,859.400	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,877	440.600	2,148,806.200	
	SECURITAS AB-B SHS	25,570	92.840	2,373,918.800	
	TELIA CO AB	122,866	24.920	3,061,820.720	
	ALFA LAVAL AB	15,043	389.800	5,863,761.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	81,153	138.650	11,251,863.450	
	ASSA ABLOY AB-B	52,111	269.600	14,049,125.600	
	SAAB AB-B	3,943	547.600	2,159,186.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,768	314.900	2,131,243.200	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	30,192	62.820	1,896,661.440	
	INDUTRADE AB	13,454	230.300	3,098,456.200	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	10,125	252.400	2,555,550.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,951	498.100	1,967,993.100	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	232.900	1,593,734.700	
	LIFCO AB-B SHS	12,120	229.200	2,777,904.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	78,793	62.580	4,930,865.940	
	BEIJER REF AB	20,012	117.100	2,343,405.200	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,669	263.400	8,341,614.600	
	BOLIDEN AB	14,220	284.350	4,043,457.000	
	EPIROC AB-A	34,263	194.000	6,647,022.000	
	EPIROC AB-B	19,202	164.900	3,166,409.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	80.300	1,557,418.500	
	NORDEA BANK ABP	167,488	116.900	19,579,347.200	
	EQT AB	18,489	248.800	4,600,063.200	
	EVOLUTION AB	9,528	1,101.800	10,497,950.400	
	HEXAGON AB-B SHS	107,944	104.500	11,280,148.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,028	314.700	2,526,411.600	
スウェーデン・クローナ	小計			271,535,223.050 (3,858,515,520)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	164,716	689.400	113,555,210.400	
	DANSKE BANK A/S	35,861	175.850	6,306,156.850	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	10,710.000	1,638,630.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52,505	182.540	9,584,262.700	
	CARLSBERG AS-B	5,120	827.400	4,236,288.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,634	349.500	3,716,583.000	
	COLOPLAST-B	6,177	803.200	4,961,366.400	
	DSV PANALPINA A/S	9,678	1,053.500	10,195,773.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,825.000	777,450.000	
	DEMANT A/S	5,239	290.700	1,522,977.300	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	252	10,870.000	2,739,240.000	
	TRYG A/S	17,729	145.950	2,587,547.550	
	PANDORA A/S	4,341	911.400	3,956,387.400	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,484	534.600	2,931,746.400	
	GENMAB A/S	3,433	2,142.000	7,353,486.000	
	ORSTED A/S	9,835	316.000	3,107,860.000	
デンマーク・クローネ 小計				179,170,965.000 (3,880,843,102)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	67,152	5.130	344,489.760	
	MERCURY NZ LTD	34,143	6.080	207,589.440	
	EBOS GROUP LTD	7,660	36.990	283,343.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,147	5.070	467,185.290	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	65,088	7.900	514,195.200	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,125	23.800	716,975.000	
ニュージーランド・ドル 小計				2,533,778.090 (229,813,673)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	48,122	204.800	9,855,385.600	
	NORSK HYDRO ASA	68,982	63.060	4,350,004.920	
	ORKLA ASA	39,050	79.920	3,120,876.000	
	TELENOR ASA	36,380	115.650	4,207,347.000	
	EQUINOR ASA	46,908	342.250	16,054,263.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,608	361.900	3,115,235.200	
	MOWI ASA	22,853	192.250	4,393,489.250	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,398	182.000	1,892,436.000	
	AKER BP ASA	16,430	304.600	5,004,578.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,573	464.600	2,124,615.800	
	SALMAR ASA	3,573	584.600	2,088,775.800	
	ADEVINTA ASA	13,944	111.400	1,553,361.600	
ノルウェー・クローネ 小計				57,760,368.170 (797,670,684)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	38,360	24.190	927,928.400	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,124	29.830	689,788.920	
	EXOR NV	5,095	88.400	450,398.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,338	84.880	453,089.440	
	CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	26.740	78,562.120	
	DSM FIRMENICH AG	8,774	87.170	764,829.580	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FERROVIAL	24,640	31.540	777,145.600	
	LOTUS BAKERIES NV	21	7,980.000	167,580.000	
	BAYER AG-REG	46,056	30.670	1,412,537.520	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,486	17.410	165,151.260	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	90,946	11.272	1,025,143.310	
	COMMERZBANK AG	49,895	11.305	564,062.970	
	VOLKSWAGEN AG	1,304	119.450	155,762.800	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	9,657	106.880	1,032,140.160	
	SIEMENS AG-REG	35,631	152.880	5,447,267.280	
	E.ON SE	105,252	11.975	1,260,392.700	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,909	96.070	1,432,307.630	
	GEA GROUP AG	7,218	33.700	243,246.600	
	CONTINENTAL AG	5,168	71.600	370,028.800	
	BASF SE	41,885	42.975	1,800,007.870	
	ALLIANZ SE-REG	18,907	231.000	4,367,517.000	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,926	71.380	565,757.880	
	RHEINMETALL AG	2,042	275.200	561,958.400	
	RWE AG	29,664	39.260	1,164,608.640	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,029	8.020	216,772.580	
	BRENTAG SE	6,969	77.260	538,424.940	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	19,800	28.570	565,686.000	
	SAP SE	48,954	144.540	7,075,811.160	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,379	387.500	2,471,862.500	
	ZALANDO SE	10,553	22.080	233,010.240	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	6,804	74.100	504,176.400	
	COVESTRO AG	9,078	48.600	441,190.800	
	RATIONAL AG	242	590.000	142,780.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	294.500	356,345.000	
	TALANX AG	3,119	65.700	204,918.300	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	7,194	45.210	325,240.740	
	DELIVERY HERO SE	8,246	30.425	250,884.550	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,894	83.980	159,058.120	
	BECHTLE AG	3,626	45.770	165,962.020	
	NEMETSCHEK SE	2,557	81.040	207,219.280	
	SCOUT24 AG	3,600	63.320	227,952.000	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,218	52.420	692,887.560	
	KNORR-BREMSE AG	3,413	57.860	197,476.180	
	HELLOFRESH SE	7,177	14.420	103,492.340	
	SIEMENS ENERGY AG	23,742	10.765	255,582.630	
	BEIERSDORF AG	4,725	129.150	610,233.750	
	MERCK KGAA	6,059	160.400	971,863.600	
	ADIDAS AG	7,575	192.720	1,459,854.000	
	PUMA SE	4,969	58.480	290,587.120	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,883	62.700	306,164.100	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,948	21.935	3,332,979.380	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,650	37.280	359,752.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MERCEDES-BENZ GROUP N AG	38,764	59.290	2,298,317.560	
	QIAGEN N.V.	10,690	37.630	402,264.700	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	61,222	35.700	2,185,625.400	
	HANNOVER RUECK SE	2,826	217.500	614,655.000	
	DHL GROUP	46,385	42.910	1,990,380.350	
	DEUTSCHE BOERSE AG	8,907	174.050	1,550,263.350	
	MTU AERO ENGINES AG	2,524	187.850	474,133.400	
	WACKER CHEMIE AG	899	112.900	101,497.100	
	SYMRISE AG	6,224	101.400	631,113.600	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.350	97,083.200	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,686	87.250	234,353.500	
	VONOVIA SE	34,542	25.950	896,364.900	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,501	71.900	251,721.900	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	43,515	18.828	819,300.420	
	NN GROUP NV	12,086	31.750	383,730.500	
	ARCELORMITTAL	25,700	22.830	586,731.000	
	HEINEKEN NV	13,649	82.720	1,129,045.280	
	AEGON LTD	77,429	4.942	382,654.110	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,015	26.340	1,212,035.100	
	AKZO NOBEL N.V.	7,841	70.180	550,281.380	
	WOLTERS KLUWER	12,073	125.950	1,520,594.350	
	ING GROEP NV	169,586	12.768	2,165,274.040	
	KONINKLIJKE KPN NV	151,671	3.170	480,797.070	
	ASML HOLDING NV	18,899	629.200	11,891,250.800	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	18,975	12.525	237,661.870	
	IMCD NV	2,678	137.400	367,957.200	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,008	128.550	515,228.400	
	ASR NEDERLAND NV	8,311	37.420	310,997.620	
	ADYEN NV	1,018	1,087.800	1,107,380.400	
	PROSUS NV	78,572	30.075	2,363,052.900	
	JDE PEET'S NV	5,785	24.420	141,269.700	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,201	469.400	1,033,149.400	
	RANDSTAD NV	5,275	54.880	289,492.000	
	HEINEKEN HOLDING NV	6,143	70.550	433,388.650	
	OCI NV	4,987	20.950	104,477.650	
	TOTALENERGIES SE	109,487	61.680	6,753,158.160	
	MICHELIN (CGDE)	31,804	30.840	980,835.360	
	AIR LIQUIDE SA	24,554	173.760	4,266,503.040	
	KERING	3,490	391.000	1,364,590.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,520	167.200	4,266,944.000	
	BOUYGUES SA	9,572	35.140	336,360.080	
	BNP PARIBAS	50,023	56.920	2,847,309.160	
	THALES SA	4,927	138.650	683,128.550	
	DANONE	30,195	59.150	1,786,034.250	
	CARREFOUR SA	28,025	17.355	486,373.870	
	VIVENDI	31,166	8.754	272,827.160	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	L' OREAL	11,309	431.850	4,883,791.650	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,086	59.420	1,312,350.120	
	LEGRAND SA	12,508	88.160	1,102,705.280	
	PERNOD RICARD SA	9,578	155.750	1,491,773.500	
	EURAZEO SE	1,981	62.750	124,307.750	
	SOCIETE GENERALE SA	35,528	22.740	807,906.720	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	12,945	690.500	8,938,522.500	
	ACCOR SA	8,355	31.630	264,268.650	
	CAPGEMINI SE	7,730	188.550	1,457,491.500	
	VALEO SA	9,148	13.535	123,818.180	
	PUBLICIS GROUPE	10,730	77.280	829,214.400	
	BUREAU VERITAS SA	13,862	22.470	311,479.140	
	EIFFAGE	3,675	92.760	340,893.000	
	SODEXO SA	4,157	99.340	412,956.380	
	IPSEN	1,706	102.900	175,547.400	
	AMUNDI SA	2,888	56.100	162,016.800	
	TELEPERFORMANCE	2,771	130.300	361,061.300	
	EURONEXT NV	3,876	76.100	294,963.600	
	EUROFINS SCIENTIFIC	6,342	52.820	334,984.440	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,302	207.500	270,165.000	
	SEB SA	1,182	104.600	123,637.200	
	ESSILORLUXOTTICA	13,842	177.240	2,453,356.080	
	DASSAULT AVIATION SA	1,108	185.000	204,980.000	
	WORLDLINE SA	11,265	13.950	157,146.750	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,944	33.120	163,745.280	
	AXA SA	86,016	28.440	2,446,295.040	
	EDENRED	11,699	50.020	585,183.980	
	RENAULT SA	9,048	35.825	324,144.600	
	HERMES INTERNATIONAL	1,485	1,897.000	2,817,045.000	
	STMICROELECTRONICS NV	32,041	43.035	1,378,884.430	
	REMY COINTREAU	1,009	108.550	109,526.950	
	DASSAULT SYSTEMES SE	31,420	43.125	1,354,987.500	
	WENDEL	1,124	78.500	88,234.000	
	ORANGE	87,788	11.258	988,317.300	
	ALSTOM	14,107	11.495	162,159.960	
	SANOFI	53,273	84.870	4,521,279.510	
	VINCI SA	24,919	112.120	2,793,918.280	
	AIRBUS SE	27,790	135.560	3,767,212.400	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,858	28.680	913,687.440	
	CREDIT AGRICOLE SA	56,733	11.800	669,449.400	
	BIOMERIEUX	1,852	98.840	183,051.680	
	ENGIE	85,625	15.872	1,359,040.000	
	SAFRAN SA	16,024	160.140	2,566,083.360	
	ARKEMA	2,829	93.520	264,568.080	
	ADP	1,343	113.000	151,759.000	
	GETLINK SE	19,411	16.745	325,037.190	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BOLLORE	39,141	5.340	209,012.940	
	UCB SA	5,940	67.300	399,762.000	
	KBC GROUP NV	11,734	52.480	615,800.320	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	72.300	316,890.900	
	SOLVAY SA	3,489	105.450	367,915.050	
	UMICORE	9,840	24.430	240,391.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,720	57.180	2,328,369.600	
	AGEAS	7,499	39.410	295,535.590	
	D' IETEREN GROUP	1,036	157.000	162,652.000	
	ELIA GROUP SA/NV	1,462	98.500	144,007.000	
	SOFINA	670	202.600	135,742.000	
	ARGENX SE	2,624	402.200	1,055,372.800	
	PRYSMIAN SPA	12,378	35.270	436,572.060	
	ASSICURAZIONI GENERALI	48,878	18.970	927,215.660	
	MEDIOBANCA SPA	26,230	10.730	281,447.900	
	TENARIS SA	22,187	15.335	340,237.640	
	UNICREDIT SPA	86,265	25.325	2,184,661.120	
	TELECOM ITALIA SPA	434,374	0.263	114,414.110	
	INTESA SANPAOLO	721,438	2.646	1,909,285.660	
	POSTE ITALIANE SPA	24,593	9.814	241,355.700	
	MONCLER SPA	9,654	51.020	492,547.080	
	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,912	44.320	217,699.840	
	ENI SPA	110,008	15.108	1,662,000.860	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	24,606	9.936	244,485.210	
	DIASORIN SPA	1,144	86.160	98,567.040	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,810	11.300	178,653.000	
	NEXI SPA	27,866	7.102	197,904.330	
	AMPLIFON SPA	5,632	28.240	159,047.680	
	ENEL SPA	381,294	6.433	2,452,864.300	
	SNAM SPA	94,744	4.559	431,937.890	
	TERNA SPA	65,948	7.408	488,542.780	
	CNH INDUSTRIAL NV	47,963	9.690	464,761.470	
	FINECOBANK SPA	28,693	12.235	351,058.850	
	STELLANTIS NV	103,531	19.714	2,041,010.130	
	FERRARI NV	5,909	335.400	1,981,878.600	
	TELEFONICA SA	242,511	3.888	942,882.760	
	ENDESA SA	14,367	19.100	274,409.700	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	279,358	8.696	2,429,297.160	
	IBERDROLA SA	285,848	11.305	3,231,511.640	
	REPSOL SA	60,600	14.025	849,915.000	
	GRIFOLS SA	14,039	12.660	177,733.740	
	BANCO SANTANDER SA	757,556	3.798	2,877,197.680	
	AMADEUS IT GROUP SA	21,119	63.820	1,347,814.580	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	27.200	280,160.000	
	CAIXABANK SA	195,084	4.197	818,767.540	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,306	36.760	378,848.560	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AENA SME SA	3,515	156.500	550,097.500	
	CELLNEX TELECOM SA	26,497	35.100	930,044.700	
	ACCIONA SA	1,117	128.800	143,869.600	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	51,138	37.540	1,919,720.520	
	ENAGAS SA	11,714	16.745	196,150.930	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,067	15.330	292,297.110	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,022	32.000	800,704.000	
	NOKIA OYJ	251,161	3.247	815,519.760	
	WARTSILA OYJ ABP	22,236	12.700	282,397.200	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	26,320	11.985	315,445.200	
	ELISA OYJ	6,414	41.240	264,513.360	
	SAMPO OYJ-A SHS	21,514	39.315	845,822.910	
	FORTUM OYJ	21,078	12.960	273,170.880	
	KESKO OYJ-B SHS	12,355	17.485	216,027.170	
	KONE OYJ-B	15,931	40.760	649,347.560	
	NESTE OYJ	19,834	34.200	678,322.800	
	ORION OYJ-CLASS B	4,846	36.500	176,879.000	
	METSO CORPORATION	31,351	9.102	285,356.800	
	VERBUND AG	3,205	84.700	271,463.500	
	OMV AG	6,920	39.370	272,440.400	
	ERSTE GROUP BANK AG	16,116	36.730	591,940.680	
	VOESTALPINE AG	5,480	26.040	142,699.200	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,188	33.150	404,032.200	
	AIB GROUP PLC	67,931	4.148	281,777.780	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	49,516	8.574	424,550.180	
	KINGSPAN GROUP PLC	7,249	71.300	516,853.700	
	JERONIMO MARTINS	13,330	22.520	300,191.600	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	148,083	4.404	652,157.530	
	GALP ENERGIA SGPS SA	23,118	13.620	314,867.160	
	EDP RENOVAVEIS SA	14,554	16.345	237,885.130	
	KERRY GROUP PLC-A	7,471	73.780	551,210.380	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,275	143.750	1,189,531.250	
ユーロ 小計				220,781,341.680 (35,658,394,495)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	72,000	39.850	2,869,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	114,000	40.250	4,588,500.000	
	MTR CORP	81,000	28.100	2,276,100.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	75,500	76.400	5,768,200.000	
	SINO LAND CO	182,000	7.770	1,414,140.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,669	39.150	5,468,041.350	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	51.000	1,224,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	85,500	60.400	5,164,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	75,507	21.250	1,604,523.750	
	HONG KONG & CHINA GAS	582,475	5.300	3,087,117.500	
	HANG SENG BANK LTD	39,800	87.500	3,482,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	79,500	11.720	931,740.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考	
			単価	金額		
	WH GROUP LTD	433,500	4.910	2,128,485.000		
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	62,600	279.600	17,502,960.000		
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	10.600	1,028,200.000		
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	8.890	773,430.000		
	SWIRE PROPERTIES LTD	60,800	15.200	924,160.000		
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,669	38.150	3,916,822.350		
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	38.100	1,143,000.000		
	AIA GROUP LTD	600,600	69.200	41,561,520.000		
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	12.240	783,360.000		
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	87,000	24.950	2,170,650.000		
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,500	13.620	1,218,990.000		
	ESR CAYMAN LTD	113,800	10.000	1,138,000.000		
	SANDS CHINA LTD	126,400	19.040	2,406,656.000		
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	71,500	79.950	5,716,425.000		
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	192,500	21.050	4,052,125.000		
香港・ドル 小計					124,343,045.950 (2,342,622,986)	
合計					373,664,357,535 [373,664,357,535]	

(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	6,937	1,185,047.710	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,807	1,940,467.320	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,200	410,400.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,200	1,275,040.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,400	984,492.000	
		EQUINIX INC	4,508	3,643,861.480	
		AMERICAN TOWER CORP	22,500	4,639,050.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	34,443	600,685.920	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,700	561,903.000	
		KIMCO REALTY CORP	30,000	570,600.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	18,500	279,905.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,700	582,676.000	
		INVITATION HOMES INC	29,600	975,616.000	
		VICI PROPERTIES INC	48,600	1,439,532.000	
		VENTAS INC	19,400	880,954.000	
		WEYERHAEUSER CO	35,414	1,122,623.800	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,000	2,435,580.000	
		IRON MOUNTAIN INC	14,100	892,248.000	
		SUN COMMUNITIES INC	6,000	768,000.000	
		PROLOGIS INC	44,654	5,047,688.160	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,900	861,179.000			
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,200	466,700.000			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,100	657,913.000	
		WELLTOWER INC	24,000	2,116,800.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	26,500	454,210.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,600	693,616.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,600	602,774.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,900	432,590.000	
		REALTY INCOME CORP	32,595	1,749,373.650	
		PUBLIC STORAGE	7,700	1,985,830.000	
		REGENCY CENTERS CORP	8,100	497,907.000	
		UDR INC	15,100	502,679.000	
		WP CAREY INC	10,300	640,557.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,100	1,948,620.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,500	1,360,065.000	
	アメリカ・ドル 小計			45,207,184.040 (6,648,620,557)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	33,482	210,467.850	
		SEGRO PLC	55,182	452,713.120	
	イギリス・ポンド 小計			663,180.970 (123,908,732)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	48,731	341,117.000	
		LENLEASE GROUP	31,401	209,444.670	
		TRANSURBAN GROUP	138,948	1,782,702.840	
		APA GROUP	53,350	449,207.000	
		SCENTRE GROUP	235,284	618,796.920	
		GPT GROUP	86,791	354,107.280	
		MIRVAC GROUP	173,080	340,967.600	
		STOCKLAND	104,777	426,442.390	
		GOODMAN GROUP	76,496	1,783,886.720	
	VICINITY CENTRES	175,417	318,381.850		
	オーストラリア・ドル 小計			6,625,054.270 (645,611,539)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,800	174,116.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,900	120,267.000	
	カナダ・ドル 小計			294,383.000 (31,855,184)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	194,000	550,960.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	276,670	511,839.500	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170,200	275,724.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112,700	154,399.000	
	シンガポール・ドル 小計			1,492,922.500 (164,788,786)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,554	318,022.040	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
		GECINA SA	2,164	218,996.800		
		KLEPIERRE	10,126	233,910.600		
		COVIVIO	2,399	106,419.640		
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,389	188,567.280		
	ユーロ 小計				1,065,916.360 (172,156,151)	
	香港・ドル	LINK REIT	131,500	5,115,350.000		
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000	1,654,800.000		
	香港・ドル 小計				6,770,150.000 (127,549,626)	
	投資証券 合計				7,914,490,575 [7,914,490,575]	
	合計				7,914,490,575 [7,914,490,575]	

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	603 銘柄	97.7%	2.3%	75.2%
	投資証券	35 銘柄			
イギリス・ポンド	株式	81 銘柄	99.2%	0.8%	4.2%
	投資証券	2 銘柄			
イスラエル・シケル	株式	8 銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式	48 銘柄	91.2%	8.8%	1.9%
	投資証券	10 銘柄			
カナダ・ドル	株式	86 銘柄	99.7%	0.3%	3.2%
	投資証券	2 銘柄			
シンガポール・ドル	株式	16 銘柄	88.7%	11.3%	0.4%
	投資証券	4 銘柄			
スイス・フラン	株式	45 銘柄	100%	-%	2.7%
スウェーデン・クローナ	株式	43 銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式	16 銘柄	100%	-%	1.0%
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	222 銘柄	99.5%	0.5%	9.4%
	投資証券	5 銘柄			
香港・ドル	株式	27 銘柄	94.8%	5.2%	0.6%
	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11月30日現在 金額(円)	2023年11月30日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	744,126,868	4,395,766,728
コール・ローン	2,484,935,442	2,194,701,959
国債証券	236,705,030,930	274,718,308,942
派生商品評価勘定	191,337	3,136,806
未収入金	30,062	225,675
未収利息	1,496,086,797	2,015,893,116
前払費用	72,896,925	80,168,280
流動資産合計	241,503,298,361	283,408,201,506
資産合計	241,503,298,361	283,408,201,506
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,202,627	6,667,893
未払金	3,816,639	1,015,369
未払解約金	121,960,511	65,224,094
流動負債合計	150,979,777	72,907,356
負債合計	150,979,777	72,907,356
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	76,340,507,617	82,595,678,754
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	165,011,810,967	200,739,615,396
元本等合計	241,352,318,584	283,335,294,150
純資産合計	241,352,318,584	283,335,294,150
負債純資産合計	241,503,298,361	283,408,201,506

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 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首	2021 年 12 月 1 日	2022 年 12 月 1 日
期首元本額	74,475,307,643 円	76,340,507,617 円
期中追加設定元本額	9,175,662,845 円	11,600,344,011 円
期中一部解約元本額	7,310,462,871 円	5,345,172,874 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	447,343,827 円	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)	9,071,985 円	7,319,300 円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30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)	51,739,813円	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)	19,793,735円	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)	243,846,488円	206,248,674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)	347,889,324円	566,369,227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)	589,471,225円	804,205,846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)	2,679,395,542円	3,747,848,437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)	612,758,959円	850,255,984円
D-I's 外国債券インデックス	992,049円	2,616,753円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	12,619,026円	19,605,277円
iFree 外国債券インデックス	2,022,055,185円	2,159,651,283円
iFree 8資産バランス	1,843,024,587円	2,274,181,036円
iFree 年金バランス	342,801,665円	497,028,931円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	317,728円
DCダイワ外国債券インデックス	50,603,926,450円	51,424,951,579円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,059,415,494円	1,152,680,509円
ダイワ・ライフ・バランス50	676,505,626円	811,578,029円
ダイワ・ライフ・バランス70	451,133,774円	624,049,099円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	638,338,066円	691,231,526円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	501,969,526円	546,358,716円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	192,677,874円	218,171,346円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	31,943,484円	36,831,686円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	13,831,284円	18,569,302円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,384,617,622円	1,946,640,644円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,873,500円	4,601,402円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,528,422円	1,919,154円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
ダイワつみたてインデックスバランス70	2,590,775 円	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)	159,668,286 円	1,093,939,740 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	115,798,326 円	93,247,794 円
ダイワ世界バランスファンド60VA	36,264,152 円	25,462,305 円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,287,759,159 円	2,826,420,113 円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	199,611,808 円	174,572,917 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	150,551,922 円	160,388,033 円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	49,437,293 円	66,632,761 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)	1,733,569,277 円	3,178,053,407 円
ダイワ投信倶楽部外国債券 インデックス	5,720,730,269 円	5,811,265,010 円
ダイワライフスタイル25	28,448,488 円	26,830,233 円
ダイワライフスタイル50	58,536,147 円	59,333,757 円
ダイワライフスタイル75	14,977,183 円	16,514,057 円
計	76,340,507,617 円	82,595,678,754 円
2. 期末日における受益権の総数	76,340,507,617 口	82,595,678,754 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12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

区分	自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
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 11 月 30 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 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 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	△40,716,680,142	△6,503,057,307
合計	△40,716,680,142	△6,503,057,307

(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 11 月 30 日現在				2023 年 11 月 30 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		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	2,152,583,358	-	2,127,572,068	△25,011,290	1,999,333,300	-	1,995,802,213	△3,531,087

種類	2022年11月30日現在				2023年11月30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		
アメリカ・ドル	941,267,656	-	934,036,875	△7,230,781	493,745,664	-	489,320,447	△4,425,217
イギリス・ポンド	179,447,652	-	179,112,796	△334,856	49,001,213	-	48,927,699	△73,514
イスラエル・シユケル	-	-	-	-	20,745,465	-	22,211,377	1,465,912
オーストラリア・ドル	90,011,493	-	88,942,453	△1,069,040	7,724,319	-	7,697,515	△26,804
オフショア・人民元	88,623,078	-	84,987,194	△3,635,884	1,040,150,311	-	1,041,531,390	1,381,079
カナダ・ドル	176,541,309	-	169,074,798	△7,466,511	28,848,147	-	28,769,881	△78,266
シンガポール・ドル	51,909,276	-	50,075,168	△1,834,108	16,185,993	-	16,214,908	28,915
メキシコ・ペソ	32,514,295	-	31,607,270	△907,025	-	-	-	-
ユーロ	592,268,599	-	589,735,514	△2,533,085	342,932,188	-	341,128,996	△1,803,192
合計	2,152,583,358	-	2,127,572,068	△25,011,290	1,999,333,300	-	1,995,802,213	△3,531,087

(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11月30日現在	2023年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.1615円	3.4304円
(1万口当たり純資産額)	(31,615円)	(34,304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	880,179.750	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	755,276.430	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	769,881.600	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	791,726.040	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,559,206.850	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,204,518.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	905,256.660	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	547,331.440	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	523,458.210	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	936,599.650	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,090,206.130	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,058,940.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,189,333.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,020,847.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,643,047.260	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,001,647.100	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,411,488.650	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,279,732.080	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,329,537.300	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,361,082.740	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,186,071.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,323,313.050	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,078,219.230	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	3,993,293.090			

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	1,240,185.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,115,610.640	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,774,653.480	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,788,305.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,835,504.430	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	2,859,959.740	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,762,807.340	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,535,271.810	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,758,409.340	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,135,811.340	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,539,927.520	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,818,217.830	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,563,020.440	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,421,611.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,484,450.140	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,416,474.980	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,578,309.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	508,556.890	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,568,492.760	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,209,171.960	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,216,953.750	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,975,196.640	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,997,484.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,844,780.200	
		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	749,860.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,412,500.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,795,238.200	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,997,312.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,529,840.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,482,929.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,784,457.500	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,090,030.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,819,800.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,407,985.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,104,768.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,715,664.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,973,318.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,524,678.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,626,587.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,288,310.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,813,029.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,966,736.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,129,630.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,846,990.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,449,499.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,906,700.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,302,020.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,454,863.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,423,675.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,478,896.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,425,775.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,424,100.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,511,374.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,467,642.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,899,680.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,441,230.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,093,912.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,400,000.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,582,152.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,391,100.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,375,525.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,459,414.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,542,136.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,664,788.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,834,400.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,626,092.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,339,150.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,086,603.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	2,995,750.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,580,256.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,317,275.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	967,070.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,773,350.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,484,487.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,013,380.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,846,400.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,892,300.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,314,500.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,411,650.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,629,433.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,250,750.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,954,065.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,308,202.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	271,095.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,956,744.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,357,025.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,416,464.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,407,428.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,533,302.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,109,648.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	2,790,032.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	2,998,000.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,067,190.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,801,190.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	6,050,915.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,058,440.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,154,996.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,309,200.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,335,500.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,453,247.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	2,970,700.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,041,080.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,690,520.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,447,880.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,237,535.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,833,238.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,678,480.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,455,200.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,754,280.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,155,778.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,688,889.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,328,800.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,317,150.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,587,000.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,059,900.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,479,702.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,674,276.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,570,100.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,389,550.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,162,113.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,742,630.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,523,040.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,672,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,251,537.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,117,905.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,273,040.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,261,312.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,714,302.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,262,060.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,014,736.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,375,350.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,571,750.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,280,376.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,189,542.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,708,078.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,429,880.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,312,850.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,328,600.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,528,200.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,346,150.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,176,040.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,314,735.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,062,300.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,876,312.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,708,400.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,235,780.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,378,050.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,650,280.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,908,176.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,108,062.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,474,600.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,646,160.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	957,030.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,682,544.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,548,078.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,801,458.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,517,684.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,799,700.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,441,500.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,625,750.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,799,700.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,730,270.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,717,150.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,908,470.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,373,813.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,909,940.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,718,150.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,239,900.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,797,530.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,849,340.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,552,220.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,888,900.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,883,640.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,795,000.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,893,410.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,916,600.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,853,272.500	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,379,310.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,442,365.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,970,980.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,680,060.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,080,952.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,396,375.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,293,745.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,251,424.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,445,650.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,475,780.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,372,970.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	992,460.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,979,720.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,580,981.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,495,680.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,421,760.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,954,400.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,979,390.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,444,575.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,952,570.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,295,700.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,457,405.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,478,430.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,887,850.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,476,465.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,972,160.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	989,430.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,786,000.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,458,140.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,524,960.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,252,050.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,885,795.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,588,852.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,478,985.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	983,690.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,966,820.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,504,275.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,957,850.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,733,472.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,605,317.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,965,660.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,867,790.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,938,620.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	980,130.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,256,418.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	4,400,000.000	3,802,216.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,250,775.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,942,960.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,567,924.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,605,613.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,454,055.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,974,860.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,492,700.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,907,360.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,463,005.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	2,000,000.000	2,001,700.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	3,997,000.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,481,240.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	7,000,000.000	6,776,840.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	5,988,000.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	3,500,000.000	3,311,035.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,300,000.000	1,254,500.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,949,480.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,915,834.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,069,217.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,017,220.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,015,210.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	1,004,720.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,529,760.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,268,544.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,005,460.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	1,000,000.000	1,005,700.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	2,000,000.000	2,055,460.000	
	アメリカ・ドル	小計		898,347,121.890 (132,119,911,216)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	882,631.140	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	817,659.600	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,367,269.850	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	981,904.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,060,675.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	958,757.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,278,390.600	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,346,325.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	484,536.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	703,252.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	441,575.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,261,320.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,793,144.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	717,689.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,021,683.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	504,220.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,374,285.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,364,048.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	436,744.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,139,510.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,888,500.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	977,800.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,141,425.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	871,560.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,045,605.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,335,705.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,262,330.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,710,395.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	659,230.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,847,060.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	301,104.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,996,000.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	930,300.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,100,000.000	1,030,425.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	392,584.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,150,000.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	800,000.000	728,560.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	700,000.000	711,809.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,037,220.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,033,954.480	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,280,521.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,477,004.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,362,000.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,406,774.760	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,621,575.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,298,137.120	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,240,907.360	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,103,430.960	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,677,472.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,272,626.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,410,674.220	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,602,900.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,072,918.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,528,743.800	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,349,619.200	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,539,636.600	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,142,618.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,298,448.000	
		イギリス・ポンド 小計		73,673,194.090 (13,765,099,584)	
	イスラエル・シ ュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,921,410.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,796,480.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,219,362.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,699,344.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,107,752.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,115,976.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	1,999,704.000	
		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,527,824.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,201,713.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	185,814.000	
		0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	872,280.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	240,624.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	422,598.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,981,100.000	
		イスラエル・シュケル 小計		20,291,981.000 (809,921,954)	
	オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,034,965.790	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,299,230.700	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,774,769.840	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,283,989.580	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,756,635.120	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,031,684.220	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,112,322.350	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	676,724.400	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,594,536.240	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,092,453.640	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	956,390.280	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,412,340.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,762,098.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,600,047.800	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,079,918.800	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,338,342.400	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,117,394.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,308,176.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,610,160.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	771,904.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,484,400.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,949,500.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,089,240.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,294,416.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,158,092.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,137,852.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,015,003.000	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	917,541.000	
		オーストラリア・ドル 小計		41,660,127.160 (4,059,779,392)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,299,008.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,168,000.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,194,800.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,119,450.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,249,240.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,252,160.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,136,630.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,500,000.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,235,260.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,291,960.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,066,500.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,107,100.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,316,452.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,142,380.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,701,700.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,214,276.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,526,775.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,035,650.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,750,305.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,268,250.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,391,340.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,721,535.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,319,450.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,216,335.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,235,510.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,730,440.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,580,960.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,594,110.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,105,780.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,939,650.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,215,408.000	
		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,965,700.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,117,600.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,774,230.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,032,400.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,019,960.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,991,600.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,877,750.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,674,880.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,478,150.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,129,136.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,123,480.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,538,445.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	17,931,420.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,127,300.000	
		2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	4,993,200.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,086,200.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	17,996,940.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,250,800.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	22,975,850.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,108,450.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,069,500.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	23,839,500.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	6,973,960.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	39,894,000.000	
		2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	8,938,710.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	32,888,460.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	34,750,100.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	39,384,400.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	29,766,000.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	24,885,750.000	
		2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	29,883,900.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	19,916,000.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	19,985,600.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	オフショア・人民元	小計		904,995,785.000 (18,643,275,169)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	528,558.250	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,092,024.530	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,315,535.580	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,168,961.200	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	977,795.610	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	974,079.210	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,198,085.700	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,121,967.360	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	914,203.050	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,131,971.200	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	608,445.500	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,797,414.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,144,884.600	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	2,997,015.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	673,092.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,711,426.900	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,627,240.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,932,714.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	277,917.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,945,318.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,856,272.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,029,874.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,803,039.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	192,418.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,331,400.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	93,425.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	386,472.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	978,780.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,089,444.200	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	354,474.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	198,774.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	297,333.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	586,734.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	562,950.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	297,396.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	352,428.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,182,012.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	493,645.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	978,280.000	
		4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,012,060.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	300,000.000	306,204.000	
	カナダ・ドル	小計		46,522,063.090 (5,034,152,447)	
	シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	781,032.400	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	806,168.500	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	386,244.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	587,578.960	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	623,437.500	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	515,490.240	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	661,168.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	437,850.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	695,250.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	543,070.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	323,953.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	430,380.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	709,657.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	546,600.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	398,220.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	189,500.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	234,480.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	635,190.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,750.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	398,864.000	
		シンガポール・ドル 小計		10,003,884.100 (1,104,228,727)	
	スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,021,121.350	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,512,594.250	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,830,764.800	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,677,714.000	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,229,941.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,798,720.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,202,900.000	
		1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,864,040.000	
		スウェーデン・クローナ 小計		38,137,795.400 (541,938,073)	
	デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,570,093.320	
		1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,892,379.220	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,720,356.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,659,101.700	
		0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,770,685.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	409,450.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	968,900.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,928,960.000	
		デンマーク・クローネ 小計		39,919,925.240 (864,665,581)	
	ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	593,328.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,340,970.000	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	379,715.700	
		3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	548,682.000	
		1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	418,731.800	
		1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	213,958.500	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	900,328.000	
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	448,790.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	352,347.600	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	248,892.400	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	619,168.000	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	188,572.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	490,160.000	
		ニュージーランド・ドル 小計		6,743,644.000 (611,648,511)	
	ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,240,379.300	
		1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,123,130.200	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,186,604.500	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,277,400.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,498,456.500	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,196,208.000	
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,969,995.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,529,864.000	
		3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,621,170.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,436,100.000	
		ノルウェー・クローネ 小計		34,079,307.500 (470,635,237)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,083,609.690	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,886,760.500	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,237,274.800	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,880,140.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,316,390.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,911,998.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,362,042.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	476,680.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	1,000,000.000	1,087,630.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,361,475.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,078,540.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	841,852.920	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,298,906.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,443,674.810	
		ポーランド・ズロチ 小計		32,266,974.220 (1,199,821,623)	
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,358,999.300	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,220,066.380	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,540,964.340	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,325,688.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	736,365.540	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,414,970.390	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,885,396.480	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,419,457.000	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,750,965.480	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,239,959.200	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	981,038.400	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,563,330.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,198,806.000	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,079,538.500	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,208,376.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,278,852.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4. 893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,187,160.000	
		3. 906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,545.500	
		3. 885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,310,046.200	
		4. 921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,303,404.000	
		3. 828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,279,694.000	
		3. 757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,651,230.000	
		4. 065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,528,444.500	
		2. 632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,650,960.000	
		3. 582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,363,222.000	
		4. 696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,021,885.000	
		4. 504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	516,015.000	
		4. 457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	715,820.000	
		3. 519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	995,110.000	
		マレーシア・リンギット 小計		42,382,309.210 (1,338,933,436)	
	メキシコ・ペソ	5. 75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,251,237.900	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,397,449.000	
		5. 5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,235,180.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	941,300.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	12,016,340.000	
		7. 5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	8,870,600.000	
		7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,812,770.000	
		8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,552,750.000	
		8. 5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,708,000.000	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,710,665.510	
		7. 5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,350,330.880	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,331,987.140	
		8. 5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,643,203.440	
		8. 5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,496,410.820	
		7. 75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,850,525.200	
		7. 75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	25,220,133.920	
		7. 75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,108,847.280	
		メキシコ・ペソ 小計		276,497,731.090 (2,353,161,590)	
	ユーロ	0. 75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	314,656.160	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	268,978.320	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	768,965.870	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	254,131.200	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	738,376.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	391,923.600	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	451,095.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	441,370.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	214,879.600	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	247,488.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	414,875.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	177,804.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	486,942.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	185,214.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	274,009.500	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	713,592.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	258,352.200	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	377,868.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	300,621.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,007,640.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,329,846.610	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,062,820.140	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	559,650.560	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	135,847.200	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,187,737.600	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	378,172.800	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,106,808.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,141,568.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	824,621.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	664,620.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	234,452.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	150,160.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	978,096.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	460,051.200	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	416,652.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	128,172.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	262,728.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,280,265.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	226,986.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	293,937.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	298,122.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	290,976.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,009,080.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	829,760.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,640,044.700	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,551,522.660	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	883,556.960	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,398,028.170	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	863,136.960	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	531,438.400	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,029,369.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	435,330.600	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	480,594.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,372,558.200	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	559,624.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,362,825.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	478,338.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,026,800.800	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	534,257.800	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,081,824.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,277,216.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	208,449.000	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,127,000.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	487,328.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	370,420.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,496,190.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	564,558.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	693,427.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,325,583.630	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,432,271.620	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,048,600.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,384,004.940	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,673,449.600	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,793,060.700	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,780,327.410	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,591,126.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,219,624.820	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,131,722.600	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,722,692.960	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,598,147.780	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,125,305.860	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,067,440.540	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,973,646.160	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,260,546.200	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,915,786.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,081,177.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,600,036.300	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,761,224.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,728,171.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,235,875.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,637,420.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,430,671.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,521,625.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,579,305.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,823,000.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,547,316.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,032,912.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	764,190.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,021,832.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,786,880.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	555,170.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,019,176.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	587,314.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,144,234.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,288,768.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,561,382.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,700,000.000	1,401,089.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	197,606.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,600,000.000	1,588,768.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,689,018.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	826,050.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	900,000.000	913,716.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,505,280.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,000,188.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,483,155.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,487,925.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	996,520.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	100,335.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	301,614.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,303,232.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,184,287.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	95,046.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,068,682.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,605,736.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	92,116.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,881,320.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	413,810.500	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	99,293.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	100,199.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,194,037.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,780,311.260	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,941,038.290	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,080,451.500	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,923,906.600	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,581,226.460	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,647,649.040	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,889,318.120	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,701,054.600	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,909,854.160	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,011,386.720	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,019,648.120	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	1,899,000.000	1,868,008.320	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,362,516.640	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,915,017.540	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,685,568.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,145,934.350	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,355,377.960	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	891,161.370	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,762,328.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,104,495.900	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,207,764.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,945,165.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,963,842.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,327,677.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,509,796.500	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,891,659.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,758,985.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,154,375.200	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,580,920.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,424,943.400	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,817,330.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,418,780.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,133,450.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	533,140.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	863,865.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,683,772.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,840,902.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,308,476.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,834,928.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	2,019,087.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	2,200,000.000	1,690,436.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	3,969,158.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,464,144.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	870,170.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	992,816.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	2,200,000.000	2,181,388.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	2,200,000.000	2,210,824.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	600,000.000	600,738.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	700,000.000	730,632.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,266,044.060	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,965,529.800	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,924,722.800	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,443,249.520	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,882,723.290	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,715,043.690	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,830,460.380	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,061,290.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,244,335.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,056,468.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	624,150.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,181,810.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	737,456.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	572,212.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,066,078.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	598,653.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	790,650.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	94,253.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	500,190.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	900,000.000	739,656.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	880,920.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,292,421.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	628,956.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,230,901.200	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,665,262.080	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,796,549.320	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,233,803.670	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,418,234.450	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,744,945.650	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,819,939.220	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,193,332.000	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,291,156.500	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,860,547.920	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,006,867.680	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	660,379.280	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,311,840.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,455,368.200	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,386,676.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,582,820.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,568,720.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,096,589.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,988,763.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,265,199.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,473,525.500	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,527,773.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,170,228.800	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	650,000.000	579,156.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,817,524.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,038,323.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,052,712.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,653,285.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,254,227.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,181,998.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,058,324.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,098,825.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,464,450.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,676,040.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,828,743.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,014,980.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,600,890.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,021,245.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,552,813.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	684,456.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	465,269.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,663,887.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,419,354.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,307,460.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,019,348.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	259,118.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	701,040.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,524,275.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,843,134.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,341,232.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	769,851.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	289,506.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	498,024.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	279,387.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	482,140.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	769,016.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,425,056.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	263,130.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	194,702.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	491,285.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,314,223.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,885,540.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	303,213.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,499,700.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	98,138.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	487,710.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	399,564.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	505,745.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	910,269.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,198,656.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,147,082.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	710,150.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	405,704.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	301,170.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	400,000.000	402,688.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,520,985.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	615,606.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,539,896.440	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,261,934.060	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,045,281.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,462,375.940	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,656,786.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,162,306.720	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,155,742.760	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,371,411.750	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,122,640.100	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,547,490.500	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,855,025.340	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,300,638.180	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,902,224.120	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,232,935.040	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,774,328.760	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,037,136.100	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	842,392.200	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	665,511.430	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	740,396.520	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,060,321.640	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	943,817.320	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	744,064.510	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,028,717.290	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	464,249.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	742,776.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	655,245.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	683,227.500	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	875,349.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	407,154.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	264,050.500	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	459,865.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	674,792.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	646,672.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	260,436.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	80,981.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	195,306.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	923,323.500	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,514,075.750	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	912,502.500	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	374,551.320	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	712,010.400	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	728,209.500	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	676,431.380	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	390,458.750	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	373,613.790	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,027,602.760	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,997,310.600	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,910,494.080	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,155,678.560	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,664,046.410	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,642,725.120	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,335,712.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,507,415.700	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,809,541.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,603,455.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,936,327.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,244,960.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,754,412.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,703,235.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,476,000.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,888,357.500	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,432,416.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,178,918.400	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,404,600.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	718,676.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,220,720.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,121,840.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	873,678.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	468,155.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,759,296.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	296,179.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,212,475.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,321,982.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,543,598.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	372,576.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	819,567.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,709,652.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	381,168.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	95,289.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	972,279.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,601,043.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	931,540.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,473,105.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,285,740.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	805,072.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,515,750.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	613,164.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,583,640.300	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,854,013.080	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,092,479.600	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,186,064.270	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,853,649.020	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,105,772.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,942,362.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,522,752.750	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,081,503.170	
	ユーロ 小計			568,392,894.570 (91,801,136,402)	
国債証券 合計				274,718,308,942 [274,718,308,942]	
合計				274,718,308,942 [274,718,308,942]	

- (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 275 銘柄	100%	48.1%
イギリス・ポンド	国債証券 58 銘柄	100%	5.0%
イスラエル・シケル	国債証券 14 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 28 銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 64 銘柄	100%	6.8%
カナダ・ドル	国債証券 41 銘柄	100%	1.8%
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 8 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 10 銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14 銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 29 銘柄	100%	0.5%

メキシコ・ペソ	国債証券	17 銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	375 銘柄	100%	33.4%

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12月1日から2024年5月31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7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 秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル75の2023年12月1日から2024年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワライフスタイル75の2024年5月31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12月1日から2024年5月31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。

ダイワライフスタイル75

(1) 【中間貸借対照表】

		当中間計算期間末 2024年5月31日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		9,968,243
親投資信託受益証券		1,276,573,543
未収入金		67,000
流動資産合計		1,286,608,786
資産合計		1,286,608,786
負債の部		
流動負債		
未払解約金		172,163
未払受託者報酬		538,966
未払委託者報酬		5,524,813
その他未払費用		50,441
流動負債合計		6,286,383
負債合計		6,286,383
純資産の部		
元本等		
元本	※1	542,523,618
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)		737,798,785
(分配準備積立金)		393,363,801
元本等合計		1,280,322,403
純資産合計		1,280,322,403
負債純資産合計		1,286,608,786

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 日 金 額 (円)
営業収益	
受取利息	1,308
有価証券売買等損益	157,376,061
営業収益合計	157,377,369
営業費用	
支払利息	82
受託者報酬	538,966
委託者報酬	5,524,813
その他費用	50,441
営業費用合計	6,114,302
営業利益又は営業損失 (△)	151,263,067
経常利益又は経常損失 (△)	151,263,067
中間純利益又は中間純損失 (△)	151,263,067
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 (△)	6,702,583
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	595,158,392
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,858,892
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	37,858,892
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,778,983
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	39,778,983
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	737,798,785

(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 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 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 2024 年 5 月 31 日現在
1. ※1 期首元本額	548,631,175 円
期中追加設定元本額	30,457,532 円
期中一部解約元本額	36,565,089 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	542,523,618 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 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 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 2024 年 5 月 31 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 2024 年 5 月 31 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 2024年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,359円 (23,599円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	17,144,745,389
株式 ※2※3	344,868,750,330
派生商品評価勘定	151,686,500
未収入金	592,341,224
未収配当金	3,043,804,606
前払金	54,342,600
その他未収収益 ※4	28,098,687
差入委託証拠金	242,901,406
流動資産合計	366,126,670,742
資産合計	366,126,670,742
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,493,300
未払金	566,475,386
未払解約金	297,756,660
受入担保金	7,943,423,164
流動負債合計	8,810,148,510
負債合計	8,810,148,510
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	177,477,093,882
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	179,839,428,350
元本等合計	357,316,522,232
純資産合計	357,316,522,232
負債純資産合計	366,126,670,742

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 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	2024 年 5 月 31 日現在
1. ※1 期首	2023 年 12 月 1 日
期首元本額	166,904,971,223 円
期中追加設定元本額	19,719,704,480 円
期中一部解約元本額	9,147,581,821 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	2,784,735,841 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,091,720,591 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	908,145 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	9,102,808 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	145,883,179 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,667,234 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	344,658,301 円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,193,669,886 円

区分	2024年5月31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)	722,723,374円
D-I's TOPIXインデックス	12,956,090円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	240,592,484円
iFree TOPIXインデックス	7,996,085,004円
iFree 8資産バランス	4,634,315,525円
iFree 年金バランス	1,083,190,286円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,175,218円
DCダイワ日本株式インデックス	71,345,252,604円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,009,505,811円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,901,050,828円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,874,955,251円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,740,646,727円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	47,120,156円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	72,303,269円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,618,585,175円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,110,455円
ダイワつみたてインデックスバランス50	12,116,962円
ダイワつみたてインデックスバランス70	32,204,662円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	17,216,962,732円
ダイワ世界バランスファンド40VA	46,948,593円
ダイワ世界バランスファンド60VA	19,166,735円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,243,056,313円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	320,340,775円
ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	44,687,463円
ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	59,424,894円
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	246,637,304円
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	12,646,706,754円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	8,432,403,523円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,354,452,826円
スタイル9 (4資産分散・保守型)	288,607円
スタイル9 (4資産分散・バランス型)	2,413,746円
スタイル9 (4資産分散・積極型)	3,325,292円
スタイル9 (6資産分散・保守型)	189,174円
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	4,324,968円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	5,214,808円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	245,446円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	3,628,305円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	10,148,445円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,063,618,358円
ダイワライフスタイル25	94,113,687円
ダイワライフスタイル50	443,535,733円
ダイワライフスタイル75	382,541,278円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド)	7,891,482,257円

区分	2024年5月31日現在
計	177,477,093,882 円
2. 期末日における受益権の総数	177,477,093,882 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,691,630,220 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 770,660,000 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	2024年5月31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	2024年5月31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	12,158,242,600	-	12,307,680,000	149,437,400
合計	12,158,242,600	-	12,307,680,000	149,437,400

- (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)

2024年5月31日現在	
1口当たり純資産額	2.0133円
(1万口当たり純資産額)	(20,133円)

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	305,989,861
国債証券	96,154,937,240
地方債証券	6,739,298,500
特殊債券	3,822,859,400
社債券	8,902,518,800
未収利息	241,339,115
前払費用	12,424,229
流動資産合計	116,179,367,145
資産合計	116,179,367,145
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	150,574,421
流動負債合計	250,574,421
負債合計	250,574,421
純資産の部	
元本等	
元本	※1 88,774,999,118
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	27,153,793,606
元本等合計	115,928,792,724
純資産合計	115,928,792,724
負債純資産合計	116,179,367,145

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 5 月 31 日現在
1. ※1 期首	2023 年 12 月 1 日
期首元本額	82,851,732,167 円
期中追加設定元本額	13,224,411,195 円
期中一部解約元本額	7,301,144,244 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	34,251,260 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	216,730,126 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	41,043,894 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	510,580,994 円
DCダイワ日本債券インデックス	10,365,858,442 円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	15,356,865,340 円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,258,511,143 円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,455,576,148 円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	204,477,420 円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	207,601,314 円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	61,483,152 円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	28,721,071,610 円
ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)	13,584,179,795 円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,738,390,425 円
スタイル9(4資産分散・保守型)	1,899,372 円

区分	2024年5月31日現在
スタイル9 (4資産分散・バランス型)	4,382,750円
スタイル9 (4資産分散・積極型)	448,084円
スタイル9 (6資産分散・保守型)	1,385,212円
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	8,738,113円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	731,428円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	1,766,836円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	6,952,823円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	1,299,306円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	733,989,366円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,969,847,248円
ダイワライフスタイル25	457,756,265円
ダイワライフスタイル50	637,936,748円
ダイワライフスタイル75	191,244,504円
計	88,774,999,118円
2. 期末日における受益権の総数	88,774,999,118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	2024年5月31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

2024年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.3059円
(1万口当たり純資産額)	(13,059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

	2024年5月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,113,839,728
コール・ローン	20,450,476,077
株式	515,770,117,832
投資証券	9,989,938,894
派生商品評価勘定	293,922,274
未収入金	59,080,657
未収配当金	753,597,426
差入委託証拠金	11,581,674,491
流動資産合計	563,012,647,379
資産合計	563,012,647,379
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	261,920,599
未払金	24,014,030
未払解約金	162,826,400
流動負債合計	448,761,029
負債合計	448,761,029
純資産の部	
元本等	
元本	※1 87,134,701,799
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	475,429,184,551
元本等合計	562,563,886,350
純資産合計	562,563,886,350
負債純資産合計	563,012,647,379

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 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 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 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	2024 年 5 月 31 日現在
1. ※1 期首	2023 年 12 月 1 日
期首元本額	78,806,686,628 円
期中追加設定元本額	11,726,650,827 円
期中一部解約元本額	3,398,635,656 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスVA	232,388,722 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	1,404,824 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	19,314,674 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	3,622,837 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	105,788,926 円
外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	104,501,488 円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	81,610,632 円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,490,438,300 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)	772,121,643 円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	5,175,790,737 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)	563,875,290 円
D-I's 外国株式インデックス	16,363,152 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	48,067,874 円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	8,525,433,489 円
i F r e e 8資産バランス	1,462,261,186 円

区分	2024年5月31日現在
i F r e e 年金バランス	334,585,574 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	14,602,034 円
DCダイワ外国株式インデックス	49,896,209,994 円
ダイワ・ライフ・バランス30	480,436,092 円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,042,220,980 円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,025,285,494 円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,385,105,652 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	10,031,122 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	11,447,027 円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,463,619,508 円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,895,870 円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,503,591 円
ダイワつみたてインデックスバランス70	5,490,305 円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	14,642,600 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	44,789,089 円
ダイワ世界バランスファンド60VA	30,229,918 円
ダイワ・バランスファンド35VA	760,035,852 円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	43,613,830 円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	127,189,928 円
スタイル9（4資産分散・保守型）	116,889 円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	982,368 円
スタイル9（4資産分散・積極型）	1,373,965 円
スタイル9（6資産分散・保守型）	76,460 円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,752,325 円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,146,386 円
スタイル9（8資産分散・保守型）	88,372 円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,300,724 円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,817,003 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,295,275,018 円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	421,571,474 円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	3,642,609,230 円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,165,982,258 円
ダイワライフスタイル25	7,313,441 円
ダイワライフスタイル50	35,008,019 円
ダイワライフスタイル75	29,911,662 円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	81,305,208 円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	78,711,436 円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	68,441,327 円
計	87,134,701,799 円
2. 期末日における受益権の総数	87,134,701,799 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	2024年5月31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	2024年5月31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	36,314,139,279	-	36,305,293,624	△8,845,655
合計	36,314,139,279	-	36,305,293,624	△8,845,655

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年5月31日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	20,236,888,010	-	20,277,735,340	40,847,330
アメリカ・ドル	13,698,045,140	-	13,691,135,500	△6,909,640
イギリス・ポンド	1,027,729,850	-	1,036,893,000	9,163,150
オーストラリア・ドル	747,907,990	-	758,597,750	10,689,760
カナダ・ドル	1,725,089,450	-	1,728,272,090	3,182,640
スイス・フラン	1,149,048,400	-	1,162,785,000	13,736,600
ユーロ	1,889,067,180	-	1,900,052,000	10,984,820
合計	20,236,888,010	-	20,277,735,340	40,847,330

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2024年5月31日現在
1口当たり純資産額	6.4563円
(1万口当たり純資産額)	(64,563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

	2024年5月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,259,913,048
コール・ローン	2,255,789,530
国債証券	309,220,514,522
派生商品評価勘定	8,827,924
未収入金	981,906
未収利息	2,368,221,876
前払費用	154,130,300
流動資産合計	318,268,379,106
資産合計	318,268,379,106
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,502,682
未払金	575,815,395
未払解約金	94,126,707
流動負債合計	671,444,784
負債合計	671,444,784
純資産の部	
元本等	
元本	※1 86,484,983,635
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	231,111,950,687
元本等合計	317,596,934,322
純資産合計	317,596,934,322
負債純資産合計	318,268,379,106

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 12 月 1 日 至 2024 年 5 月 31 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）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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	2024 年 5 月 31 日現在
1. ※1 期首	2023 年 12 月 1 日
期首元本額	82,595,678,754 円
期中追加設定元本額	7,823,275,242 円
期中一部解約元本額	3,933,970,361 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	350,236,069 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,950,980 円

区分	2024年5月31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)	33,722,207円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	14,812,611円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	185,995,811円
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)	725,087,582円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	585,182,440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)	947,088,632円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	4,800,308,505円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	1,138,493,552円
D-I's 外国債券インデックス	1,744,266円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	21,269,758円
iFree 外国債券インデックス	2,103,968,435円
iFree 8資産バランス	2,506,197,108円
iFree 年金バランス	588,397,855円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	1,723,571円
DCダイワ外国債券インデックス	51,814,722,661円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,177,196,338円
ダイワ・ライフ・バランス50	874,156,311円
ダイワ・ライフ・バランス70	709,875,364円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	711,890,712円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	577,596,785円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	235,535,408円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	35,092,344円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	21,533,507円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,265,628,149円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,872,476円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,189,154円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,880,664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)	1,763,709,912円
ダイワ世界バランスファンド40VA	90,565,215円
ダイワ世界バランスファンド60VA	26,110,093円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,647,176,457円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	170,383,732円
スタイル9(4資産分散・保守型)	76,753円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	1,024,918円
スタイル9(4資産分散・積極型)	901,321円
スタイル9(6資産分散・保守型)	26,750円

区分	2024年5月31日現在
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	677,159円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	250,413円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	34,304円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	684,312円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	722,301円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	139,519,448円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,779,566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)	3,150,587,823円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,877,969,983円
ダイワライフスタイル25	25,570,555円
ダイワライフスタイル50	59,561,312円
ダイワライフスタイル75	17,302,053円
計	86,484,983,635円
2. 期末日における受益権の総数	86,484,983,635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	2024年5月31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	2024年5月31日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,123,934,759	-	2,131,260,001	7,325,242

種類	2024年5月31日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
アメリカ・ドル	413,621,029	-	415,172,377	1,551,348
イギリス・ポンド	147,984,398	-	150,571,234	2,586,836
オフショア・人民元	892,126,206	-	891,275,791	△850,415
カナダ・ドル	213,863,437	-	214,723,020	859,583
シンガポール・ドル	43,339,166	-	43,748,173	409,007
スウェーデン・クローナ	14,479,514	-	14,986,920	507,406
ノルウェー・クローネ	13,254,895	-	13,904,424	649,529
マレーシア・リンギット	15,003,000	-	14,983,920	△19,080
メキシコ・ペソ	86,942,171	-	87,516,106	573,935
ユーロ	283,320,943	-	284,378,036	1,057,093
合計	2,123,934,759	-	2,131,260,001	7,325,242

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2024年5月31日現在
1口当たり純資産額	3.6723円
(1万口当たり純資産額)	(36,723円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年5月31日

I 資産総額	1,286,608,786 円
II 負債総額	6,286,383 円
III 純資産総額 (I - II)	1,280,322,403 円
IV 発行済数量	542,523,618 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.3599 円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年5月31日

I 資産総額	366,126,670,742 円
II 負債総額	8,810,148,510 円
III 純資産総額 (I - II)	357,316,522,232 円
IV 発行済数量	177,477,093,882 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.0133 円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年5月31日

I 資産総額	116,179,367,145 円
II 負債総額	250,574,421 円
III 純資産総額 (I - II)	115,928,792,724 円
IV 発行済数量	88,774,999,118 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.3059 円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年5月31日

I	資産総額	563,012,647,379 円
II	負債総額	448,761,029 円
III	純資産総額 (I - II)	562,563,886,350 円
IV	発行済数量	87,134,701,799 口
V	1 単位当たり純資産額 (III / IV)	6.4563 円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年5月31日

I	資産総額	318,268,379,106 円
II	負債総額	671,444,784 円
III	純資産総額 (I - II)	317,596,934,322 円
IV	発行済数量	86,484,983,635 口
V	1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.6723 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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (6) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (7) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (8) 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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

2024 年 5 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。

2024年5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	87	334,309
追加型株式投資信託	795	29,193,747
株式投資信託 合計	882	29,528,056
単位型公社債投資信託	99	181,645
追加型公社債投資信託	14	1,503,020
公社債投資信託 合計	113	1,684,665
総合計	995	31,212,721

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

独立監査人の監査報告書

2024年5月27日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行を決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,982	4,813
有価証券	346	503
前払費用	393	481
未収委託者報酬	12,525	16,513
未収収益	47	78
関係会社短期貸付金	22,100	23,400
その他	59	88
流動資産計	37,455	45,878
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	3	2
器具備品	193	174
無形固定資産	1,482	1,342
ソフトウェア	1,351	1,063
ソフトウェア仮勘定	131	279
投資その他の資産	13,824	13,660
投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180
資産合計	52,959	61,058

(単位:百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	101	158
未払金	5,874	6,187
未払収益分配金	38	39
未払償還金	12	12
未払手数料	4,525	5,849
その他未払金	※2 1,297	※2 285
未払費用	3,987	5,035
未払法人税等	560	3,842
未払消費税等	327	872
賞与引当金	692	1,048
その他	2	1
流動負債計	11,545	17,146
固定負債		
退職給付引当金	2,276	2,227
役員退職慰労引当金	51	62
その他	0	-
固定負債計	2,329	2,289
負債合計	13,874	19,435
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048
福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月 31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月 31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	286	220
受取配当金	25	40
有価証券償還益	150	32
その他	146	93
営業外収益計	608	388
営業外費用		
有価証券償還損	2	196
投資有価証券売却損	244	1
その他	31	18
営業外費用計	277	215
経常利益	15,642	17,540
特別損失		
システム刷新関連費用	-	153
投資有価証券評価損	257	132
関係会社整理損失	229	-
特別損失計	486	286
税引前当期純利益	15,155	17,253
法人税、住民税及び事業税	4,589	5,533
法人税等調整額	248	△139
法人税等合計	4,838	5,394
当期純利益	10,317	11,859

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

※2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2023年3月31日)

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

当事業年度(2024年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2022年4月1日至2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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
③ 1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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2024年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(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（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

当事業年度（2024年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（2）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度 (2023年3月31日)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度 (2023年3月31日)

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

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

当事業年度 (2024年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	144	55	89
(2) その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	△213
小計	1,543	1,756	△213
合計	8,285	6,079	2,205

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,399百万円	2,276百万円
勤務費用	150	138
退職給付の支払額	△ 322	△ 266
その他	48	78
退職給付債務の期末残高	2,276	2,227

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

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,276 百万円	2,227 百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227
退職給付引当金	2,276	2,227
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	150 百万円	138 百万円
その他	153	9
確定給付制度に係る退職給付費用	303	147

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度184百万円、当事業年度187百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262
投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	△ 459	△ 486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 356	△ 740
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 515	△ 899
繰延税金資産の純額	824	524

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

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 76,221 百万円、その他 717 百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	11,100 0	関係会社短期貸付金 -	23,400 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	2,354	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料 (注2)	13,749	未払手数料	3,491
							不動産の賃借料 (注3)	1,030	長期差入保証金	1,010
同一の親会社をもつ会社	株大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守 (注4)	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	14,983.42円	1株当たり純資産額 15,956.63円
1株当たり当期純利益	3,955.35円	1株当たり当期純利益 4,546.57円

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

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

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益 (百万円)	10,317	11,859
普通株式の期中平均株式数 (株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

(株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行)

2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議いたしました。条件等は次のとおりであります。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式 652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込期日	2024年7月1日(予定)
資金の使途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

4【利害関係人との取引制限】

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

- 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 通常の実取引の条件と異なる条件であつ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つて、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
2024年5月15日、株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携を締結いたしました。本提携に基づき2024年7月1日付、かんぼ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施する予定です。
- 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

(ダイワライフスタイル75)

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21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、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックス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、上記に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

② 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券…	信託財産の純資産総額の60%
日本債券インデックスマザーファンド受益証券……………	信託財産の純資産総額の20%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券……………	信託財産の純資産総額の15%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券……………	信託財産の純資産総額の5%

また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

③ 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。

④ 保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

⑤ 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

⑥ 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 株式への実質投資割合の制限

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実質投資割合の制限

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 投資信託証券への実質投資割合の制限

投資信託証券（上記に掲げる各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実質投資割合の制限

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 同一銘柄の転換社債等への実質投資割合の制限

同一銘柄の転換社債、ならびに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への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥ 外貨建資産への実質投資割合の制限

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産総額の50%以下とします。

- ⑦ 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25条の範囲で行ないます。
- ⑧ スワップ取引の範囲
スワップ取引は、約款第26条の範囲で行ないます。
- ⑨ 金利先渡し取引および為替先渡し取引の範囲
金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第27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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 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
(ダイワライフスタイル75)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、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。以下この条において同じ。）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。

② 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1,000万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、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1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52条第1項、第53条第1項、第54条第1項および第56条第2項の規定による解約の日までとします。

(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1,000万口に、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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法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。

(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。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、わが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③ 第32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 この信託の受益権は、2007年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社

債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。)の規定の適用を受け、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、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。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。)を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券にかかる受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券(当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。)は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者(委託者の指定する金融商品取引法第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(委託者の指定する金融商品取引法第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。)に当該申請の手続を委任することができます。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、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 指定販売会社は、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って契約(以下「別に定める契約」といいます。)を結んだ取得申込者に限り、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項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、委託者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。
- ⑤ 第2項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、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等に相当する金額を加算した価額とします。なお、受益者

が別に定める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43条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

第13条 (削 除)

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第14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ます。

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ます。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ます。

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15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。

第16条 (削 除)

第17条 (削 除)

第18条 (削 除)

第19条 (削 除)

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第20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次の第1号から第4号までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の第5号から第25号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します。

1. トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券
2. 日本債券インデックスマザーファンド受益証券
3. 外国株式インデックスマザーファンド受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンド受益証券
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、第5号から第15号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、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. 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。）
 21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 22. 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。）
 23. 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。）
 24. 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
 25. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
 なお、第5号の証券または証書ならびに第16号および第20号の証券または証書のうち第5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6号から第10号までの証券ならびに第18号の証券のうち投資法人債券ならびに第16号および第20号の証券または証書のうち第6号から第10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17号の証券および第18号の証券（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。
- 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、信託金を前項第1号から第4号までの金融商品により運用することの指図ができます。
- ④ 委託者は、取得時において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、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（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号に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第20条の2 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、受託者および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。以下この条および第33条において同じ。）、第33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20条第1項および第2項に定める資産への投資を、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限り行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第24条から第27条まで、第29条、第32条、第38条から第40条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

(運用の基本方針)

第21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22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23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24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、株券の引き渡しまたは買い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。

- 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（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。）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25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て取り扱うものとします（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および組入抵当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

び償還金等ならびに第20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、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を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20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。）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第20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（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）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26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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲)

第27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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第27条の2 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。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第28条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債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10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転換社債および転換社債型

新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第29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および公社債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の50%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。
- 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たときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(外貨建資産への投資制限)

第30条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

- 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総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第31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32条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第32条の2 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33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（裁量性のないものに限りません。）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

第34条 (削 除)

(混蔵寄託)

第35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。

第36条 (削 除)

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第37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、速やかに登記または登録をするものとします。
- 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38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ならびに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39条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、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40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より支弁します。

(損益の帰属)

第41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42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43条 この信託の計算期間は、毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は、2000年4月28日から2000年11月30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、その翌日より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)

第44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。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第45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ならびに信託財産にかかる監査報酬および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46条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第43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90の率を乗じて得た額とします。

- 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信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- 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47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払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第48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（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。）については第49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第49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、償還金および一部解約金の支払い)

第49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。なお、2007年1月4日以降においても、第50条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、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。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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。
- ④ 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、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。

（収益分配金および償還金の時効）

第50条 受益者が、収益分配金については前条第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前条第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51条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者または指定販売会社の定める単位（別に定める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、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 2007年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、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。ただし、2007年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、2007年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の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。なお、第1項の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。
- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所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項による一部解約の実行の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の実行の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の実行の請求を撤回できます。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の実行の請求を受け付けたものとして、第4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51条の2 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、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52条 委託者は、第4条の規定による信託終了前に、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、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、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項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第53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57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54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57条第4項に該当する場合を除き、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55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56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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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57条の規定に従い、新受託者を選任します。

- 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)

第57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ができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更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。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公

告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第57条の2 第52条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第52条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第57条の3 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った場合には、これを交付します。

(公告)

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、2008年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、2008年7月1日以降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 2008年7月1日以降において、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59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。

(付 則)

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49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 2006年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の種類）から第19条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

第 4条 第27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、その取り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 5条 第27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、その取り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り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金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。

2000年 4月28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